

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券インデックスe	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

外国債券インデックスe

運用報告書(全体版)

第13期(決算日 2023年2月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組 比	債券 率	債券 先比	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
第9期(2019年2月7日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
第10期(2020年2月7日)	13,461	0	△2.1	447.318	△1.4	96.6	1.6	1.3	3,294
第11期(2021年2月8日)	14,274	0	6.0	477.531	6.8	97.3	1.3	1.3	3,221
第12期(2022年2月7日)	14,758	0	3.4	496.296	3.9	97.6	1.5	1.5	2,912
第13期(2022年2月7日)	14,955	0	1.3	505.817	1.9	97.9	1.4	1.4	2,805
第13期(2023年2月7日)	14,783	0	△1.2	503.924	△0.4	98.2	0.8	0.8	2,708

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入 率	債券先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2022年 2月7日	円	%		%	%	%
2月7日	14,955	—	505.817	—	97.9	1.4
2月末	14,746	△1.4	500.360	△1.1	98.0	1.0
3月末	15,229	1.8	514.015	1.6	97.9	1.2
4月末	15,251	2.0	514.167	1.7	98.1	1.0
5月末	15,150	1.3	512.002	1.2	97.7	1.2
6月末	15,506	3.7	527.332	4.3	96.8	2.0
7月末	15,610	4.4	528.619	4.5	97.8	1.2
8月末	15,415	3.1	523.319	3.5	97.6	1.2
9月末	15,269	2.1	516.025	2.0	97.6	1.3
10月末	15,709	5.0	531.092	5.0	98.5	0.5
11月末	15,232	1.9	516.243	2.1	98.4	0.6
12月末	14,485	△3.1	494.385	△2.3	97.7	1.2
2023年 1月末	14,649	△2.0	498.367	△1.5	97.1	1.7
(当期末) 2023年 2月7日	円	%		%	%	%
2月7日	14,783	△1.2	503.924	△0.4	98.2	0.8

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

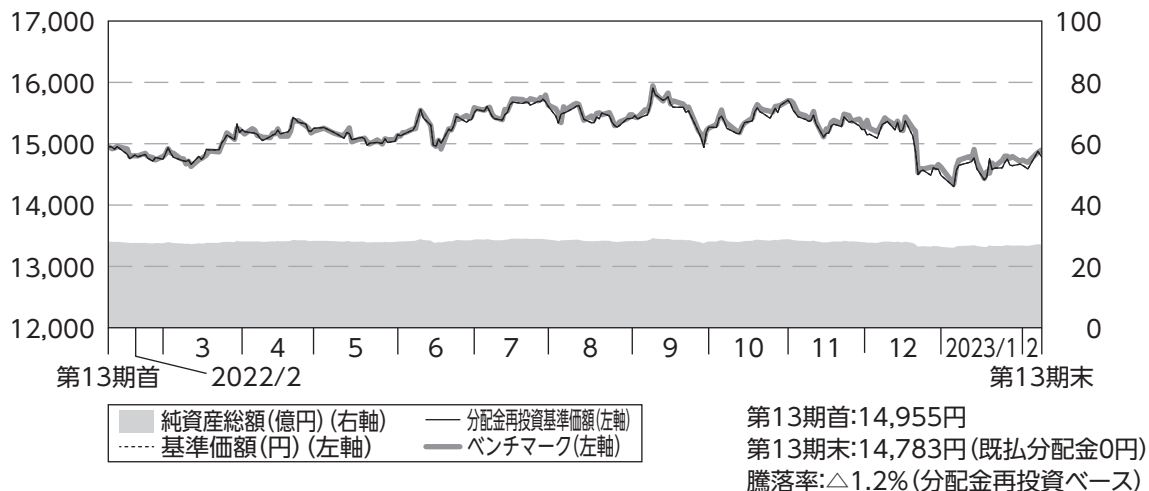
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

基準価額等の推移

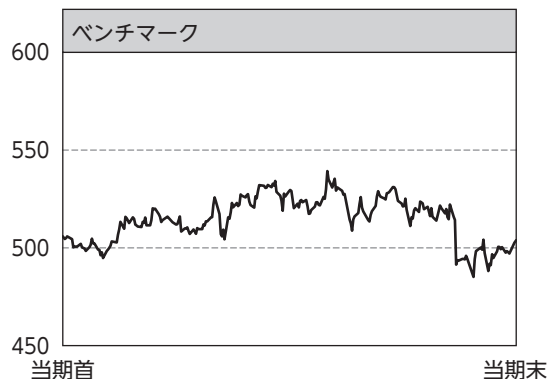


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2022年7月下旬にかけて、インフレ加速から主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)推移となったものの、日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから外国為替市場で主要通貨に対して円安が進行し、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。8月から11月上旬にかけては、主要国の長期金利上昇と円安推移が続いたことから、基準価額は上下動を伴いながらもレンジ内推移となりました。11月中旬から12月中旬にかけて、米国でのインフレ率の上昇ピークアウト観測から主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)したものの、それまでの主要通貨に対する円安からの円買戻しの展開により、基準価額は緩やかに下落しました。12月下旬に、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げが事実上の利上げと受け止められて、日本と主要国の長期金利差縮小観測から急激に円高が進行し、基準価額は大幅下落となりました。2023年1月以降は、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がり主要国の長期金利が低下したことから、基準価額は緩やかに上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2022年11月上旬にかけて、FRB(米連邦準備理事会)とECB(欧州中央銀行)が大幅利上げを連続で実施したことから、大幅に上昇推移となりました。11月中旬以降は、主要中央銀行がインフレ抑制を最優先する姿勢を明らかにした一方で、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がる中、先行きの景気後退リスクが意識されたことから、上昇幅を縮小しました。

外国為替市場では、2022年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に概ね円安推移となりました。その後は、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げなどを材料に円買戻しの流れとなり、円は下落率を縮小しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「外国債券マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2)ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

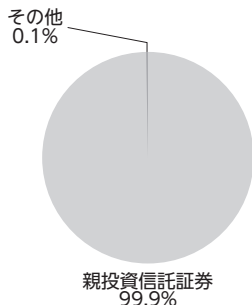
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

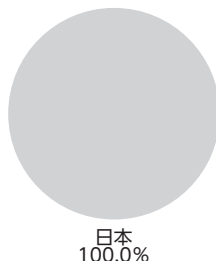
	当期末
	2023年2月7日
外国債券マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

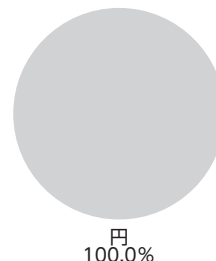
○資産別配分



○国別配分



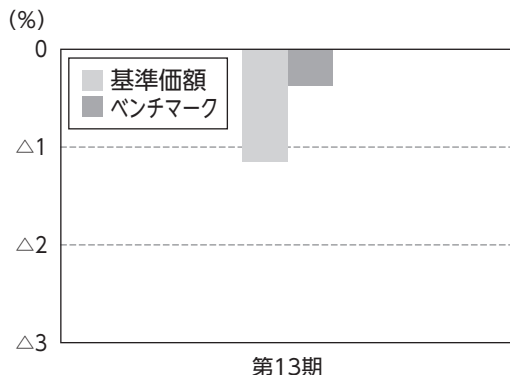
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主要因は、信託報酬(マイナス要因)、為替評価差^(※)(マイナス要因)等です。

(※)当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第13期	
	2022年2月8日～2023年2月7日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	6,373	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) —印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月8日～2023年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	84円	0.550%	(a) 信託報酬 = $\frac{[\text{期中の平均基準価額}] \times \text{信託報酬率}}{[\text{期中の平均基準価額}]}$ 期中の平均基準価額は15,187円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(32)	(0.209)	
(販売会社)	(45)	(0.297)	
(受託会社)	(7)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.021	(d) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.015)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	87	0.571	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

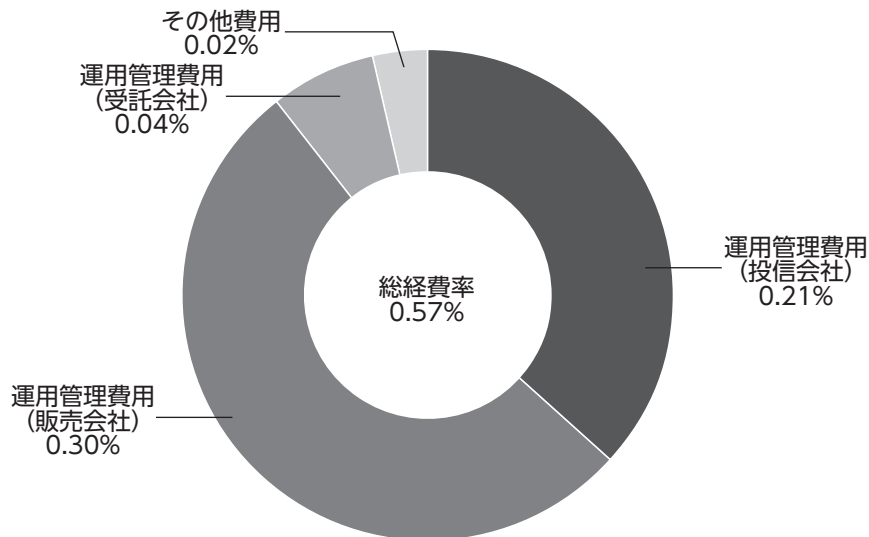
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.57%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券マザーファンド	千口 32,723	千円 87,706	千口 63,630	千円 170,631

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000393	百万円 0.000393	% 100.0	百万円 0.000393	百万円 0.000393	% 100.0
コール・ローン	1,442	119	8.3	1,443	118	8.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 31,706	百万円 31,706	% 100.0	百万円 32,631	百万円 32,631	% 100.0
為替直物取引	10,172	10,117	99.5	7,660	7,579	98.9
金 銭 信 託	0.066643	0.066643	100.0	0.066643	0.066643	100.0
コール・ローン	434,046	34,427	7.9	434,591	34,250	7.9

<平均保有割合 1.8%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 1,064,281	千口 1,033,375	千円 2,706,719

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、57,650,368千口です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	2,706,719	99.7
コール・ローン等、その他	9,167	0.3
投資信託財産総額	2,715,886	100.0

(注1) 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(149,659,006千円)の投資信託財産総額(151,103,180千円)に対する比率は99.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=132.58円	1カナダドル=98.69円	1メキシコペソ=6.92円
1ユーロ=142.27円	1イギリスポンド=159.56円	1スウェーデンクローナ=12.50円
1ノルウェークローネ=12.83円	1デンマーククローネ=19.12円	1ポーランドズロチ=29.9924円
1オーストラリアドル=91.39円	1ニュージーランドドル=83.70円	1シンガポールドル=99.92円
1マレーシアリングギット=30.765円	1オフショア人民元=19.5077円	1イスラエルシェケル=38.1706円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年2月7日現在
(A) 資 産	2,715,886,931円
コール・ローン等	9,167,681
外国債券マザーファンド(評価額)	2,706,719,250
(B) 負 債	7,805,332
未 払 解 約 金	142
未 払 信 託 報 酬	7,727,966
未 払 利 息	10
そ の 他 未 払 費 用	77,214
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,708,081,599
元 本	1,831,886,214
次 期 繰 越 損 益 金	876,195,385
(D) 受 益 権 総 口 数	1,831,886,214口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,783円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	△2,299円
受 取 利 息	29
支 払 利 息	△2,328
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△18,466,300
売 買 益	4,035,254
売 買 損	△22,501,554
(C) 信 託 報 酬 等	△15,571,045
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△34,039,644
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	300,855,536
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	609,379,493
(配 当 等 相 当 額)	(708,218,389)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△98,838,896)
(G) 計 (D+E+F)	876,195,385
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	876,195,385
追 加 信 託 差 損 益 金	609,379,493
(配 当 等 相 当 額)	(708,451,322)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△99,071,829)
分 配 準 備 積 立 金	459,058,453
繰 越 損 益 金	△192,242,561

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,876,117,876円、期中追加設定元本額は114,947,838円、期中一部解約元本額は159,179,500円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	39,571,201円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	708,451,322円
(D) 分配準備積立金額	419,487,252円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,167,509,775円
(F) 期末残存口数	1,831,886,214口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	6,373円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2023年2月7日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2019年2月7日)	23,318	△1.6	447.318	△1.4	96.6	1.6	133,456
第19期(2020年2月7日)	24,866	6.6	477.531	6.8	97.4	1.3	141,275
第20期(2021年2月8日)	25,857	4.0	496.296	3.9	97.7	1.5	144,346
第21期(2022年2月7日)	26,350	1.9	505.817	1.9	97.9	1.4	150,121
第22期(2023年2月7日)	26,193	△0.6	503.924	△0.4	98.3	0.8	151,005

(注)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2022年 2月7日	26,350	—	505.817	—	97.9	1.4
2月末	25,990	△1.4	500.360	△1.1	98.0	1.0
3月末	26,854	1.9	514.015	1.6	97.9	1.2
4月末	26,904	2.1	514.167	1.7	98.1	1.0
5月末	26,739	1.5	512.002	1.2	97.8	1.2
6月末	27,381	3.9	527.332	4.3	96.9	2.0
7月末	27,578	4.7	528.619	4.5	97.9	1.3
8月末	27,246	3.4	523.319	3.5	97.7	1.2
9月末	27,001	2.5	516.025	2.0	97.7	1.3
10月末	27,793	5.5	531.092	5.0	98.6	0.5
11月末	26,960	2.3	516.243	2.1	98.4	0.6
12月末	25,650	△2.7	494.385	△2.3	97.8	1.2
2023年 1月末	25,952	△1.5	498.367	△1.5	97.2	1.7
(当期末) 2023年 2月7日	26,193	△0.6	503.924	△0.4	98.3	0.8

(注1)騰落率は期首比です。

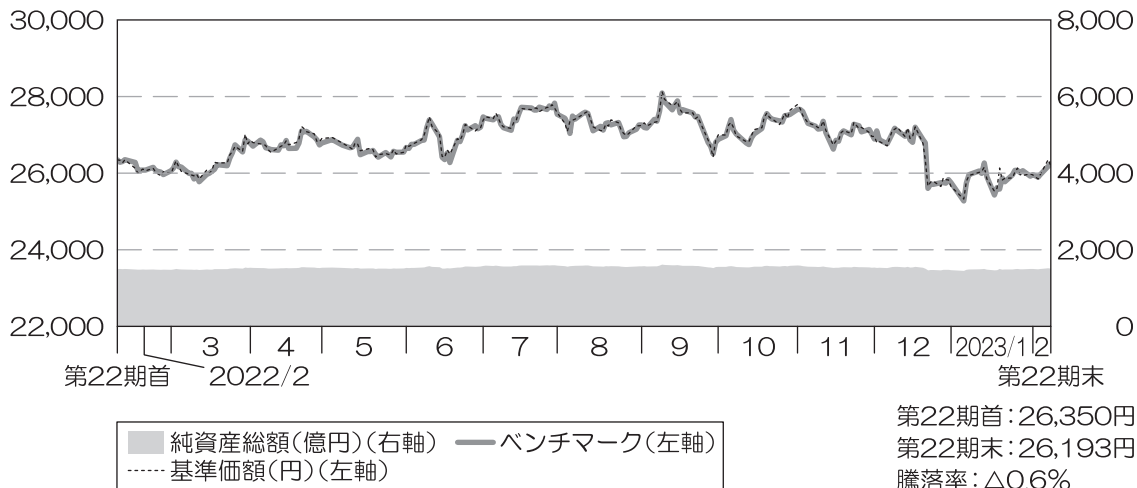
(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

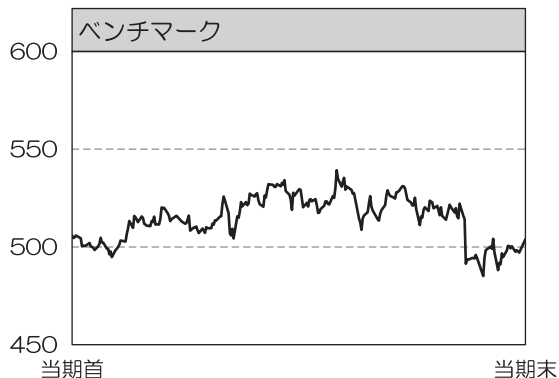


(注)ベンチマークは、2022年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2022年7月下旬にかけて、インフレ加速から主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)推移となったものの、日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから外国為替市場で主要通貨に対して円安が進行し、基準価額は上昇しました。8月から11月上旬にかけては、主要国の長期金利上昇と円安推移が続いたことから、基準価額は上下動を伴いながらもレンジ内推移となりました。11月中旬から12月中旬にかけて、米国でのインフレ率の上昇ピークアウト観測から主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)したものの、それまでの主要通貨に対する円安からの円買戻しの展開により、基準価額は緩やかに下落しました。12月下旬に、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げが事実上の利上げと受け止められて、日本と主要国の長期金利差縮小観測から急激に円高が進行し、基準価額は大幅下落となりました。2023年1月以降は、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がり主要国の長期金利が低下したことから、基準価額は緩やかに上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2022年11月上旬にかけて、FRB(米連邦準備理事会)とECB(欧州中央銀行)が大幅利上げを連続で実施したことから、大幅に上昇推移となりました。11月中旬以降は、主要中央銀行がインフレ抑制を最優先する姿勢を明らかにした一方で、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がる中、先行きの景気後退リスクが意識されたことから、上昇幅を縮小しました。

外国為替市場では、2022年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に概ね円安推移となりました。その後は、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げなどを材料に円買戻しの流れとなり、円は下落率を縮小しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

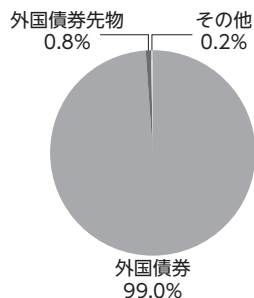
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	0.9%
2	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.9%
3	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	0.9%
4	T 2.875% 08/15/28	アメリカ	0.9%
5	CGB 1.99% 04/09/25	中国	0.8%
6	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.6%

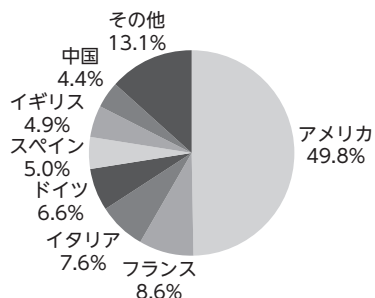
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.375% 04/30/25	アメリカ	0.6%
8	T 2.25% 03/31/24	アメリカ	0.6%
9	T 1.125% 10/31/26	アメリカ	0.6%
10	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
組入銘柄数		817	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

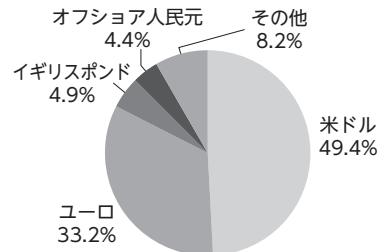
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

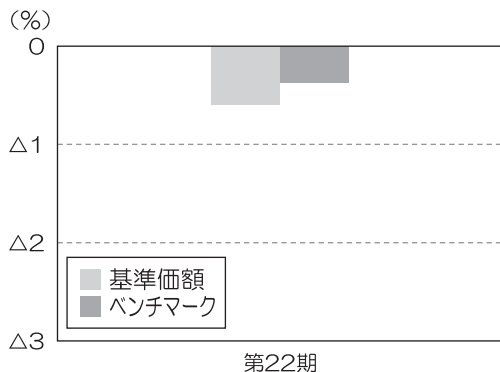


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差^(※)(マイナス要因)等です。

(※) 当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月8日～2023年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	4	0.015	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(4)	(0.015)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	4	0.015	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(26,837円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 135,341	千米ドル 122,382
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 9,152	千カナダドル 7,955
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 27,400	千メキシコペソ 29,576
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 16,216	千ユーロ 16,709
	イ タ リ ア	国 債 証 券	11,294	15,623
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	9,407	13,020
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	1,914	3,007
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	8,149	10,649
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	1,922	2,609
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	1,887	2,254
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	690	897
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	257	947
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 9,987	千イギリスポンド 6,711
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 187	千スウェーデンクローナ 7,454
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 2,109	千ノルウェークローネ 5,891
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 2,070	千デンマーククローネ 6,479
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 2,929	千ポーランドズロチ 3,191
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 2,651	千オーストラリアドル 1,561
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 3,885	千ニュージーランドドル -
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,076	千シンガポールドル 1,327
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 3,462	千マレーシアリンギット 3,238
	中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 274,817	千オフショア人民元 14,736
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 1,412	千イスラエルシェケル 3,978

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 16,248	百万円 17,166	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
為 替 先 物 取 引	百万円 31,706	百万円 31,706	100.0	百万円 32,631	百万円 32,631	100.0
為 替 直 物 取 引	10,172	10,117	99.5	7,660	7,579	98.9
金 銭 信 託	0.066643	0.066643	100.0	0.066643	0.066643	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	434,046	34,427	7.9	434,591	34,250	7.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

〈外国(外貨建)公社債〉 (A)債券種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	624,860	558,113	73,994,656	49.0	—	21.7	17.7	9.6
カ ナ ダ	千カナダドル 33,840	千カナダドル 31,361	3,095,074	2.0	—	1.1	0.6	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 186,730	千メキシコペソ 179,431	1,241,668	0.8	—	0.4	0.2	0.2
ド イ ツ	千ユーロ 72,470	千ユーロ 68,456	9,739,278	6.4	—	3.5	2.0	0.9
イ タ リ ア	84,810	79,078	11,250,475	7.5	—	4.2	2.2	1.1
フ ラ ン ス	96,210	89,190	12,689,179	8.4	—	5.1	2.5	0.8
オ ラ ン ダ	17,280	15,948	2,269,022	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ス ペ イ ン	55,400	52,485	7,467,146	4.9	—	2.9	1.5	0.6
ペ ル ギ ー	20,990	19,535	2,779,255	1.8	—	1.3	0.4	0.1
オーストリア	13,950	12,536	1,783,550	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フィンランド	6,150	5,325	757,663	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	7,570	6,751	960,572	0.6	—	0.4	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 51,870	千イギリスポンド 45,756	7,300,938	4.8	—	3.4	0.9	0.5
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 24,170	千スウェーデンクローナ 23,659	295,743	0.2	—	0.1	0.1	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 24,170	千ノルウェークローネ 22,876	293,505	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 26,930	千デンマーククローネ 25,783	492,974	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 25,670	千ポーランドズロチ 22,479	674,227	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 28,540	千オーストラリアドル 26,427	2,415,251	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニューゼーランドドル 4,400	千ニューゼーランドドル 3,971	332,451	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 7,100	千シンガポールドル 6,898	689,334	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,600	千マレーシアリンギット 27,382	842,433	0.6	—	0.3	0.2	0.0
中国オフショア	千オフショア人民元 330,690	千オフショア人民元 332,736	6,490,923	4.3	—	2.0	1.8	0.5
イスラエル	千イスラエルシケル 13,820	千イスラエルシケル 13,524	516,250	0.3	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	148,371,579	98.3	—	50.5	32.2	15.5

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

当		期 末				当		期 末			
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円		
(アメリカ)											
国債証券											
T 0.25% 03/15/24	0.25	4,500	4,279	567,408	2024/3/15	T 1.5% 02/15/30	1.5	1,820	1,578	209,295	2030/2/15
T 0.25% 05/15/24	0.25	5,070	4,784	634,344	2024/5/15	T 1.5% 08/15/26	1.5	5,300	4,863	644,758	2026/8/15
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,180	1,075	142,584	2025/5/31	T 1.5% 09/30/24	1.5	3,000	2,851	378,008	2024/9/30
T 0.25% 06/15/24	0.25	10,610	9,979	1,323,097	2024/6/15	T 1.5% 11/30/28	1.5	5,550	4,888	648,153	2028/11/30
T 0.25% 06/30/25	0.25	4,310	3,922	520,014	2025/6/30	T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	5,343	708,435	2026/2/15
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	1,995	264,525	2025/7/31	T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	4,998	662,684	2026/5/15
T 0.25% 09/30/25	0.25	3,290	2,971	393,915	2025/9/30	T 1.625% 05/15/31	1.625	4,690	4,032	534,602	2031/5/15
T 0.375% 01/31/26	0.375	1,700	1,522	201,905	2026/1/31	T 1.625% 08/15/29	1.625	2,260	1,990	263,932	2029/8/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,331	972,059	2025/4/30	T 1.625% 09/30/26	1.625	2,150	1,978	262,354	2026/9/30
T 0.375% 07/31/27	0.375	4,000	3,428	454,583	2027/7/31	T 1.625% 11/15/50	1.625	5,400	3,463	459,175	2050/11/15
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,500	5,150	682,903	2024/8/15	T 1.625% 11/30/26	1.625	3,030	2,781	368,795	2026/11/30
T 0.375% 09/15/24	0.375	4,600	4,296	569,678	2024/9/15	T 1.75% 01/31/29	1.75	2,500	2,229	295,560	2029/1/31
T 0.375% 09/30/27	0.375	4,000	3,413	452,512	2027/9/30	T 1.75% 06/30/24	1.75	2,000	1,917	254,284	2024/6/30
T 0.375% 08/15/25	0.375	3,770	3,394	450,097	2025/11/30	T 1.75% 08/15/41	1.75	4,800	3,460	458,805	2041/8/15
T 0.5% 02/28/26	0.5	3,500	3,139	416,195	2026/2/28	T 1.75% 11/15/29	1.75	3,220	2,853	378,313	2029/11/15
T 0.5% 03/31/25	0.5	4,000	3,687	488,950	2025/3/31	T 1.75% 12/31/26	1.75	4,300	3,963	525,444	2026/12/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,000	1,737	230,347	2027/4/30	T 1.875% 02/15/32	1.875	6,200	5,372	712,310	2032/2/15
T 0.5% 05/31/27	0.5	5,500	4,762	631,461	2027/5/31	T 1.875% 02/15/41	1.875	4,750	3,536	468,872	2041/2/15
T 0.5% 06/30/27	0.5	2,500	2,160	286,406	2027/6/30	T 1.875% 02/15/51	1.875	4,500	3,070	407,139	2051/2/15
T 0.5% 08/31/27	0.5	1,100	946	125,449	2027/8/31	T 1.875% 02/28/27	1.875	3,000	2,768	366,992	2027/2/28
T 0.5% 10/31/27	0.5	1,580	1,352	179,315	2027/10/31	T 1.875% 02/28/29	1.875	1,900	1,705	226,180	2029/2/28
T 0.625% 03/31/27	0.625	3,400	2,976	394,689	2027/3/31	T 1.875% 06/30/26	1.875	3,980	3,712	492,143	2026/6/30
T 0.625% 05/15/30	0.625	7,400	5,976	792,346	2030/5/15	T 1.875% 07/31/26	1.875	1,800	1,675	222,162	2026/7/31
T 0.625% 07/31/26	0.625	4,000	3,562	472,274	2026/7/31	T 1.875% 11/15/51	1.875	3,400	2,309	306,137	2051/11/15
T 0.625% 08/15/30	0.625	9,130	7,336	972,619	2030/8/15	T 2% 02/15/25	2.0	6,050	5,763	764,165	2025/2/15
T 0.625% 10/15/24	0.625	3,250	3,040	403,146	2024/10/15	T 2% 02/15/50	2.0	3,370	2,387	316,578	2050/2/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	3,700	3,180	421,697	2027/11/30	T 2% 04/30/24	2.0	3,000	2,897	384,207	2024/4/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	3,000	2,573	341,186	2027/12/31	T 2% 05/31/24	2.0	1,500	1,445	191,699	2024/5/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	3,500	3,013	399,573	2028/1/31	T 2% 06/30/24	2.0	1,000	962	127,546	2024/6/30
T 0.75% 03/31/26	0.75	2,750	2,483	329,246	2026/3/31	T 2% 08/15/25	2.0	3,750	3,547	470,354	2025/8/15
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,500	3,150	417,735	2026/4/30	T 2% 08/15/51	2.0	6,940	4,870	645,691	2051/8/15
T 0.75% 08/31/26	0.75	3,000	2,677	354,951	2026/8/31	T 2% 11/15/26	2.0	2,700	2,513	333,188	2026/11/15
T 0.75% 11/15/24	0.75	5,230	4,890	648,322	2024/11/15	T 2% 11/15/41	2.0	4,100	3,112	412,711	2041/11/15
T 0.875% 09/30/26	0.875	5,000	4,473	593,075	2026/9/30	T 2.125% 02/29/24	2.125	5,450	5,294	701,936	2024/2/29
T 0.875% 11/15/30	0.875	6,160	5,026	666,465	2030/11/15	T 2.125% 03/31/24	2.125	1,200	1,163	154,270	2024/3/31
T 1% 07/31/28	1.0	2,000	1,723	228,534	2028/7/31	T 2.125% 05/15/25	2.125	3,850	3,665	485,968	2025/5/15
T 1% 12/15/24	1.0	3,070	2,878	381,565	2024/12/15	T 2.125% 07/31/24	2.125	1,500	1,444	191,451	2024/7/31
T 1.125% 01/15/25	1.125	5,830	5,467	724,874	2025/1/15	T 2.125% 09/30/24	2.125	2,200	2,112	280,065	2024/9/30
T 1.125% 02/15/31	1.125	5,600	4,659	617,710	2031/2/15	T 2.125% 11/30/24	2.125	1,400	1,340	177,766	2024/11/30
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,550	1,024	135,777	2040/5/15	T 2.25% 01/31/24	2.25	2,500	2,437	323,114	2024/1/31
T 1.125% 08/15/40	1.125	4,000	2,626	348,188	2040/8/15	T 2.25% 02/15/27	2.25	3,900	3,658	485,028	2027/2/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	4,000	3,464	459,306	2028/8/31	T 2.25% 02/15/52	2.25	2,410	1,792	237,678	2052/2/15
T 1.125% 10/31/26	1.125	7,850	7,075	938,100	2026/10/31	T 2.25% 03/31/24	2.25	7,300	7,088	939,744	2024/3/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,300	4,664	618,462	2028/3/31	T 2.25% 03/31/26	2.25	1,500	1,419	188,254	2026/3/31
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,120	2,982	395,406	2050/5/15	T 2.25% 04/30/24	2.25	2,600	2,519	333,976	2024/4/30
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,263	697,785	2028/5/31	T 2.25% 05/15/41	2.25	1,600	1,264	167,651	2041/5/15
T 1.25% 06/30/28	1.25	1,000	876	116,147	2028/6/30	T 2.25% 08/15/27	2.25	2,320	2,164	286,907	2027/8/15
T 1.25% 08/15/31	1.25	6,550	5,430	720,024	2031/8/15	T 2.25% 08/15/46	2.25	2,180	1,650	218,789	2046/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	3,800	3,309	438,821	2028/9/30	T 2.25% 08/15/49	2.25	4,110	3,091	409,827	2049/8/15
T 1.25% 11/30/26	1.25	3,000	2,712	359,628	2026/11/30	T 2.25% 10/31/24	2.25	2,500	2,401	318,386	2024/10/31
T 1.25% 12/31/26	1.25	5,500	4,965	658,350	2026/12/31	T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	4,802	636,746	2024/11/15
T 1.375% 08/15/50	1.375	2,300	1,381	183,210	2050/8/15	T 2.25% 11/15/25	2.25	5,500	5,225	692,758	2025/11/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	1,700	1,488	197,380	2028/10/31	T 2.25% 11/15/27	2.25	5,260	4,892	648,663	2027/11/15
T 1.375% 11/15/31	1.375	12,110	10,083	1,336,866	2031/11/15	T 2.25% 12/31/24	2.25	2,900	2,780	368,637	2024/12/31
T 1.375% 11/15/40	1.375	4,650	3,184	422,192	2040/11/15	T 2.375% 02/15/42	2.375	1,350	1,081	143,361	2042/2/15
						T 2.375% 02/29/24	2.375	4,280	4,170	552,930	2024/2/29

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額				千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	千円			%	千米ドル	千米ドル	千円	千円	
T 2.375% 03/31/29	2.375	1,400	1,291	171,292	2029/3/31	T 3.5% 02/15/39	3.5	900	882	116,937	2039/2/15		
T 2.375% 04/30/26	2.375	1,820	1,728	229,117	2026/4/30	T 3.625% 02/15/44	3.625	1,600	1,548	205,324	2044/2/15		
T 2.375% 05/15/27	2.375	3,600	3,382	448,464	2027/5/15	T 3.625% 08/15/43	3.625	1,600	1,552	205,847	2043/8/15		
T 2.375% 05/15/29	2.375	3,890	3,586	475,524	2029/5/15	T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,097	145,490	2041/8/15		
T 2.375% 05/15/51	2.375	1,980	1,518	201,259	2051/5/15	T 3.75% 11/15/43	3.75	900	888	117,774	2043/11/15		
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,460	5,270	698,776	2024/8/15	T 3.875% 08/15/40	3.875	680	693	91,990	2040/8/15		
T 2.375% 11/15/49	2.375	2,010	1,552	205,829	2049/11/15	T 3.875% 09/30/29	3.875	1,050	1,056	140,032	2029/9/30		
T 2.5% 01/31/25	2.5	4,000	3,850	510,557	2025/1/31	T 4% 11/15/52	4.0	1,000	1,059	140,493	2052/11/15		
T 2.5% 02/15/45	2.5	2,150	1,717	227,725	2045/2/15	T 4% 12/15/25	4.0	5,000	4,980	660,362	2025/12/15		
T 2.5% 02/15/46	2.5	2,250	1,792	237,711	2046/2/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	850	911	120,858	2039/5/15		
T 2.5% 02/28/26	2.5	650	619	82,189	2026/2/28	T 4.25% 11/15/40	4.25	900	962	127,618	2040/11/15		
T 2.5% 05/15/24	2.5	3,700	3,592	476,308	2024/5/15	T 4.375% 02/15/38	4.375	500	543	71,997	2038/2/15		
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,810	1,441	191,104	2046/5/15	T 4.375% 05/15/40	4.375	750	814	107,945	2040/5/15		
T 2.625% 01/31/26	2.625	1,350	1,294	171,606	2026/1/31	T 4.375% 05/15/41	4.375	550	597	79,253	2041/5/15		
T 2.625% 02/15/29	2.625	6,900	6,465	857,198	2029/2/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	650	706	93,668	2039/11/15		
T 2.625% 03/31/25	2.625	2,500	2,411	319,667	2025/3/31	T 4.5% 02/15/36	4.5	600	660	87,574	2036/2/15		
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,900	3,817	506,119	2024/2/15	T 4.5% 05/15/38	4.5	970	1,067	141,523	2038/5/15		
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,670	4,435	588,094	2028/2/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	750	828	109,782	2039/8/15		
T 2.75% 05/31/29	2.75	6,000	5,653	749,491	2029/5/31	T 4.5% 11/15/25	4.5	4,350	4,383	581,206	2025/11/15		
T 2.75% 06/30/25	2.75	2,000	1,930	255,900	2025/6/30	T 4.625% 02/15/40	4.625	700	784	104,047	2040/2/15		
T 2.75% 08/15/32	2.75	2,280	2,120	281,075	2032/8/15	T 4.75% 02/15/41	4.75	750	853	113,146	2041/2/15		
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,330	1,978	262,357	2042/8/15	T 5.0% 05/15/37	5.0	650	750	99,559	2037/5/15		
T 2.75% 08/15/47	2.75	1,150	958	127,137	2047/8/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	900	966	128,196	2028/11/15		
T 2.75% 08/31/25	2.75	5,000	4,818	638,792	2025/8/31	T 5.375% 02/15/31	5.375	750	836	110,932	2031/2/15		
T 2.75% 11/15/42	2.75	1,650	1,398	185,422	2042/11/15	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	631	83,764	2026/2/15		
T 2.75% 11/15/47	2.75	1,400	1,167	154,804	2047/11/15	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,050	1,152	152,765	2027/11/15		
T 2.875% 04/30/25	2.875	10,770	10,429	1,382,707	2025/4/30	T 6.25% 05/15/30	6.25	720	834	110,659	2030/5/15		
T 2.875% 05/15/28	2.875	4,460	4,253	563,935	2028/5/15								
T 2.875% 05/15/32	2.875	4,500	4,234	561,372	2032/5/15	小 計					73,994,656		
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,050	906	120,171	2043/5/15	(カナダ)	千カナダドル	千カナダドル					
T 2.875% 05/15/49	2.875	4,400	3,773	500,224	2049/5/15	国債証券							
T 2.875% 05/15/52	2.875	3,000	2,561	339,539	2052/5/15	CAN 0.25% 03/01/26	0.25	890	807	79,695	2026/3/1		
T 2.875% 07/31/25	2.875	500	483	64,151	2025/7/31	CAN 0.25% 04/01/24	0.25	990	944	93,244	2024/4/1		
T 2.875% 08/15/28	2.875	10,200	9,719	1,288,609	2028/8/15	CAN 0.5% 09/01/25	0.5	1,590	1,468	144,914	2025/9/1		
T 2.875% 08/15/45	2.875	1,480	1,263	167,490	2045/8/15	CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,320	1,918	189,291	2030/12/1		
T 3% 02/15/47	3.0	2,400	2,094	277,746	2047/2/15	CAN 0.75% 02/01/24	0.75	430	414	40,909	2024/2/1		
T 3% 02/15/48	3.0	3,100	2,709	359,270	2048/2/15	CAN 0.75% 10/01/24	0.75	300	284	28,057	2024/10/1		
T 3% 02/15/49	3.0	1,940	1,703	225,808	2049/2/15	CAN 1% 06/01/27	1.0	880	806	79,561	2027/6/1		
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	975	129,283	2042/5/15	CAN 1% 09/01/26	1.0	1,220	1,125	111,108	2026/9/1		
T 3% 05/15/45	3.0	600	523	69,396	2045/5/15	CAN 1.25% 03/01/25	1.25	500	474	46,841	2025/3/1		
T 3% 05/15/47	3.0	1,300	1,134	150,459	2047/5/15	CAN 1.25% 03/01/27	1.25	640	592	58,460	2027/3/1		
T 3% 08/15/48	3.0	3,060	2,678	355,173	2048/8/15	CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,940	1,718	169,584	2030/6/1		
T 3% 08/15/52	3.0	2,570	2,251	298,485	2052/8/15	CAN 1.5% 04/01/25	1.5	1,210	1,152	113,766	2025/4/1		
T 3% 09/30/25	3.0	3,660	3,547	470,344	2025/9/30	CAN 1.5% 05/01/24	1.5	1,850	1,787	176,396	2024/5/1		
T 3% 10/31/25	3.0	1,000	969	128,478	2025/10/31	CAN 1.5% 06/01/26	1.5	740	698	68,930	2026/6/1		
T 3% 11/15/44	3.0	1,550	1,353	179,474	2044/11/15	CAN 1.5% 06/01/31	1.5	2,010	1,787	176,396	2031/6/1		
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,000	906	120,119	2042/2/15	CAN 1.5% 09/01/24	1.5	660	634	62,575	2024/9/1		
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,100	999	131,180	2043/2/15	CAN 1.5% 12/01/31	1.5	1,230	1,085	107,166	2031/12/1		
T 3.125% 05/15/48	3.125	1,400	1,253	166,122	2048/5/15	CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,400	1,032	101,913	2053/12/1		
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,550	1,384	183,552	2044/8/15	CAN 2% 06/01/28	2.0	500	475	46,882	2028/6/1		
T 3.125% 08/31/29	3.125	4,300	4,139	548,760	2029/8/31	CAN 2% 06/01/32	2.0	1,190	1,091	107,704	2032/6/1		
T 3.125% 11/15/28	3.125	3,960	3,819	506,395	2028/11/15	CAN 2% 12/01/51	2.0	2,510	1,989	196,331	2051/12/1		
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	791	104,873	2041/11/15	CAN 2.25% 03/01/24	2.25	670	654	64,640	2024/3/1		
T 3.25% 05/15/42	3.25	1,500	1,378	182,805	2042/5/15	CAN 2.25% 06/01/25	2.25	670	649	64,087	2025/6/1		
T 3.25% 06/30/27	3.25	4,850	4,721	626,033	2027/6/30	CAN 2.25% 06/01/29	2.25	390	373	36,829	2029/6/1		
T 3.375% 05/15/44	3.375	1,200	1,116	148,027	2044/5/15	CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,780	1,739	171,711	2024/6/1		
T 3.375% 11/15/48	3.375	1,000	937	124,355	2048/11/15	CAN 2.5% 12/01/32	2.5	740	706	69,736	2032/12/1		
						CAN 2.75% 08/01/24	2.75	280	274	27,054	2024/8/1		

当期						期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	710	697	68,835	2027/9/1	DBR 1.7% 08/15/32	1.7	1,310	1,249	177,727	2032/8/15
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	510	478	47,247	2048/12/1	DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,250	1,238	176,255	2024/2/15
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	350	323	31,904	2064/12/1	DBR 1.8% 08/15/53	1.8	90	80	11,488	2053/8/15
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	590	625	61,735	2045/12/1	DBR 2.3% 02/15/33	2.3	170	170	24,223	2033/2/15
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	490	549	54,184	2041/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,620	1,674	238,178	2044/7/4
CAN 5.0% 06/01/37	5.0	560	615	67,153	2037/6/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,770	1,843	262,254	2046/8/15
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	480	554	54,711	2029/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,160	1,324	188,374	2042/7/4
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	620	765	75,509	2033/6/1	DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,670	1,997	284,153	2037/1/4
小計				3,095,074		DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,090	1,373	195,368	2039/7/4
(メキシコ)		千メキシコ	千メキシコ			DBR 4.75% 07/04/28	4.75	700	789	112,282	2028/7/4
国債証券		コペソ	コペソ			DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,240	1,544	219,752	2034/7/4
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	7,162	49,561	2036/11/20	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,220	1,635	232,645	2040/7/4
MBONO 10% 12/05/24	10.0	20,780	20,880	144,493	2024/12/5	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,640	2,024	287,999	2031/1/4
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	4,240	3,751	25,961	2027/3/4	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	1,732	246,427	2028/1/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	23,680	21,525	148,955	2026/3/5	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	765	108,938	2030/1/4
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	1,960	1,833	12,688	2033/5/26	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,270	1,491	212,199	2027/7/4
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	21,620	20,670	143,036	2027/6/3	DBR 0% 04/05/24	-	1,880	1,824	259,570	2024/4/5
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	17,390	16,611	114,951	2031/5/29	DBR 0% 04/10/26	-	1,500	1,393	198,262	2026/4/10
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	13,980	12,715	87,990	2042/11/13	DBR 0% 04/11/25	-	1,420	1,345	191,353	2025/4/11
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,970	4,696	32,497	2034/11/23	DBR 0% 04/16/27	-	1,510	1,372	195,244	2027/4/16
MBONO 8% 07/31/53	8.0	4,410	4,104	28,402	2053/7/31	DBR 0% 10/09/26	-	630	578	82,343	2026/10/9
MBONO 8% 09/05/24	8.0	18,530	17,940	124,151	2024/9/5	DBR 0% 10/10/25	-	1,970	1,847	262,893	2025/10/10
MBONO 8% 11/07/47	8.0	14,310	13,298	92,028	2047/11/7	DBR 0% 10/18/24	-	1,390	1,330	189,351	2024/10/18
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	20,740	20,723	143,407	2029/5/31	DBL 1.3% 10/15/27	1.3	2,620	2,506	356,555	2027/10/15
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	13,720	13,517	93,541	2038/11/18	DBL 2.2% 04/13/28	2.2	700	696	99,138	2028/4/13
小計				1,241,668		(イタリア)					
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ			国債証券					
BKO 0% 03/15/24	-	620	602	85,739	2023/3/15	BTPS 0% 04/01/26	-	2,700	2,438	346,994	2026/4/1
BKO 0.2% 06/14/24	0.2	1,850	1,790	254,706	2024/6/14	BTPS 0% 04/15/24	-	480	463	65,898	2024/4/15
BKO 0.4% 09/13/24	0.4	330	318	45,329	2024/9/13	BTPS 0% 08/01/26	-	1,330	1,188	169,142	2026/8/1
DBR 0% 02/15/30	-	1,660	1,424	202,646	2030/2/15	BTPS 0% 08/15/24	-	1,610	1,538	218,864	2024/8/15
DBR 0% 02/15/31	-	1,240	1,040	148,097	2031/2/15	BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,250	1,065	151,540	2028/3/15
DBR 0% 02/15/32	-	2,080	1,705	242,609	2032/2/15	BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	2,350	2,229	317,237	2025/2/1
DBR 0% 05/15/35	-	1,280	964	137,174	2035/5/15	BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	1,710	1,423	202,491	2029/2/15
DBR 0% 05/15/36	-	1,320	969	137,915	2036/5/15	BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	500	461	65,686	2026/2/1
DBR 0% 08/15/26	-	1,620	1,494	212,658	2026/8/15	BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	730	623	88,711	2028/7/15
DBR 0% 08/15/29	-	2,430	2,106	299,641	2029/8/15	BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,500	1,154	164,200	2031/8/1
DBR 0% 08/15/30	-	1,480	1,257	178,896	2030/8/15	BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	1,600	1,458	207,450	2031/1/15
DBR 0% 08/15/30	-	400	340	48,445	2030/8/15	BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	1,300	1,039	147,944	2031/4/1
DBR 0% 08/15/31	-	2,310	1,917	272,828	2031/8/15	BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	600	399	56,845	2037/3/1
DBR 0% 08/15/50	-	2,740	1,505	214,183	2050/8/15	BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	880	680	96,747	2032/6/1
DBR 0% 08/15/52	-	1,140	601	85,516	2052/8/15	BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	1,330	1,090	155,075	2030/8/1
DBR 0% 11/15/27	-	1,230	1,105	157,296	2027/11/15	BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,000	899	127,972	2027/9/15
DBR 0% 11/15/28	-	830	730	103,997	2028/11/15	BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	1,120	879	125,070	2031/12/1
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	230	212	30,201	2027/2/15	BTPS 1.2% 08/15/25	1.2	540	514	73,237	2025/8/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,750	1,557	221,610	2029/2/15	BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,170	1,087	154,653	2026/12/1
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	1,300	1,167	166,103	2028/8/15	BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	750	641	91,258	2030/4/1
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	2,090	2,007	285,618	2025/2/15	BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	830	607	86,437	2036/3/1
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	2,300	2,176	309,639	2026/2/15	BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	1,070	1,034	147,108	2025/5/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,510	1,386	197,212	2028/2/15	BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	1,520	1,479	210,497	2024/11/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	940	869	123,741	2027/8/15	BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	650	398	56,727	2045/4/30
DBR 1% 05/15/38	1.0	220	182	25,901	2038/5/15	BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,500	1,448	206,076	2025/6/1
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,610	1,572	223,761	2024/8/15	BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,281	182,317	2026/6/1
DBR 1% 08/15/25	1.0	1,130	1,089	155,059	2025/8/15	BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	1,300	1,083	154,159	2032/3/1
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	1,880	1,522	216,633	2048/8/15	BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	1,450	1,243	176,965	2030/12/1
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	1,020	1,006	143,128	2024/5/15	BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	750	449	63,974	2051/9/1
						BTPS 1.75% 05/30/24	1.75	280	275	39,141	2024/5/30

当 期 末						当 期 末											
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日				
		千ユーロ	千ユーロ	千円	千円				千ユーロ	千ユーロ	千円	千円					
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,840	1,807	257,159	2024/7/1	FRTR 0% 11/25/31	-	3,190	2,534	360,610	2031/11/25						
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	890	619	88,122	2041/3/1	FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	1,590	1,459	207,700	2026/11/25						
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	750	739	105,168	2024/5/15	FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,160	3,010	428,303	2025/5/25						
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	820	796	113,290	2025/7/1	FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	2,930	2,741	390,027	2026/5/25						
BTPS 2% 02/01/28	2.0	930	871	124,000	2028/2/1	FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	2,830	2,495	355,074	2029/5/25						
BTPS 2% 12/01/25	2.0	1,050	1,017	144,795	2025/12/1	FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	1,260	832	118,463	2040/5/25						
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,040	985	140,202	2027/8/1	FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	460	184	26,220	2072/5/25						
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	240	146	20,816	2072/3/1	FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	790	479	68,265	2044/6/25						
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	510	334	47,519	2052/9/1	FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	1,430	1,308	186,118	2028/2/25						
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,110	1,061	151,082	2027/6/1	FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	2,960	2,697	383,742	2028/5/25						
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,190	957	136,269	2036/9/1	FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,930	1,090	155,111	2052/5/25						
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	1,360	1,170	166,514	2033/9/1	FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	1,350	744	105,906	2053/5/25						
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	970	697	99,163	2050/9/1	FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	3,190	2,883	410,214	2028/11/25						
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	660	649	92,344	2025/11/15	FRTR 1% 05/25/27	1.0	2,180	2,045	290,959	2027/5/25						
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	1,300	1,289	183,452	2024/12/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	1,340	1,283	182,611	2025/11/25						
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	960	846	120,363	2032/12/1	FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	2,030	1,716	244,169	2034/5/25						
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	770	744	105,871	2027/12/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,660	2,163	307,847	2036/5/25						
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	940	103,956	2047/3/1	2047/3/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	2,770	2,550	362,578	2031/5/25						
BTPS 2.8% 03/01/67	-2.8	500	360	51,239	2067/3/1	FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	1,960	1,404	199,753	2050/5/25						
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	700	667	94,944	2029/6/15	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	607	86,446	2066/5/25						
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,260	1,216	173,122	2028/12/1	FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	1,660	1,400	199,240	2039/6/25						
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	850	727	103,512	2038/9/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	2,020	1,986	282,688	2024/11/25						
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,210	1,171	166,681	2029/8/1	FRTR 2% 05/25/48	2.0	1,890	1,540	219,167	2048/5/25						
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	670	574	81,743	2040/3/1	FRTR 2% 11/25/32	2.0	1,360	1,274	181,328	2032/11/25						
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	980	838	119,274	2046/9/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	2,290	2,275	323,805	2024/5/25						
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,100	1,010	143,833	2035/3/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,900	2,889	411,134	2030/5/25						
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,040	918	130,672	2048/3/1	FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	250	228	32,473	2043/5/25						
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,950	1,935	275,405	2030/3/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	3,280	3,310	471,046	2027/10/25						
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	1,040	1,050	149,505	2024/9/1	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,800	1,852	263,598	2045/5/25						
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	840	784	111,636	2049/9/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,120	3,208	456,544	2026/4/25						
BTPS 4% 02/01/37	4.0	1,800	1,771	252,015	2037/2/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,070	1,266	180,229	2055/4/25						
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	250	256	36,429	2033/5/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,050	1,267	180,307	2060/4/25						
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	440	445	63,401	2043/9/1	FRTR 4% 10/25/38	4.0	1,600	1,789	254,565	2038/10/25						
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	1,130	1,146	163,102	2024/3/1	FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,340	2,800	398,441	2041/4/25						
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	930	964	137,152	2026/3/1	FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	1,590	1,883	267,951	2035/4/25						
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	1,810	1,927	274,167	2028/9/1	FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,500	2,915	414,752	2029/4/25						
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,130	1,199	170,615	2044/9/1	FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,150	2,702	384,550	2032/10/25						
BTPS 5% 03/01/25	5.0	1,290	1,339	190,610	2025/3/1	FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,450	1,577	224,396	2025/10/25						
BTPS 5% 08/01/34	5.0	1,260	1,354	192,650	2034/8/1	(オランダ) 国債証券 NETHER 0% 01/15/26 - 640 594 84,566 2026/1/15 NETHER 0% 01/15/27 - 750 681 96,965 2027/1/15 NETHER 0% 01/15/29 - 1,040 900 128,058 2029/1/15 NETHER 0% 01/15/38 - 530 360 51,263 2038/1/15 NETHER 0% 01/15/52 - 740 376 53,570 2052/1/15 NETHER 0% 07/15/30 - 850 710 101,050 2030/7/15 NETHER 0% 07/15/31 - 700 569 81,015 2031/7/15 NETHER 0.25% 07/15/25 0.25 760 719 102,342 2025/7/15 NETHER 0.25% 07/15/29 0.25 760 662 94,222 2029/7/15 NETHER 0.5% 01/15/40 0.5 910 655 93,295 2040/1/15 NETHER 0.5% 07/15/26 0.5 840 785 111,789 2026/7/15 NETHER 0.5% 07/15/32 0.5 720 598 85,096 2032/7/15 NETHER 0.75% 07/15/27 0.75 900 837 119,143 2027/7/15 NETHER 0.75% 07/15/28 0.75 1,090 997 141,946 2028/7/15 NETHER 2% 01/15/54 2.0 230 206 29,406 2054/1/15 NETHER 2% 07/15/24 2.0 1,110 1,100 156,516 2024/7/15 NETHER 2.5% 01/15/33 2.5 820 814 115,830 2033/1/15											
BTPS 5% 09/01/40	5.0	1,600	1,741	247,796	2040/9/1												
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,440	1,563	222,439	2039/8/1												
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	1,770	1,953	277,984	2029/11/1												
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	1,320	1,501	213,587	2033/2/1												
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,600	1,856	264,096	2031/5/1												
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,070	2,357	335,461	2027/11/1												
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	399	56,865	2026/11/1												
(フランス)																	
国債証券																	
FRTR 0% 02/25/24	-	1,850	1,798	255,846	2024/2/25							FRTR 0% 02/25/25	-	880	833	118,549	2025/2/25
FRTR 0% 02/25/26	-	2,220	2,052	292,067	2026/2/25							FRTR 0% 02/25/27	-	2,320	2,096	298,236	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/24	-	2,240	2,172	309,071	2024/3/25							FRTR 0% 03/25/25	-	3,280	3,099	440,908	2025/3/25
FRTR 0% 03/25/25	-	2,150	1,679	238,900	2032/5/25							FRTR 0% 11/25/29	-	2,760	2,325	330,854	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/29	-	2,760	2,325	330,854	2029/11/25							FRTR 0% 11/25/30	-	3,330	2,727	388,098	2030/11/25

当期						期末							
銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,160	1,212	172,539	2047/1/15	BCB 0% 10/22/31	-	730	575	81,876	2031/10/22		
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,010	1,184	168,573	2042/1/15	BCB 0.1% 06/22/30	0.1	660	549	78,204	2030/6/22		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,070	1,239	176,370	2037/1/15	BCB 0.35% 06/22/32	0.35	700	558	79,442	2032/6/22		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	650	741	105,459	2028/1/15	BCB 0.4% 06/22/40	0.4	400	254	36,141	2040/6/22		
(スペイン)						BCB 0.5% 10/22/24	0.5	490	473	67,315	2024/10/22		
国債証券						BCB 0.65% 06/22/71	0.65	340	149	21,202	2071/6/22		
SPGB 0% 01/31/25	-	1,040	985	140,148	2025/1/31	BCB 0.8% 06/22/25	0.8	1,100	1,055	150,196	2025/6/22		
SPGB 0% 01/31/26	-	1,070	984	140,100	2026/1/31	BCB 0.8% 06/22/27	0.8	750	696	99,139	2027/6/22		
SPGB 0% 01/31/27	-	1,080	966	137,564	2027/1/31	BCB 0.8% 06/22/28	0.8	810	740	105,353	2028/6/22		
SPGB 0% 01/31/28	-	1,080	938	133,547	2028/1/31	BCB 0.9% 06/22/29	0.9	1,100	992	141,250	2029/6/22		
SPGB 0% 05/31/24	-	1,480	1,427	203,111	2024/5/31	BCB 1% 06/22/26	1.0	1,080	1,027	146,198	2026/6/22		
SPGB 0% 05/31/25	-	570	534	76,012	2025/5/31	BCB 1% 06/22/31	1.0	910	794	112,994	2031/6/22		
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	1,570	1,237	176,073	2031/4/30	BCB 1.25% 04/22/33	1.25	550	473	67,352	2033/4/22		
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	1,000	964	137,165	2024/7/30	BCB 1.4% 06/22/53	1.4	520	343	48,880	2053/6/22		
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	1,780	1,499	213,361	2030/4/30	BCB 1.45% 06/22/37	1.45	400	325	46,266	2037/6/22		
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,180	948	134,903	2031/10/31	BCB 1.6% 06/22/47	1.6	640	471	67,013	2047/6/22		
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	970	834	118,715	2029/10/31	BCB 1.7% 06/22/50	1.7	710	520	74,076	2050/6/22		
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	810	652	92,885	2032/4/30	BCB 1.9% 06/22/38	1.9	510	435	61,977	2038/6/22		
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	1,190	1,090	155,137	2027/7/30	BCB 2.15% 06/22/66	2.15	450	358	50,973	2066/6/22		
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	230	200	28,567	2029/7/30	BCB 2.25% 06/22/57	2.25	380	313	44,564	2057/6/22		
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	640	446	63,510	2037/7/30	BCB 2.6% 06/22/24	2.6	1,000	998	142,057	2024/6/22		
SPGB 1% 07/30/42	1.0	340	218	31,119	2042/7/30	BCB 2.75% 04/22/39	2.75	70	66	9,474	2039/4/22		
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,040	572	81,465	2050/10/31	BCB 3% 06/22/33	3.0	300	302	42,980	2033/6/22		
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	950	655	93,229	2040/10/31	BCB 3% 06/22/34	3.0	350	350	49,914	2034/6/22		
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,200	1,056	150,316	2030/10/31	BCB 3.75% 06/22/45	3.75	520	567	80,674	2045/6/22		
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,460	1,386	197,259	2026/10/31	BCB 4% 03/28/32	4.0	620	678	96,489	2032/3/28		
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,920	1,785	253,976	2028/4/30	BCB 4.25% 03/28/41	4.25	1,110	1,274	181,355	2041/3/28		
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	780	722	102,829	2028/7/30	BCB 4.5% 03/28/26	4.5	750	794	113,024	2026/3/28		
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	750	689	98,038	2029/4/30	BCB 5% 03/28/35	5.0	1,270	1,526	217,144	2035/3/28		
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,330	1,250	177,897	2027/10/31	BCB 5.5% 03/28/28	5.5	1,170	1,334	189,911	2028/3/28		
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	260	129	18,373	2071/10/31	(オーストリア)							
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,460	1,386	197,286	2027/4/30	国債証券							
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,218	173,392	2025/4/30	RAGB 0% 02/20/30	-	660	545	77,648	2030/2/20		
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,290	1,090	155,130	2035/7/30	RAGB 0% 02/20/31	-	720	577	82,114	2031/2/20		
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	650	440	62,679	2052/10/31	RAGB 0% 04/20/25	-	370	349	49,697	2025/4/20		
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,340	1,306	185,905	2026/4/30	RAGB 0% 07/15/24	-	660	635	90,464	2024/7/15		
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,520	1,416	201,464	2030/7/30	RAGB 0% 10/20/40	-	330	196	27,924	2040/10/20		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,760	1,733	246,683	2025/10/31	RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	360	251	35,850	2036/10/20		
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	990	911	129,648	2033/7/30	RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	810	712	101,367	2029/2/20		
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	960	907	129,080	2032/10/31	RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	650	596	84,909	2027/4/20		
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,020	867	123,445	2048/10/31	RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	200	94	13,508	2071/4/20		
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	1,560	1,560	222,035	2024/10/31	RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	830	757	107,776	2028/2/20		
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,120	1,003	142,813	2046/10/31	RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	410	245	34,980	2051/3/20		
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	300	291	41,433	2043/7/30	RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	900	842	119,884	2026/10/20		
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	900	845	120,245	2066/7/30	RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	200	87	12,447	2120/6/30		
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	1,350	1,365	194,306	2024/4/30	RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	800	677	96,452	2032/2/20		
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,310	1,416	201,532	2037/1/31	RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	830	801	114,039	2025/10/20		
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,410	1,472	209,531	2025/7/30	RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	490	371	52,909	2047/2/20		
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,300	1,501	213,557	2041/7/30	RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	200	127	18,108	2086/11/2		
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,080	1,273	181,172	2040/7/30	RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	560	550	78,371	2044/10/21		
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	1,100	1,228	174,805	2028/10/31	RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	220	178	25,424	2049/5/23		
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	850	1,052	149,752	2044/10/31	RAGB 2% 07/15/26	2.0	260	255	36,285	2026/7/15		
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,450	1,764	251,034	2032/7/30	RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	360	278	39,656	2117/9/20		
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,360	1,500	213,411	2026/7/30	RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	530	504	71,768	2034/5/23		
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,350	2,751	391,487	2029/1/31	RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	420	434	61,793	2044/6/20		
(ベルギー)						RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	180	216	30,784	2062/1/26		
国債証券						RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	920	1,045	148,724	2037/3/15		
BGB 0% 10/22/27	-	600	532	75,805	2027/10/22								

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	千イギリスポンド	千イギリスポンド	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	540	577	82,142	2026/3/15	UKT 0.625% 07/31/35	0.625	1,390	988	157,657	2035/7/31		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	540	622	88,514	2027/7/15	UKT 0.625% 10/22/50	0.625	640	302	48,316	2050/10/22		
(フィンランド)						UKT 0.875% 01/31/46	0.875	400	223	35,728	2046/1/31		
国債証券						UKT 0.875% 07/31/33	0.875	830	648	103,477	2033/7/31		
RFGB 0% 09/15/24	—	360	345	49,185	2024/9/15	UKT 0.875% 10/22/29	0.875	820	709	113,169	2029/10/22		
RFGB 0% 09/15/30	—	330	268	38,260	2030/9/15	UKT 1% 01/31/32	1.0	1,680	1,382	220,614	2032/1/31		
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	270	188	26,751	2036/4/15	UKT 1% 04/22/24	1.0	1,450	1,409	224,834	2024/4/22		
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	240	116	16,637	2052/4/15	UKT 1.125% 01/31/39	1.125	1,320	912	145,609	2039/1/31		
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	370	296	42,138	2031/9/15	UKT 1.125% 10/22/73	1.125	480	219	34,994	2073/10/22		
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	210	133	18,956	2040/9/15	UKT 1.25% 07/22/27	1.25	740	683	109,022	2027/7/22		
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	600	564	80,317	2026/4/15	UKT 1.25% 07/31/51	1.25	890	508	81,146	2051/7/31		
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	180	115	16,380	2043/4/15	UKT 1.25% 10/22/41	1.25	1,440	961	153,465	2041/10/22		
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	380	346	49,296	2027/9/15	UKT 1.5% 07/22/26	1.5	930	881	140,674	2026/7/22		
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	290	257	36,680	2028/9/15	UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,010	646	103,210	2047/7/22		
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	290	252	35,905	2029/9/15	UKT 1.5% 07/31/53	1.5	260	156	24,954	2053/7/31		
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	270	230	32,838	2031/4/15	UKT 1.625% 10/22/28	1.625	480	443	70,718	2028/10/22		
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	410	393	55,975	2025/9/15	UKT 1.625% 10/22/54	1.625	720	445	71,133	2054/10/22		
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	270	224	31,966	2034/4/15	UKT 1.625% 10/22/71	1.625	710	408	65,106	2071/10/22		
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	270	204	29,151	2047/4/15	UKT 1.75% 01/22/49	1.75	600	403	64,330	2049/1/22		
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	220	195	27,868	2032/9/15	UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,050	668	106,595	2057/7/22		
RFGB 2% 04/15/24	2.0	110	109	15,546	2024/4/15	UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,110	875	139,730	2037/9/7		
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	380	366	52,116	2042/7/4	UKT 2% 09/07/25	2.0	1,090	1,060	169,175	2025/9/7		
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	380	383	54,497	2028/7/4	UKT 2.5% 07/22/65	2.5	860	664	105,954	2065/7/22		
RFGB 4% 07/04/25	4.0	320	331	47,191	2025/7/4	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	980	970	154,836	2024/9/7		
(アイルランド)						UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,240	1,147	183,086	2044/1/22		
国債証券						UKT 3.25% 01/31/33	3.25	200	198	31,665	2033/1/31		
IRISH 0% 10/18/31	—	440	349	49,760	2031/10/18	UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,230	1,179	188,190	2045/1/22		
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	410	372	52,953	2027/5/15	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	920	908	144,960	2068/7/22		
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	470	391	55,736	2030/10/18	UKT 3.75% 01/29/38	3.75	370	373	59,588	2038/1/29		
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	170	136	19,384	2032/10/18	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	900	904	144,337	2052/7/22		
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	280	208	29,644	2035/5/15	UKT 3.75% 10/22/53	3.75	400	401	64,002	2053/10/22		
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	220	143	20,471	2041/4/22	UKT 4% 01/22/60	4.0	670	725	115,696	2060/1/22		
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	440	405	57,648	2028/5/15	UKT 4.125% 01/29/27	4.125	540	555	88,636	2029/1/29		
IRISH 1% 05/15/26	1.0	670	640	91,073	2026/5/15	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	790	849	135,604	2036/3/7		
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	550	503	71,617	2029/5/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,070	1,157	184,681	2032/6/7		
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	310	269	38,313	2033/5/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	670	714	114,001	2039/9/7		
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	240	218	31,049	2031/3/18	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,100	1,154	184,211	2027/12/7		
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	430	309	44,068	2050/5/15	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	790	842	134,409	2040/12/7		
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	440	374	53,342	2037/5/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,060	1,136	181,339	2046/12/7		
IRISH 2% 02/18/45	2.0	620	514	73,213	2045/2/18	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	810	875	139,633	2049/12/7		
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	660	652	92,826	2030/5/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,100	1,216	194,145	2055/12/7		
IRISH 3% 10/18/43	3.0	170	169	24,159	2043/10/18	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	730	806	128,717	2034/9/7		
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	380	383	54,522	2024/3/18	UKT 4.5% 12/07/42	4.5	770	850	135,756	2042/12/7		
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	670	708	100,786	2025/3/13	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	850	943	150,487	2030/12/7		
小 計				49,696,144		UKT 4.75% 12/07/38	4.75	810	916	146,212	2038/12/7		
(イギリス)						UKT 5% 03/07/25	5.0	600	622	99,248	2025/3/7		
国債証券						UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,070	1,227	195,852	2028/12/7		
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	780	715	114,226	2026/1/30	小 計				7,300,938			
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	980	948	151,344	2024/1/31	(スウェーデン)							
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	880	758	121,103	2028/1/31	国債証券							
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,540	1,446	230,821	2025/1/31	SwB 0.125% 05/12/31	0.125	3,010	2,588	32,350	2031/5/12		
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	1,890	1,472	235,012	2031/7/31	SwB 0.75% 05/12/28	0.75	3,240	3,029	37,873	2028/5/12		
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,170	1,056	168,619	2026/10/22	SwB 0.75% 11/12/29	0.75	3,840	3,539	44,245	2029/11/12		
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,090	882	140,785	2030/10/22	SwB 1% 11/12/26	1.0	4,650	4,456	55,711	2026/11/12		
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	880	750	119,803	2029/1/31	SwB 2.25% 06/01/32	2.25	2,560	2,627	32,843	2032/6/1		
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	930	347	55,397	2061/10/22	SwB 2.5% 05/12/25	2.5	4,430	4,435	55,449	2025/5/12		
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,160	1,096	174,900	2025/6/7	SwB 3.5% 03/30/39	3.5	2,440	2,981	37,269	2039/3/30		
小 計						小 計				295,743			

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)											
国債証券	%	千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ	千円			%	千オースト リアドル	千オースト リアドル	千円	
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	2,180	1,903	24,427	2031/9/17	ACGB 3% 03/21/47	3.0	780	670	61,257	2047/3/21
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	3,280	2,943	37,765	2030/8/19	ACGB 3% 11/21/33	3.0	950	908	82,991	2033/11/21
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	3,110	2,986	38,313	2026/2/19	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	1,250	1,254	114,677	2025/4/21
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,650	2,538	32,572	2027/2/17	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,180	1,178	107,738	2029/4/21
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	2,820	2,749	35,277	2025/3/13	ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	650	606	55,450	2039/6/21
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	2,470	2,303	29,559	2029/9/6	ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	660	663	60,628	2037/4/21
NGB 2% 04/26/28	2.0	2,510	2,405	30,862	2028/4/28	ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	670	684	62,568	2034/5/21
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	1,520	1,419	18,216	2032/5/18	ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,200	1,241	113,490	2026/4/21
NGB 3% 03/14/24	3.0	3,630	3,625	46,510	2024/3/14	ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,040	1,132	103,475	2033/4/21
小 計				293,505		ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,080	1,147	104,887	2027/4/21
(デンマーク)											
国債証券	—	千デンマーク クローネ	千デンマーク クローネ			小 計					
DGB 0% 11/15/24	—	2,260	2,155	41,210	2024/11/15						
DGB 0% 11/15/31	—	2,580	2,095	40,057	2031/11/15						
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	2,880	1,621	30,995	2052/11/15						
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	4,470	4,091	78,226	2027/11/15						
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	5,650	4,987	95,360	2029/11/15						
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	2,610	2,556	48,882	2025/11/15						
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	6,480	8,276	158,241	2039/11/15						
小 計				492,974							
(ニュージーランド)											
国債証券		千ニュージ ランドドル	千ニュージ ランドドル			小 計					
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	280	233	19,504	2028/5/15						
NZGB 0.5% 05/15/24	0.5	440	417	34,982	2024/5/15						
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	360	322	26,973	2026/5/15						
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	390	325	27,281	2031/5/15						
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	240	165	13,837	2041/5/15						
NZGB 2% 05/15/32	2.0	280	239	20,064	2032/5/15						
NZGB 2.75% 04/15/25	2.75	490	475	39,765	2025/4/15						
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	350	298	25,018	2037/4/15						
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	270	207	17,399	2051/5/15						
NZGB 3% 04/20/29	3.0	450	429	35,977	2029/4/20						
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	250	241	20,192	2033/4/14						
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	170	174	14,569	2034/5/15						
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	430	440	36,885	2027/4/15						
小 計				332,451							
(シンガポール)											
国債証券		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル			小 計					
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	320	299	29,944	2025/11/1						
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	90	84	8,482	2026/11/1						
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	200	179	17,974	2031/7/1						
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	360	303	30,359	2050/3/1						
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	210	178	17,856	2051/10/1						
SIGB 2% 02/01/24	2.0	440	434	43,414	2024/2/1						
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	670	653	65,259	2026/6/1						
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	440	402	40,260	2036/8/1						
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	510	503	50,271	2025/6/1						
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	230	211	21,166	2039/7/1						
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	280	275	27,557	2028/5/1						
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	100	96	9,676	2032/8/1						
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	420	416	41,630	2046/3/1						
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	300	296	29,612	2042/4/1						
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	530	526	52,645	2029/7/1						
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	460	456	45,581	2030/9/1						
SIGB 3% 08/01/72	3.0	140	154	15,420	2072/8/1						
SIGB 3% 09/01/24	3.0	510	509	50,908	2024/9/1						
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	360	371	37,151	2033/9/1						
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	530	542	54,159	2027/3/1						
小 計				689,334							
(マレーシア)											
国債証券		千マレーシ アリンギット	千マレーシ アリンギット			小 計					
MCS 2.632% 04/15/31	2.632	280	257	7,918	2031/4/15						
MCS 3.478% 06/14/24	3.478	100	100	3,088	2024/6/14						
MCS 3.502% 05/31/27	3.502	920	920	28,305	2027/5/31						
MCS 3.582% 07/15/32	3.582	150	147	4,542	2032/7/15						
小 計				40,853							

銘柄	利率	当 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット			
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	560	565	17,386	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,110	1,057	32,545	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	250	246	7,598	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	856	26,355	2033/4/15	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	690	697	21,458	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,890	1,908	58,701	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	300	304	9,371	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,960	1,998	61,478	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,140	1,157	35,612	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	750	761	23,420	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,100	1,115	34,321	2025/9/15	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,060	1,074	33,054	2024/9/30	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	740	709	21,838	2050/6/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,180	1,196	36,797	2024/7/15	
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	850	876	26,954	2031/6/30	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,480	1,520	46,780	2035/5/31	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,160	1,193	36,723	2026/4/15	
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,260	1,318	40,578	2030/4/15	
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,160	1,232	37,919	2033/11/7	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	900	96	2,978	2042/10/15	
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	640	687	21,149	2046/3/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,245	38,326	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,490	1,641	50,495	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,450	1,590	48,931	2048/7/6	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	820	903	27,799	2043/9/30	
小 計				842,433		
(中国オフショア) 国債証券		千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	63,260	62,652	1,222,212	2025/4/9	
CGB 2.28% 03/17/24	2.28	5,100	5,102	99,535	2024/3/17	
CGB 2.47% 09/02/24	2.47	18,290	18,324	357,461	2024/9/2	
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	18,380	18,229	355,606	2027/4/15	
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	7,750	7,557	147,428	2032/9/1	
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	21,000	20,709	404,001	2029/9/25	
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	11,650	11,495	224,244	2030/5/21	
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	11,720	11,754	229,296	2026/8/12	
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	4,000	3,930	76,674	2032/8/15	
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	15,770	15,759	307,439	2029/3/24	
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	16,020	16,141	314,890	2024/4/8	
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	11,760	11,836	230,903	2027/6/4	
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	22,500	22,508	439,096	2031/11/18	
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	14,300	14,426	281,429	2028/10/14	
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	7,960	8,069	157,425	2028/5/13	
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	7,400	7,490	146,123	2031/5/27	
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	22,150	22,499	438,910	2026/3/11	
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	2,500	2,423	47,282	2052/10/25	
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	3,430	3,552	69,292	2030/11/19	

銘柄	利率	当 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	11,140	11,487	224,089	2027/12/3	
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	3,020	3,039	59,294	2052/4/15	
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	5,360	5,433	106,004	2050/3/16	
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	7,010	7,286	142,139	2051/10/18	
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	3,150	3,380	65,941	2051/4/12	
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	8,230	8,966	174,907	2050/9/14	
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,810	6,371	124,288	2049/7/22	
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	2,030	2,306	45,001	2048/10/22	
小 計				6,490,923		
(イスラエル) 国債証券		千イスラエ ルシェケル	千イスラエ ルシェケル			
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	750	708	27,049	2024/10/31	
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	350	321	12,261	2026/2/27	
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	720	672	25,688	2025/4/30	
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	1,570	1,344	51,311	2030/3/31	
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	310	262	10,005	2032/4/30	
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	930	733	27,990	2037/5/31	
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,040	992	37,894	2025/8/31	
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,210	1,144	43,669	2027/3/31	
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	1,070	1,015	38,754	2028/9/28	
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	260	222	8,498	2052/11/29	
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	1,560	1,558	59,492	2024/3/31	
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	1,440	1,494	57,042	2047/3/31	
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,060	1,356	51,783	2042/1/31	
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,550	1,697	64,808	2026/10/30	
小 計				516,250		
合 計				148,371,579		

(注) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
EURO-SCHATZ	105	—
US 5YR NOTE	244	—
EURO-BOBL FU	166	—
EURO-BUND	292	—
国		
US 10YR NOTE	195	—
US LONG BOND	205	—

(注) 外貨建の評価額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	148,371,579	98.2%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,731,601	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	151,103,180	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(149,659,006千円)の投資信託財産総額(151,103,180千円)に対する比率は99.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=132.58円	1カナダドル=98.69円	1メキシコペソ=6.92円
1ユーロ=142.27円	1イギリスポンド=159.56円	1スウェーデンクローナ=12.50円
1ノルウェークローネ=12.83円	1デンマーククローネ=19.12円	1ポーランドズロチ=29.9924円
1オーストラリアドル=91.39円	1ニュージーランドドル=83.70円	1シンガポールドル=99.92円
1マレーシアリンギット=30.765円	1オフショア人民元=19.5077円	1イスラエルシケル=38.1706円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年2月7日現在
(A) 資 産	152,358,547,210円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,441,885,610
公 社 債(評価額)	148,371,579,304
未 収 入 金	1,290,898,972
未 収 利 息	1,061,074,568
前 払 費 用	76,309,757
差 入 委 託 証 拠 金	116,798,999
(B) 負 債	1,352,660,393
未 払 金	1,276,970,551
未 払 解 約 金	75,688,185
未 払 利 息	1,657
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	151,005,886,817
元 本	57,650,368,316
次 期 繰 越 損 益 金	93,355,518,501
(D) 受 益 権 総 口 数	57,650,368,316口
1万口当たり基準価額(C/D)	26.193円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	3,049,198,184円
受 取 利 息	3,048,939,403
そ の 他 収 益 金	1,381,243
支 払 利 息	△1,122,462
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△3,729,882,603
売 買 益	17,114,141,533
売 買 損	△20,844,024,136
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△183,323,303
取 引 益	100,997,773
取 引 損	△284,321,076
(D) そ の 他 費 用	△23,486,228
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△887,493,950
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	93,149,399,182
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,574,818,448
(H) 解 約 差 損 益 金	△9,481,205,179
(I) 計 (E+F+G+H)	93,355,518,501
次 期 繰 越 損 益 金(I)	93,355,518,501

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は56,972,115,875円、期中追加設定元本額は6,303,164,048円、期中一部解約元本額は5,624,911,607円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC外国債券インデックスファンドL	14,626,185,952円
インデックスコレクション (外国債券)	9,238,659,547円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	5,479,849,568円
私募外国債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	4,891,314,804円
インデックスコレクション (バランス株式30)	4,885,075,400円
外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	2,979,343,710円
外国債券インデックスファンド	1,969,452,026円
DC外国債券インデックスファンド	1,900,402,136円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	1,406,851,739円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,170,380,456円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	1,153,818,507円
DCバランスファンド50	1,035,865,717円
外国債券インデックスe	1,033,375,043円
DCバランスファンド30	951,906,041円
インデックスコレクション (バランス株式50)	911,297,674円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	516,605,278円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	484,503,658円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	371,967,757円
外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	353,900,102円
インデックスコレクション (バランス株式70)	301,598,446円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	293,710,613円
DCバランスファンド70	236,829,006円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	232,593,690円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	200,749,064円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	177,600,348円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	171,173,388円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	168,369,489円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	101,962,174円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	81,229,025円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	76,446,573円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	75,236,652円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	62,414,556円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	53,837,287円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	43,950,779円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	11,912,111円

お知らせ

該当事項はありません。