

iシェアーズ 先進国債券
インデックス・ファンド

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	無期限です。(設定日:2013年9月12日)	
決算日	8月2日(休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託者の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の買付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要運用対象	子投資信託	【iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド】 先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	【先進国債券インデックス・マザーファンド】 日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年1回の毎決算時(原則として8月2日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

第9期 運用報告書(全体版)

(決算日:2022年8月2日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますよう

お願い申し上げます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するご問合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

子投資信託(決算日:2022年8月2日)

「iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2022年8月2日)

「先進国債券インデックス・マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
5期(2018年8月2日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
	11,511	0	△0.6	263.09	△0.0	99.0	-	-	332
6期(2019年8月2日)	11,622	0	1.0	266.80	1.4	99.2	-	-	360
7期(2020年8月3日)	12,632	0	8.7	291.47	9.2	99.2	-	-	497
8期(2021年8月2日)	12,953	0	2.5	300.08	3.0	99.4	-	-	565
9期(2022年8月2日)	13,083	0	1.0	304.36	1.4	99.3	-	-	584

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■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) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2021年8月2日	円	%		%	%	%	%	%
	12,953	-	300.08	-	99.4	-	-	-
8月末	12,927	△0.2	299.59	△0.2	99.1	-	-	-
9月末	12,834	△0.9	297.54	△0.8	99.0	-	-	-
10月末	13,108	1.2	303.90	1.3	99.2	-	-	-
11月末	12,958	0.0	300.52	0.1	99.1	-	-	-
12月末	13,035	0.6	302.42	0.8	99.1	-	-	-
2022年1月末	12,809	△1.1	297.29	△0.9	99.3	-	-	-
2月末	12,572	△2.9	291.91	△2.7	99.0	-	-	-
3月末	12,977	0.2	301.55	0.5	99.1	-	-	-
4月末	13,006	0.4	302.30	0.7	99.5	-	-	-
5月末	12,919	△0.3	300.37	0.1	99.2	-	-	-
6月末	13,228	2.1	307.62	2.5	96.8	-	-	-
7月末	13,319	2.8	309.96	3.3	99.3	-	-	-
(期末) 2022年8月2日	円	%		%	%	%	%	%
	13,083	1.0	304.36	1.4	99.3	-	-	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

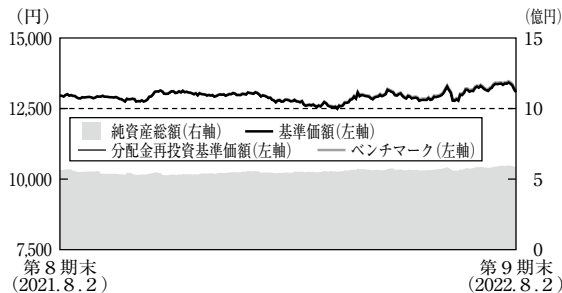
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

■当期中の基準価額等の推移について（第9期：2021年8月3日～2022年8月2日）



第9期首：12,953円

第9期末：13,083円(既払分配金0円)

騰落率：1.0%(分配金再投資ベース)

- * 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)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。
- * 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、ファンドの購入価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。
- * ベンチマークは、F T S E世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。
- * 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

当期(2021年8月3日から2022年8月2日)、先進国(除く日本)債券市場においては、各国のタカ派的な金融政策、地政学的リスクの上昇によるコモディティ価格の急騰および歴史的なインフレ水準等を背景に、先進国金利は上昇基調となりました。米国では、期初から2022年3月にかけて、F R B(連邦準備制度理事会)による利上げが市場で織り込まれる中、短期ゾーンを中心に金利が上昇しました。その後、2022年6月にかけては、インフレ水準が高止まりする中で米国金利は更に上昇し、6月中旬には米10年金利が2011年以来となる3.5%まで上昇しました。ただし、7月から当期末にかけては景気後退懸念が再燃し、米国債の利回りはそれまでの上昇幅を一部巻き戻しました。金融政策においては、F R Bは3月に25 b p

s、5月に50 b p s、6月に75 b p s、7月に75 b p sの合計225 b p sの利上げを当期中に実施しました。

欧州においても、E C B(欧州中央銀行)が50 b p sの利上げを7月に行い、マイナス金利政策を脱却しました。11年ぶりに利上げが行われる中、欧州金利も当期は上昇基調となりました。

ポートフォリオについて

<当ファンド>

先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組入れた運用を行いました。

<先進国債券インデックス・マザーファンド>

日本を除く先進国の国債等を主要投資対象として、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指し運用を行いました。組入比率については概ね98%以上を維持しました。

基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は1.0%の上昇となりました。景気回復局面を背景に先進国金利は上昇したものの、ドル円及びユーロ円が期を通じて上昇したことにより基準価額は上昇しました。

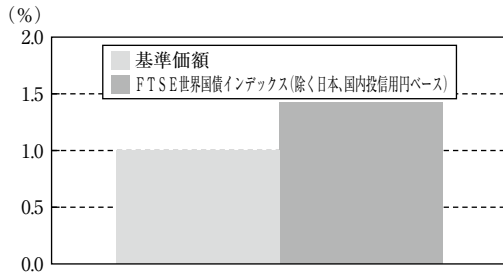
■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
先進国債券インデックス・マザーファンド	1.4%

ベンチマークとの差異について

当期、当ファンドの基準価額は1.0%の上昇となりました。また、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は1.4%の上昇となりました。ベンチマークとの差異については、当ファンドにおいて信託報酬等コスト負担が発生することなどがマイナス要因となりました。

【基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)】



第9期
(2021.8.3 ~ 2022.8.2)

【分配金について】

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2021年8月3日 ~2022年8月2日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,082

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

【今後の運用方針について】

＜当ファンド＞

当ファンドの運用方針に従い、先進国債券インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

＜先進国債券インデックス・マザーファンド＞

日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2021.8.3~2022.8.2)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 46	% 0.357	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 期中の平均基準価額は12,937円です。
(投信会社)	(21)	(0.165)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(21)	(0.165)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(4)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 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
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 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
(d) その他費用	10	0.074	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.017)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(7)	(0.056)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	56	0.431	

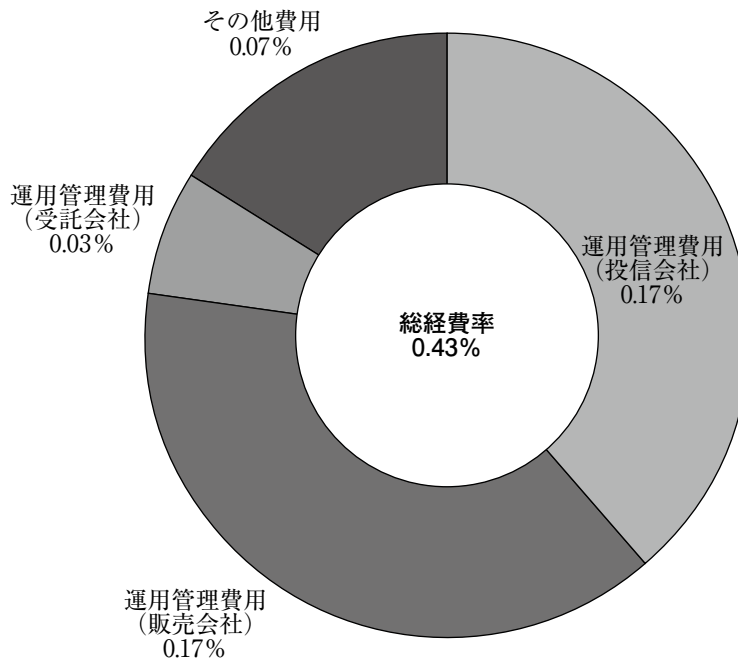
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は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0.43%です。

(注1) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
先進国債券インデックス・マザーファンド	千口 119,756	千円 162,673	千口 112,230	千円 152,605

(注) 単位未満は切捨て。

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 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

親投資信託残高

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
先進国債券インデックス・マザーファンド	千口 417,835	千口 425,361	千円 585,339

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は19,658,308千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国債券インデックス・マザーファンド	585,339	100.0
コール・ローン等、その他	217	0.0
投資信託財産総額	585,557	100.0

(注1) 先進国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(23,882,307千円)の投資信託財産総額(30,378,777千円)に対する比率は、78.6%です。

(注2) 外貨建資産は、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。換算レートは、1米・ドル=130.88円、1カナダ・ドル=101.90円、1オーストラリア・ドル=91.88円、1シンガポール・ドル=95.07円、1英国・ポンド=160.60円、1イスラエル・シェケル=38.78円、1デンマーク・クローネ=18.08円、1ノルウェー・クローネ=13.62円、1スウェーデン・クローナ=12.96円、1メキシコ・ペソ=6.39円、1中国・元=19.33円、1マレーシア・リンギット=29.39円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=134.60円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	585,557,269円
先進国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	585,339,925
未 収 入 金	217,344
(B) 負 債	1,385,953
未 払 解 約 金	217,344
未 払 信 託 報 酬	1,005,967
そ の 他 未 払 費 用	162,642
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	584,171,316
元 本	446,525,393
次 期 繰 越 損 益 金	137,645,923
(D) 受 益 権 総 口 数	446,525,393口
1万口当り基準価額(C/D)	13,083円

<注記事項>

期首元本額	436,799,546円
期中追加設定元本額	126,382,380円
期中一部解約元本額	116,656,533円

■損益の状況

自2021年8月3日 至2022年8月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,189,175円
売 買 益	9,336,665
売 買 損	△ 1,147,490
(B) 信 託 報 酬 等	△ 2,294,521
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	5,894,654
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	27,964,519
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	103,786,750
(配 当 等 相 当 額)	(98,955,289)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,831,461)
(F) 合 計(C+D+E)	137,645,923
次 期 繰 越 損 益 金(F)	137,645,923
追 加 信 託 差 損 益 金	103,786,750
(配 当 等 相 当 額)	(99,254,242)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,532,508)
分 配 準 備 積 立 金	38,306,039
繰 越 損 益 金	△ 4,446,866

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第9期計算期末における、費用控除後の配当等収益(10,341,520円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(85,642円)、収益調整金(その他収益調整金)(99,254,242円)、分配準備積立金(27,964,519円)により、分配対象収益は137,645,923円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

運用報告書

－第9期－ 決算日 2022年8月2日
計算期間(2021年8月3日～2022年8月2日)

先進国債券インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	8月2日(原則)
運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ①日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。 ③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。 ④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。 ⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主要運用対象	日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	円	騰落率	円	騰落率				
5期(2018年8月2日)	11,903	0.0	263.09	△0.0	98.7	—	—	百万円 9,747
6期(2019年8月2日)	12,072	1.4	266.80	1.4	99.0	—	—	16,619
7期(2020年8月3日)	13,177	9.2	291.47	9.2	99.0	—	—	23,646
8期(2021年8月2日)	13,568	3.0	300.08	3.0	99.2	—	—	29,498
9期(2022年8月2日)	13,761	1.4	304.36	1.4	99.1	—	—	27,051

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■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) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(期首) 2021年8月2日	13,568	—	300.08	—	99.2	—	—
8月末	13,546	△0.2	299.59	△0.2	99.1	—	—
9月末	13,453	△0.8	297.54	△0.8	99.0	—	—
10月末	13,744	1.3	303.90	1.3	99.1	—	—
11月末	13,592	0.2	300.52	0.1	99.0	—	—
12月末	13,677	0.8	302.42	0.8	98.9	—	—
2022年1月末	13,445	△0.9	297.29	△0.9	99.1	—	—
2月末	13,201	△2.7	291.91	△2.7	99.0	—	—
3月末	13,631	0.5	301.55	0.5	99.0	—	—
4月末	13,666	0.7	302.30	0.7	99.4	—	—
5月末	13,579	0.1	300.37	0.1	99.0	—	—
6月末	13,908	2.5	307.62	2.5	96.6	—	—
7月末	14,009	3.3	309.96	3.3	99.1	—	—
(期末) 2022年8月2日	13,761	1.4	304.36	1.4	99.1	—	—

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

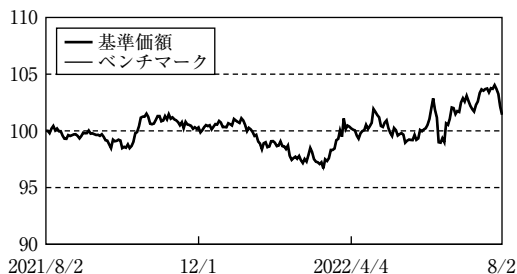
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

■基準価額の推移

(2021年8月2日～2022年8月2日)



(注1) 前期末を100とした指数値を使用しています。

(注2) ベンチマークは、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。

◇ファンド状況

■1万口当りの費用明細

項目	当期
(a) 売買委託手数料	円 -
(b) 有価証券取引税	-
(c) その他費用 (保管費用)	2 (2)
(その他)	(0)
合計	2

(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、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数

(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数

(c) その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米・ドル 123,612	千米・ドル 126,184
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 6,404	千カナダ・ドル 6,802
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 5,025	千オーストラリア・ドル 4,464
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,251	千シンガポール・ドル 1,456
	イギリス	国債証券	千英国・ポンド 10,361	千英国・ポンド 11,945
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 3,002	千イスラエル・シケル 3,812
国	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 5,173	千デンマーク・クローネ 7,066
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 3,089	千ノルウェー・クローネ 4,623
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 3,829	千スウェーデン・クローナ 4,576

			買 付 額	売 付 額	
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 28,933	千メキシコ・ペソ 31,323	
	中 国	国 債 証 券	千中国・元 47,349	千中国・元 13,627	
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 3,434	千マレーシア・リンギット 3,829	
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 3,777	千ポーランド・ズロチ 4,921	
国	ユ ー ロ	ア イ ル ラ ン ド	千ユーロ 1,350	千ユーロ 1,623	
		オ ラ ン ダ	国 債 証 券	3,784	4,199
		ベ ル ギ ー	国 債 証 券	4,328	4,954
		フ ラ ン ス	国 債 証 券	20,638	22,774
		ド イ ツ	国 債 証 券	16,867	18,194 (365)
		ス ペ イ ン	国 債 証 券	13,059	14,195
		イ タ リ ア	国 債 証 券	21,471	23,825
		フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	1,008	1,159
		オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	2,841	3,187
	ユ ー ロ 通 貨 計	国 債 証 券	85,349	94,115 (365)	

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) ()内は、償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) ユーロの国名は発行国です。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

公社債

当			期		
買	付	金額	売	付	金額
銘	柄		銘	柄	
		千円			千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 2028/11/15		358,887	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% 2025/07/31		318,338
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.25% 2031/08/15		314,145	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.75% 2028/01/31		309,212
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2031/05/15		304,440	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.5% 2026/08/15		306,270
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% 2032/05/15		286,864	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.625% 2030/08/15		297,297
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.375% 2031/11/15		284,022	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% 2028/05/15		294,162
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.375% 2026/04/30		277,043	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2023/10/31		289,726
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.25% 2041/05/15		259,541	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0% 2026/02/25		269,403
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.125% 2024/03/31		259,012	SPANISH GOV'T 4.8%		263,850
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.75% 2024/12/31		255,464	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.5% 2023/08/15		259,099
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 2026/11/15		251,653	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0% 2024/02/25		246,965

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

公社債

(A) 種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 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	
ア メ リ カ	千米・ドル 108,372	千米・ドル 103,426	千円 13,536,503	% 50.0	% -	% 22.8	% 17.5	% 9.7	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 5,747	千カナダ・ドル 5,597	570,416	2.1	-	1.1	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 4,790	千オーストラリア・ドル 4,573	420,256	1.6	-	1.1	0.5	-	
シンガポール	千シンガポール・ドル 1,198	千シンガポール・ドル 1,190	113,172	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千英国・ポンド 7,756	千英国・ポンド 8,581	1,378,200	5.1	-	4.0	0.8	0.3	
イスラエル	千イスラエル・シケル 2,730	千イスラエル・シケル 2,785	108,051	0.4	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 5,233	千デンマーク・クローネ 5,621	101,629	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 3,915	千ノルウェー・クローネ 3,711	50,555	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 5,310	千スウェーデン・クローナ 5,391	69,870	0.3	-	0.1	0.1	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 33,500	千メキシコ・ペソ 32,032	204,809	0.8	-	0.4	0.3	0.0	
中 国	千中国・元 33,340	千中国・元 33,935	656,029	2.4	-	1.1	0.8	0.5	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,570	千マレーシア・リンギット 4,656	136,852	0.5	-	0.3	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 4,570	千ポーランド・ズロチ 3,928	112,115	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユ ロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	1,370	1,346	181,302	0.7	-	0.5	0.2	0.0
	オランダ	3,288	3,290	442,853	1.6	-	1.2	0.3	0.1
	ベルギー	3,642	3,974	534,937	2.0	-	1.5	0.4	0.1
	フランス	16,287	17,788	2,394,274	8.9	-	5.8	2.6	0.5
	ドイツ	12,364	13,192	1,775,693	6.6	-	4.2	1.6	0.8
	スペイン	9,851	10,461	1,408,169	5.2	-	3.2	1.6	0.5
	イタリア	15,039	15,798	2,126,420	7.9	-	4.4	2.2	1.2
フィンランド	1,151	1,082	145,657	0.5	-	0.3	0.2	0.0	
オーストリア	2,530	2,531	340,686	1.3	-	0.7	0.4	0.1	
小 計	65,522	69,465	9,349,994	34.6	-	21.7	9.6	3.3	
合 計	-	-	26,808,457	99.1	-	53.6	30.9	14.6	

(注1) 邦貨換算金額は、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。

(注3) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 詳細開示(個別銘柄別)
外国(外貨建)公社債

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2041/02/15	1,365	1,118	146,347
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.2500	2040/11/15	385	454	59,537
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2023/12/31	800	792	103,681
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2040/11/15	1,035	778	101,939
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2051/11/15	750	592	77,485
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2031/11/15	930	837	109,565
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2024/02/15	710	707	92,630
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.2500	2025/07/31	500	463	60,618
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2044/02/15	280	299	39,181
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	6.5000	2026/11/15	700	805	105,465
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2028/12/31	200	185	24,228
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2051/02/15	855	673	88,206
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2031/02/15	330	293	38,451
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2024/01/31	1,760	1,748	228,801
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2026/08/15	967	920	120,509
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2025/11/15	79	77	10,158
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/08/15	900	878	114,925
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/05/15	35	30	4,057
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.3750	2026/01/31	830	763	99,939
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/05/15	1,700	1,630	213,387
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/11/15	1,120	1,095	143,316
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	6.2500	2023/08/15	590	609	79,786
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2027/11/30	1,320	1,185	155,094
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.6250	2040/02/15	90	112	14,661
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/11/15	1,650	1,646	215,428
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.1250	2023/10/15	150	145	18,980
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/08/15	760	744	97,390
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2047/08/15	1,052	980	128,365
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	6.1250	2027/11/15	473	551	72,210
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.3750	2031/02/15	310	375	49,112
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2025/05/15	580	568	74,427
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	6.2500	2030/05/15	735	922	120,700
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2024/11/30	800	775	101,464
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2025/02/15	300	289	37,943
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2032/02/15	120	112	14,753
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2052/02/15	620	535	70,102
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2027/05/31	1,105	996	130,369
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2046/08/15	60	50	6,615
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/10/31	1,015	1,014	132,749
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2025/10/31	890	894	117,106
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.2500	2028/11/15	540	619	81,055
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2023/12/31	760	756	99,037
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/10/31	930	889	116,364

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千 米 ・ ド ル	千 米 ・ ド ル	千 円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.5000	2039/02/15	100	109	14,327
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2041/08/15	880	700	91,685
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2028/04/30	830	766	100,275
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.2500	2029/02/15	490	565	73,988
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2043/05/15	220	209	27,404
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2041/08/15	225	247	32,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/05/15	930	939	122,921
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2028/11/30	1,000	931	121,876
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2043/11/15	196	213	27,936
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.1250	2023/07/31	160	155	20,356
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.0000	2028/07/31	300	272	35,602
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/11/15	250	233	30,620
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2026/08/31	1,000	947	124,003
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2046/11/15	398	378	49,477
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2026/11/15	1,500	1,455	190,445
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/02/15	170	150	19,714
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/02/15	460	441	57,848
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2030/05/15	200	172	22,551
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2050/05/15	790	530	69,383
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2028/02/15	352	352	46,184
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2048/02/15	300	294	38,589
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2024/08/15	950	939	123,014
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2044/08/15	200	197	25,847
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2049/08/15	817	703	92,105
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2028/10/31	810	749	98,041
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.7500	2041/02/15	200	251	32,975
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.1250	2023/08/31	300	290	38,075
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2029/02/15	775	773	101,202
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2049/02/15	415	414	54,187
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/02/15	1,065	1,043	136,550
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2025/01/31	270	260	34,066
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.5000	2039/08/15	35	42	5,626
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2045/08/15	351	332	43,510
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/08/15	160	149	19,620
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/09/30	550	549	71,894
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.8750	2030/11/15	200	174	22,893
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2050/11/15	840	621	81,316
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2030/08/15	1,635	1,402	183,604
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2050/08/15	650	450	58,968
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/10/31	650	641	83,905
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2049/11/15	430	381	49,883
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2040/08/15	640	462	60,574
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/11/30	1,200	1,198	156,908
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/11/30	560	560	73,421
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2032/05/15	2,145	2,196	287,448

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2052/05/15	845	838	109,695
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/08/15	1,055	1,065	139,426
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/04/30	1,700	1,680	219,906
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2026/04/30	720	710	92,945
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2027/02/28	800	745	97,607
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.3750	2024/09/15	500	474	62,060
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2024/12/31	1,280	1,246	163,135
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/06/30	550	548	71,826
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/02/28	1,400	1,395	182,673
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/08/31	550	548	71,806
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2026/07/31	500	483	63,300
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.7500	2024/11/15	750	714	93,528
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/03/31	1,000	986	129,085
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.7500	2026/03/31	1,500	1,394	182,516
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2028/03/31	1,200	1,109	145,160
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2025/03/31	320	318	41,634
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2023/08/15	700	696	91,143
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2045/11/15	100	96	12,687
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2024/08/31	1,000	979	128,144
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.8750	2040/08/15	500	564	73,862
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/09/30	90	88	11,563
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2024/09/30	1,000	971	127,096
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/09/30	640	612	80,160
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/07/31	120	119	15,671
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2043/08/15	285	304	39,900
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2024/02/29	1,220	1,209	158,257
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2026/02/28	800	792	103,681
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.3750	2024/04/15	800	765	100,237
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2026/03/31	1,320	1,296	169,637
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.3750	2044/05/15	260	267	35,017
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2024/05/15	990	982	128,584
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/02/29	400	394	51,662
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2045/02/15	353	312	40,892
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/02/15	550	538	70,471
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2029/03/31	1,500	1,472	192,723
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2027/05/15	1,095	1,078	141,175
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2047/05/15	215	209	27,396
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/04/30	1,000	1,000	130,885
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2025/01/31	750	743	97,255
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2031/05/15	1,542	1,427	186,798
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2051/05/15	1,320	1,169	153,001
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.7500	2026/04/30	80	74	9,721
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.2500	2023/09/30	1,500	1,453	190,231
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.8750	2026/09/30	980	908	118,938
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2028/09/30	760	698	91,383

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千 米 ・ ド ル	千 米 ・ ド ル	千 円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2031/08/15	1,870	1,670	218,636
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2051/08/15	1,085	881	115,401
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2027/10/31	300	267	35,069
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/11/30	200	196	25,724
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2028/11/15	940	963	126,107
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2029/05/15	915	898	117,650
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2049/05/15	250	244	31,954
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.3750	2025/04/30	300	280	36,708
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2027/04/30	500	451	59,057
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2044/11/15	503	485	63,603
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/11/15	1,050	1,035	135,507
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2027/12/31	200	179	23,457
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2041/05/15	1,640	1,429	187,033
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2026/05/31	239	233	30,577
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.0000	2037/05/15	150	193	25,300
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.8750	2026/06/30	800	744	97,415
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2028/06/30	300	276	36,175
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/05/31	685	673	88,195
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/04/30	940	924	121,052
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2030/02/15	760	703	92,055
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2050/02/15	525	427	55,968
小 計	-	-	108,372	103,426	13,536,503
(カナダ)			千 カ ナ ダ ・ ド ル	千 カ ナ ダ ・ ド ル	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/09/01	300	280	28,616
CANADIAN GOVERNMENT BOND	8.0000	2027/06/01	131	162	16,590
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2030/12/01	470	395	40,351
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.5000	2045/12/01	145	162	16,531
CANADIAN GOVERNMENT BOND	5.7500	2033/06/01	261	335	34,197
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.2500	2027/03/01	30	28	2,877
CANADIAN GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/06/01	130	155	15,856
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.7500	2024/10/01	60	57	5,840
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2025/09/01	390	363	37,027
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2024/05/01	100	97	9,937
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.7500	2053/12/01	100	78	8,022
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.0000	2028/06/01	80	77	7,894
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2025/04/01	310	299	30,480
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2031/12/01	300	272	27,777
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2029/12/01	45	44	4,490
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2048/12/01	536	532	54,245
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2029/06/01	30	29	2,995
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.7500	2024/02/01	280	270	27,607
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.2500	2024/04/01	430	411	41,919
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2024/08/01	250	248	25,369
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2023/11/01	100	96	9,873
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/06/01	70	69	7,078

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(カナダ)	%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2064/12/01	189	187	19,095
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.2500	2023/05/01	30	29	2,992
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2031/06/01	295	269	27,426
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2027/09/01	175	176	17,940
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.2500	2026/03/01	300	274	28,011
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/06/01	210	190	19,366
小 計	-	-	5,747	5,597	570,416
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.5000	2033/04/21	400	450	41,349
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.2500	2028/05/21	210	202	18,629
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.0000	2047/03/21	151	139	12,780
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2035/06/21	122	115	10,641
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.7500	2051/06/21	130	89	8,223
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2039/06/21	130	127	11,709
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2029/04/21	233	237	21,790
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.5000	2030/05/21	363	349	32,154
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2041/05/21	120	108	9,936
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/11/21	300	295	27,126
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	0.5000	2026/09/21	320	291	26,767
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/04/21	525	532	48,926
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.2500	2032/05/21	60	50	4,657
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.0000	2030/12/21	160	135	12,469
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.2500	2026/04/21	495	520	47,830
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.5000	2031/06/21	497	436	40,102
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.0000	2031/11/21	511	425	39,077
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.7500	2037/04/21	63	66	6,082
小 計	-	-	4,790	4,573	420,256
(シンガポール)			千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	0.5000	2025/11/01	45	42	4,012
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/02/01	75	74	7,067
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.3750	2033/09/01	180	191	18,199
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.6250	2028/05/01	70	70	6,680
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.8750	2051/10/01	50	40	3,864
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2046/03/01	45	44	4,196
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.8750	2030/09/01	95	96	9,185
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/09/01	77	77	7,390
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.8750	2029/07/01	90	91	8,701
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.3750	2039/07/01	30	28	2,705
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.2500	2036/08/01	35	33	3,144
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.1250	2026/06/01	135	133	12,661
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.3750	2025/06/01	61	60	5,779
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.8750	2050/03/01	40	32	3,091
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2042/04/01	70	69	6,579
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.5000	2027/03/01	100	104	9,911
小 計	-	-	1,198	1,190	113,172

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)	%		千英国・ポンド	千英国・ポンド	千円
UNITED KINGDOM GILT	6.0000	2028/12/07	66	83	13,417
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2037/09/07	290	272	43,814
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2036/03/07	90	112	18,059
UNITED KINGDOM GILT	2.2500	2023/09/07	77	77	12,422
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2045/01/22	133	159	25,536
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2040/12/07	190	245	39,381
UNITED KINGDOM GILT	5.0000	2025/03/07	170	184	29,603
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2046/12/07	458	617	99,124
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2032/06/07	103	125	20,186
UNITED KINGDOM GILT	1.6250	2071/10/22	454	387	62,155
UNITED KINGDOM GILT	4.7500	2030/12/07	390	483	77,688
UNITED KINGDOM GILT	0.3750	2026/10/22	395	374	60,143
UNITED KINGDOM GILT	2.0000	2025/09/07	485	490	78,786
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2039/09/07	420	537	86,362
UNITED KINGDOM GILT	0.2500	2025/01/31	300	289	46,442
UNITED KINGDOM GILT	0.5000	2029/01/31	315	292	46,980
UNITED KINGDOM GILT	3.7500	2052/07/22	386	509	81,903
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2027/12/07	450	509	81,867
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2068/07/22	336	468	75,168
UNITED KINGDOM GILT	1.6250	2054/10/22	350	301	48,465
UNITED KINGDOM GILT	0.1250	2024/01/31	370	360	57,915
UNITED KINGDOM GILT	0.6250	2035/07/31	160	132	21,248
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2049/12/07	369	511	82,181
UNITED KINGDOM GILT	4.5000	2034/09/07	325	411	66,031
UNITED KINGDOM GILT	1.2500	2041/10/22	50	41	6,713
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2057/07/22	129	114	18,465
UNITED KINGDOM GILT	1.0000	2032/01/31	340	314	50,505
UNITED KINGDOM GILT	1.5000	2053/07/31	20	16	2,678
UNITED KINGDOM GILT	3.2500	2044/01/22	135	155	24,948
小 計	-	-	7,756	8,581	1,378,200
(イスラエル)			千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2030/03/31	575	524	20,353
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2025/04/30	50	48	1,863
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2025/08/31	130	130	5,078
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2037/05/31	230	194	7,533
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2042/01/31	235	330	12,806
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2026/02/27	290	274	10,652
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2026/10/30	160	193	7,520
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2024/03/31	505	525	20,394
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2024/10/31	380	367	14,267
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.0000	2047/03/31	175	195	7,580
小 計	-	-	2,730	2,785	108,051
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.2500	2052/11/15	520	373	6,756
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/11/15	1,450	1,428	25,829

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(デンマーク)	%		千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/15	248	251	4,549
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/11/15	750	740	13,394
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/11/15	580	524	9,491
DENMARK GOVERNMENT BOND	4.5000	2039/11/15	1,260	1,860	33,640
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/11/15	425	440	7,968
小 計	-	-	5,233	5,621	101,629
(ノルウェー)			千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.2500	2031/09/17	530	466	6,359
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/03/13	150	146	1,996
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.5000	2026/02/19	960	922	12,566
NORWAY GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/03/14	650	653	8,901
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2027/02/17	500	481	6,552
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.1250	2032/05/18	260	246	3,354
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.3750	2030/08/19	660	596	8,128
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0000	2028/04/26	205	197	2,695
小 計	-	-	3,915	3,711	50,555
(スウェーデン)			千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2029/11/12	750	716	9,287
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.1250	2031/05/12	500	448	5,814
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2028/05/12	780	750	9,728
SWEDEN GOVERNMENT BOND	3.5000	2039/03/30	570	745	9,664
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/11/12	570	557	7,225
SWEDEN GOVERNMENT BOND	2.2500	2032/06/01	250	271	3,518
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/13	1,260	1,257	16,292
SWEDEN GOVERNMENT BOND	2.5000	2025/05/12	630	643	8,339
小 計	-	-	5,310	5,391	69,870
(メキシコ)			千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
MEXICAN BONOS	7.7500	2042/11/13	2,800	2,550	16,308
MEXICAN BONOS	8.0000	2047/11/07	2,500	2,334	14,925
MEXICAN BONOS	7.7500	2031/05/29	5,400	5,134	32,831
MEXICAN BONOS	10.0000	2036/11/20	600	672	4,301
MEXICAN BONOS	8.0000	2024/09/05	4,900	4,797	30,674
MEXICAN BONOS	7.5000	2027/06/03	1,800	1,722	11,011
MEXICAN BONOS	8.5000	2029/05/31	4,100	4,086	26,129
MEXICAN BONOS	8.0000	2023/12/07	1,700	1,669	10,675
MEXICAN BONOS	5.7500	2026/03/05	3,700	3,369	21,542
MEXICAN BONOS	8.5000	2038/11/18	2,300	2,264	14,480
MEXICAN BONOS	5.5000	2027/03/04	2,500	2,205	14,102
MEXICAN BONOS	10.0000	2024/12/05	1,200	1,223	7,826
小 計	-	-	33,500	32,032	204,809
(中国)			千中国・元	千中国・元	
CHINA GOVERNMENT BOND	4.0800	2048/10/22	1,250	1,423	27,517
CHINA GOVERNMENT BOND	2.2800	2024/03/17	2,800	2,809	54,304
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8400	2024/04/08	2,200	2,226	43,046
CHINA GOVERNMENT BOND	3.8100	2050/09/14	770	843	16,300

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(中国)	%		千中国・元	千中国・元	千円
CHINA GOVERNMENT BOND	1.9900	2025/04/09	4,250	4,215	81,499
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0300	2026/03/11	2,150	2,193	42,403
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6800	2030/05/21	2,100	2,081	40,242
CHINA GOVERNMENT BOND	3.3900	2050/03/16	870	881	17,036
CHINA GOVERNMENT BOND	3.5300	2051/10/18	350	367	7,108
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8900	2031/11/18	1,550	1,564	30,243
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0100	2028/05/13	2,600	2,654	51,318
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0200	2031/05/27	2,200	2,242	43,341
CHINA GOVERNMENT BOND	2.9100	2028/10/14	3,150	3,191	61,698
CHINA GOVERNMENT BOND	3.7200	2051/04/12	500	538	10,418
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8500	2027/06/04	1,300	1,320	25,520
CHINA GOVERNMENT BOND	3.1200	2026/12/05	2,300	2,361	45,653
CHINA GOVERNMENT BOND	2.3600	2023/07/02	1,500	1,507	29,133
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6900	2026/08/12	1,500	1,512	29,241
小 計	-	-	33,340	33,935	656,029
(マレーシア)			千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.7360	2046/03/15	100	102	3,018
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	5.2480	2028/09/15	165	177	5,228
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.6420	2033/11/07	130	136	4,006
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.9060	2026/07/15	400	402	11,824
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.2320	2031/06/30	190	193	5,701
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.9350	2043/09/30	175	185	5,445
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.0590	2024/09/30	100	101	2,980
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.5020	2027/05/31	390	385	11,344
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.9210	2048/07/06	340	356	10,464
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1810	2024/07/15	200	203	5,975
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.4980	2030/04/15	330	342	10,079
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2023/08/17	90	90	2,667
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.2540	2035/05/31	700	700	20,582
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.8930	2038/06/08	290	305	8,969
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1270	2032/04/15	130	131	3,862
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8440	2033/04/15	300	293	8,638
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8820	2025/03/14	120	121	3,558
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8920	2027/03/15	270	271	7,988
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.3920	2026/04/15	150	153	4,515
小 計	-	-	4,570	4,656	136,852
(ポーランド)			千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	1.7500	2032/04/25	440	320	9,149
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	3.7500	2027/05/25	150	136	3,882
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2024/10/25	65	59	1,697
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	720	673	19,209
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/07/25	300	264	7,551
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	735	677	19,347
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	365	304	8,686
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	0.2500	2026/10/25	110	86	2,479

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ポーランド)	%		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	410	351	10,041
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	380	275	7,857
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	685	598	17,090
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	210	179	5,121
小 計	-	-	4,570	3,928	112,115
(ユーロ・・・アイルランド)			千ユーロ	千ユーロ	
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2027/05/15	85	82	11,118
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2030/10/18	295	272	36,641
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/10/18	120	106	14,307
IRELAND GOVERNMENT BOND	3.4000	2024/03/18	10	10	1,412
IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	94	96	12,998
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	25	25	3,408
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	45	45	6,130
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	130	129	17,475
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3000	2033/05/15	150	147	19,837
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.1000	2029/05/15	140	140	18,958
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	93	83	11,280
IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4000	2025/03/13	183	206	27,731
(ユーロ・・・オランダ)					
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2052/01/15	133	90	12,115
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2029/01/15	330	313	42,140
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.7500	2047/01/15	230	298	40,238
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.5000	2033/01/15	200	227	30,655
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2025/07/15	129	128	17,285
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/07/15	220	227	30,592
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2026/01/15	310	304	40,977
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	5.5000	2028/01/15	255	320	43,182
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/01/15	70	69	9,395
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2027/01/15	245	238	32,123
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	4.0000	2037/01/15	119	161	21,751
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2038/01/15	572	467	62,967
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2030/07/15	220	205	27,640
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/07/15	220	202	27,251
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2029/07/15	35	33	4,535
(ユーロ・・・ベルギー)					
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.7500	2045/06/22	145	191	25,718
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	5.5000	2028/03/28	40	50	6,805
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	5.0000	2035/03/28	455	631	84,979
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.6000	2047/06/22	70	64	8,637
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.0000	2031/06/22	300	295	39,716
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.4000	2053/06/22	230	194	26,128
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/06/22	230	233	31,422
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.1000	2030/06/22	105	97	13,079
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.9000	2029/06/22	189	188	25,332
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.6000	2024/06/22	155	161	21,754

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・ベルギー)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.7000	2050/06/22	105	97	13,091
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.5000	2024/10/22	245	245	33,103
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.0000	2032/03/28	270	337	45,450
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.8000	2027/06/22	190	190	25,679
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2041/03/28	245	332	44,688
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.8000	2025/06/22	120	121	16,322
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.0000	2027/10/22	220	211	28,474
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.8000	2028/06/22	230	229	30,910
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.1500	2066/06/22	98	101	13,640
(ユーロ・・・フランス)					
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	5.5000	2029/04/25	850	1,103	148,492
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.7500	2066/05/25	85	80	10,770
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	3.5000	2026/04/25	1,131	1,251	168,400
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.5000	2050/05/25	485	443	59,719
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	6.0000	2025/10/25	107	125	16,917
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	4.5000	2041/04/25	760	1,083	145,814
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2060/04/25	468	704	94,835
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	5.7500	2032/10/25	648	924	124,463
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.5000	2030/05/25	702	781	105,182
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2025/02/25	1,230	1,212	163,246
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.7500	2024/11/25	160	164	22,202
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.2500	2024/05/25	815	843	113,578
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	3.2500	2045/05/25	350	440	59,259
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2055/04/25	155	227	30,596
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	4.2500	2023/10/25	70	73	9,880
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/11/25	70	69	9,354
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2031/11/25	960	859	115,650
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.5000	2031/05/25	735	758	102,128
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.0000	2025/11/25	550	558	75,107
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2030/11/25	320	291	39,263
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2026/05/25	215	213	28,797
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2029/11/25	160	148	20,050
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2027/02/25	500	483	65,121
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/05/25	490	487	65,612
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.2500	2036/05/25	330	316	42,583
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2025/05/25	415	414	55,842
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2029/05/25	510	495	66,710
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.2500	2034/05/25	450	438	59,053
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.0000	2027/05/25	485	491	66,098
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/02/25	60	59	8,022
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2025/03/25	230	226	30,540
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.0000	2048/05/25	545	556	74,932
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2038/10/25	370	491	66,118
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.7500	2027/10/25	876	965	129,923

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・ドイツ)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	6.2500	2030/01/04	570	805	108,357
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	6.2500	2024/01/04	280	304	40,996
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.2500	2028/08/15	250	246	33,116
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2031/08/15	413	388	52,352
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	5.6250	2028/01/04	40	51	6,869
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	4.7500	2028/07/04	700	872	117,390
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	1.2500	2048/08/15	237	249	33,542
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.5000	2027/08/15	300	301	40,533
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2036/05/15	545	478	64,359
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	5.5000	2031/01/04	170	237	32,016
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	1.7500	2024/02/15	200	205	27,614
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	2.5000	2046/08/15	502	660	88,965
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2035/05/15	212	188	25,370
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2026/04/10	750	741	99,776
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	6.5000	2027/07/04	460	595	80,141
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	3.2500	2042/07/04	138	194	26,141
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2024/03/15	130	129	17,464
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	4.2500	2039/07/04	134	201	27,086
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2032/02/15	620	579	77,941
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2028/11/15	30	29	3,911
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2027/04/16	650	637	85,828
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2027/11/15	380	371	49,954
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2030/02/15	170	162	21,915
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	1.0000	2025/08/15	500	511	68,805
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2024/10/18	810	805	108,477
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2030/08/15	375	357	48,078
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2029/08/15	360	346	46,621
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	4.0000	2037/01/04	194	272	36,742
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	1.5000	2024/05/15	177	181	24,394
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2031/02/15	380	359	48,433
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2050/08/15	538	404	54,430
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2023/09/15	730	728	98,078
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	4.7500	2040/07/04	328	527	70,973
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2052/08/15	91	66	9,007
(ユーロ・・・スペイン)					
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.7500	2032/07/30	270	370	49,871
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.7000	2048/10/31	346	367	49,414
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2028/01/31	560	525	70,781
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.5500	2032/10/31	465	494	66,554
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2025/01/31	365	358	48,318
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.0000	2050/10/31	50	35	4,786
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.5000	2030/04/30	340	316	42,610
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.8000	2024/04/30	270	285	38,387
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.7000	2041/07/30	335	462	62,210
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.9000	2052/10/31	25	21	2,909

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・スペイン)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2025/05/31	590	577	77,697
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.7000	2032/04/30	415	375	50,562
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.8000	2029/07/30	80	76	10,344
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.8000	2027/07/30	560	552	74,430
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.4500	2066/07/30	214	255	34,384
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.2000	2037/01/31	430	543	73,177
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2027/01/31	550	525	70,677
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2026/01/31	465	451	60,749
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.2000	2040/10/31	350	291	39,265
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.9000	2026/07/30	575	688	92,705
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.4500	2029/04/30	190	191	25,795
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/05/31	665	658	88,679
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2028/10/31	619	763	102,785
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/31	360	352	47,406
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2044/10/31	282	422	56,825
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.9500	2030/07/30	480	496	66,834
(ユーロ・・・イタリア)					
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.8500	2049/09/01	589	651	87,627
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.2000	2025/08/15	303	298	40,171
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.5000	2025/11/15	170	174	23,469
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	6.0000	2031/05/01	854	1,076	144,865
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.8000	2029/06/15	360	366	49,313
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.0000	2024/04/15	440	431	58,130
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2044/09/01	591	732	98,648
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.7500	2033/02/01	365	458	61,692
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.8500	2025/07/01	950	956	128,739
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2040/09/01	445	554	74,569
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.1000	2027/04/01	260	248	33,501
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	6.5000	2027/11/01	158	193	26,049
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.0000	2024/12/15	600	581	78,212
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.5000	2032/12/01	444	425	57,289
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.7500	2024/05/30	500	504	67,844
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.2500	2046/09/01	40	40	5,460
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2028/09/01	820	931	125,432
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.0000	2037/02/01	840	931	125,395
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.7500	2024/07/01	540	545	73,420
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.0500	2027/08/01	700	698	94,054
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.0000	2026/08/01	430	399	53,705
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.0000	2026/04/01	490	458	61,739
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.1000	2026/07/15	490	494	66,612
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.0000	2029/08/01	550	569	76,603
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2039/08/01	433	537	72,414
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.9500	2031/12/01	125	106	14,271
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.2500	2028/03/15	805	719	96,899
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.3500	2035/03/01	395	407	54,818

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・イタリア)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.4500	2025/05/15	170	169	22,813
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.8000	2067/03/01	268	232	31,352
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	0.0000	2023/11/29	914	901	121,302
(ユーロ・・・フィンランド)					
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/09/15	35	34	4,697
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2043/04/15	80	62	8,475
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2030/09/15	40	36	4,925
FINLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2025/07/04	46	50	6,830
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2028/09/15	120	117	15,757
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2026/04/15	130	129	17,408
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.1250	2036/04/15	40	33	4,456
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/09/15	140	138	18,698
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.2500	2040/09/15	70	54	7,356
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.1250	2034/04/15	70	67	9,133
FINLAND GOVERNMENT BOND	2.6250	2042/07/04	55	63	8,556
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.1250	2031/09/15	90	81	11,007
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.8750	2025/09/15	70	70	9,516
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.1250	2052/04/15	65	42	5,747
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2026/09/15	100	97	13,087
(ユーロ・・・オーストリア)					
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	4.1500	2037/03/15	65	86	11,622
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2025/04/20	180	177	23,888
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.7500	2026/10/20	120	120	16,249
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.5000	2047/02/20	175	169	22,811
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2028/10/20	220	207	27,867
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/07/15	70	69	9,370
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.7500	2051/03/20	30	23	3,176
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/07/15	175	173	23,397
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2062/01/26	39	60	8,142
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.1000	2117/09/20	136	145	19,551
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.7500	2028/02/20	105	104	14,029
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/04/20	245	242	32,642
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2040/10/20	75	54	7,368
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/02/20	75	67	9,104
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/10/20	45	45	6,156
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.2000	2025/10/20	240	245	33,006
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.8500	2049/05/23	100	103	13,889
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.2500	2036/10/20	120	99	13,357
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	4.8500	2026/03/15	100	115	15,540
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2030/02/20	100	92	12,414
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.4000	2034/05/23	115	127	17,099
小 計	-	-	65,522	69,465	9,349,994
合 計	-	-	-	-	26,808,457

(注1) 邦貨換算金額は、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) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	26,808,457	88.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,570,320	11.8
投 資 信 託 財 産 総 額	30,378,777	100.0

- (注1) 当期末における外貨建資産(23,882,307千円)の投資信託財産総額(30,378,777千円)に対する比率は、78.6%です。
(注2) 外貨建資産は、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。換算レートは、1米・ドル=130.88円、1カナダ・ドル=101.90円、1オーストラリア・ドル=91.88円、1シンガポール・ドル=95.07円、1英国・ポンド=160.60円、1イスラエル・シェケル=38.78円、1デンマーク・クローネ=18.08円、1ノルウェー・クローネ=13.62円、1スウェーデン・クローナ=12.96円、1メキシコ・ペソ=6.39円、1中国・元=19.33円、1マレーシア・リンギット=29.39円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=134.60円です。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	33,614,729,725円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,252,622,642
公 社 債(評価額)	26,808,457,138
未 収 入 金	3,401,918,570
未 収 利 息	136,122,360
前 払 費 用	15,609,015
(B) 負 債	6,562,823,184
未 払 金	6,562,605,840
未 払 解 約 金	217,344
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	27,051,906,541
元 本	19,658,308,197
次 期 繰 越 損 益 金	7,393,598,344
(D) 受 益 権 総 口 数	19,658,308,197口
1万口当り基準価額(C/D)	13,761円

<注記事項>

期首元本額	21,741,125,329円
期中追加設定元本額	19,872,844,307円
期中一部解約元本額	21,955,661,439円

期末における元本の内訳

JDFインデックス・ファンド外国債券V A(適格機関投資家専用)	2,451,658,589円
iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド	425,361,475円
ブラックロック・インデックス投資戦略ファンド	1,117,835,638円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,414,712,417円
ブラックロックLifePathファンド2055	165,614,151円
ブラックロックLifePathファンド2045	230,303,059円
ブラックロックLifePathファンド2035	490,299,011円
ブラックロック・つみたて・グローバルバランスファンド	1,340,581,247円
ブラックロックLifePathファンド2030	443,944,818円
ブラックロックLifePathファンド2040	330,178,582円
ブラックロックLifePathファンド2050	125,061,417円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型/適格機関投資家限定)	6,541,451,671円
ブラックロックLifePathファンド2025	191,362,065円
マルチ・アセット投資戦略ファンド3(適格機関投資家限定)	1,300,154,365円
ブラックロックLifePathファンド2060	23,883,034円
ブラックロックLifePathファンド2065	65,906,658円
合計	19,658,308,197円

■損益の状況

自2021年8月3日 至2022年8月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	681,599,958円
受 取 利 息	681,770,194
そ の 他 収 益 金	2,144
支 払 利 息	△ 172,380
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 466,704,243
売 買 益	3,944,057,957
売 買 損	△4,410,762,200
(C) そ の 他 費 用	△ 5,210,327
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	209,685,388
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,757,511,159
(F) 解 約 差 損 益 金	△7,639,022,605
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,065,424,402
(H) 合 計(D+E+F+G)	7,393,598,344
次 期 繰 越 損 益 金(H)	7,393,598,344

- (注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。
(注3) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。