

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。</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。</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> <p>※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> | |

第10期 運用報告書(全体版)

(決算日:2023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お問合わせ先

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:2023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:2023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 | | | | |
| 6期(2019年8月2日) | 円 11,622 | 円 0 | % 1.0 | % 266.80 | % 1.4 | % 99.2 | % - | % - | 百万円 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 |
| 10期(2023年8月2日) | 13,616 | 0 | 4.1 | 317.62 | 4.4 | 99.2 | - | - | 709 |

(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により運営されている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 | | | |
| (期首) 2022年8月2日 | 円 13,083 | % - | % 304.36 | % - | % 99.3 | % - | % - |
| 8月末 | 13,153 | 0.5 | 305.90 | 0.5 | 99.0 | - | - |
| 9月末 | 13,026 | △0.4 | 303.25 | △0.4 | 99.2 | - | - |
| 10月末 | 13,414 | 2.5 | 312.32 | 2.6 | 99.1 | - | - |
| 11月末 | 13,002 | △0.6 | 302.92 | △0.5 | 99.1 | - | - |
| 12月末 | 12,362 | △5.5 | 287.98 | △5.4 | 99.2 | - | - |
| 2023年1月末 | 12,508 | △4.4 | 291.51 | △4.2 | 99.0 | - | - |
| 2月末 | 12,660 | △3.2 | 295.04 | △3.1 | 99.1 | - | - |
| 3月末 | 12,814 | △2.1 | 298.75 | △1.8 | 99.0 | - | - |
| 4月末 | 12,908 | △1.3 | 301.01 | △1.1 | 99.0 | - | - |
| 5月末 | 13,241 | 1.2 | 308.81 | 1.5 | 99.0 | - | - |
| 6月末 | 13,769 | 5.2 | 321.14 | 5.5 | 99.4 | - | - |
| 7月末 | 13,468 | 2.9 | 314.24 | 3.2 | 90.7 | - | - |
| (期末) 2023年8月2日 | 13,616 | 4.1 | 317.62 | 4.4 | 99.2 | - | - |

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

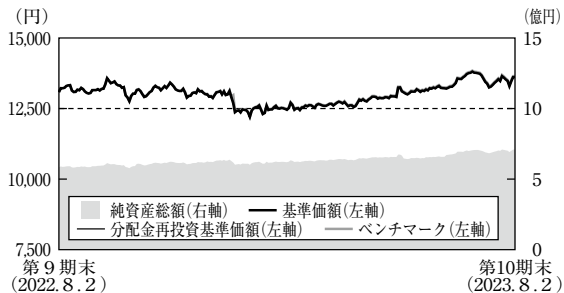
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(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により運営されている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10期：2022年8月3日～2023年8月2日）



第10期首：13,083円

第10期末：13,616円(既払分配金0円)

騰落率：4.1%(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(2022年8月3日から2023年8月2日)、先進国(除く日本)債券市場においては、各国の引き締めの金融政策やインフレ水準等を背景に、先進国金利は上昇しました。米国では、期初から2022年10月にかけて、高止まりするインフレ水準やF R B(米連邦準備制度理事会)が急ペースで利上げを続ける中、短期ゾーンが牽引する形で金利が上昇しました。その後、2023年4月頃にかけては米国の中小銀行の破綻などを背景に景気後退懸念が高まる中、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。ただし、期末にかけては、米国の経済指標の底堅さや日銀による政策変更などを受けて金利は再び上昇に転じ、期末時点の米国10年債利回りは4.1%となりました。

欧州においても、景気後退懸念等を背景に金利が低下する局面はあったものの、E C B(欧州中央銀行)が利上げを続ける中、欧州国債の利回りは当期を通じて上昇しました。

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み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4.1%の上昇となりました。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。

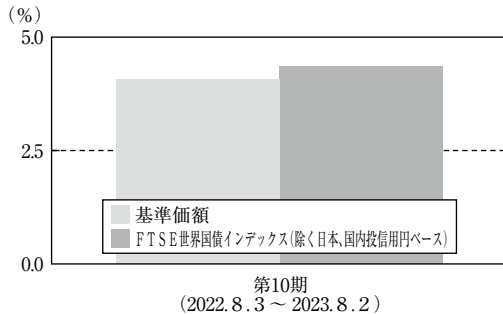
■組入ファンドの当期間中の騰落率

| 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 | 4.5% |

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4.1%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4.4%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)】



【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。

【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 2022年8月3日 ～2023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 | 3,616 |

- (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。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

| 項目 | 第10期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------------------------|------------|---|
| | (2022. 8. 3～2023. 8. 2) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 円 47 | % 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13,013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 | 9 | 0.071 | 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) | (0.019) | 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) | (0.051) | 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 | 0.428 | |

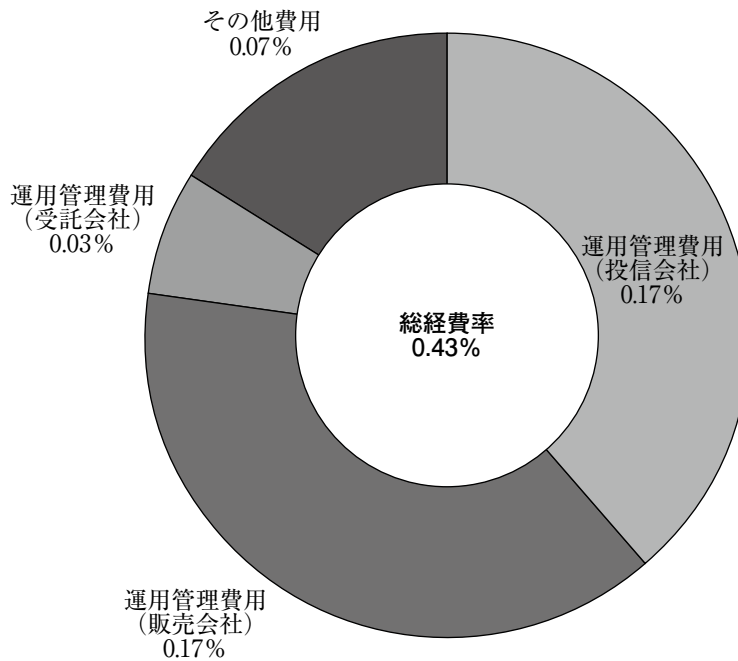
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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(2022年8月3日から2023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 142,983 | 千円 197,209 | 千口 73,866 | 千円 102,406 |

(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(2022年8月3日から2023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(2022年8月3日から2023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 425,361 | 千口 494,478 | 千円 711,109 |

(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17,841,895千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2023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 | 711,109 | 99.9 |
| コール・ローン等、その他 | 519 | 0.1 |
| 投資信託財産総額 | 711,628 | 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(25,699,185千円)の投資信託財産総額(28,246,581千円)に対する比率は、91.0%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=143.23円、1カナダ・ドル=107.90円、1オーストラリア・ドル=94.80円、1シンガポール・ドル=107.24円、1ニュージーランド・ドル=87.83円、1英国・ポンド=183.09円、1イスラエル・シケル=39.39円、1デンマーク・クローネ=21.14円、1ノルウェー・クローネ=14.06円、1スウェーデン・クローナ=13.54円、1メキシコ・ペソ=8.48円、1中国・元=19.94円、1マレーシア・リンギット=31.64円、1ポーランド・ズロチ=35.38円、1ユーロ=157.48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

2023年8月2日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 711,628,431円 |
| 先進国債券インデックス・マザーファンド(評価額) | 711,109,205 |
| 未 収 入 金 | 519,226 |
| (B) 負 債 | 1,850,119 |
| 未 払 解 約 金 | 519,226 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,168,251 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 162,642 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 709,778,312 |
| 元 本 | 521,269,410 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 188,508,902 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 521,269,410口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 13,616円 |

<注記事項>

| | |
|-----------|--------------|
| 期首元本額 | 446,525,393円 |
| 期中追加設定元本額 | 151,256,899円 |
| 期中一部解約元本額 | 76,512,882円 |

■損益の状況

自2022年8月3日 至2023年8月2日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 30,270,305円 |
| 売 買 益 | 32,103,981 |
| 売 買 損 | △ 1,833,676 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 2,589,278 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 27,681,027 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 28,966,864 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 131,861,011 |
| (配 当 等 相 当 額) | (127,815,296) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,045,715) |
| (F) 合 計(C+D+E) | 188,508,902 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | 188,508,902 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 131,861,011 |
| (配 当 等 相 当 額) | (128,211,418) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (3,649,593) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 56,647,891 |

(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10期計算期末における、費用控除後の配当等収益(14,496,666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(9,380,017円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(3,649,593円)、収益調整金(その他収益調整金)(128,211,418円)、分配準備積立金(32,771,208円)により、分配対象収益は188,508,902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10期－ 決算日 2023年8月2日
計算期間(2022年8月3日～2023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 | | 騰落率 | | | | |
| 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 |
| 10期(2023年8月2日) | 14,381 | 4.5 | 317.62 | 4.4 | 99.0 | — | — | 25,658 |

(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により運営されている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いません。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 | | 騰落率 | | | |
| (期首) 2022年8月2日 | 13,761 | — | 304.36 | — | 99.1 | — | — |
| 8月末 | 13,840 | 0.6 | 305.90 | 0.5 | 99.0 | — | — |
| 9月末 | 13,711 | △0.4 | 303.25 | △0.4 | 99.1 | — | — |
| 10月末 | 14,124 | 2.6 | 312.32 | 2.6 | 99.0 | — | — |
| 11月末 | 13,695 | △0.5 | 302.92 | △0.5 | 99.0 | — | — |
| 12月末 | 13,026 | △5.3 | 287.98 | △5.4 | 99.0 | — | — |
| 2023年1月末 | 13,184 | △4.2 | 291.51 | △4.2 | 98.8 | — | — |
| 2月末 | 13,349 | △3.0 | 295.04 | △3.1 | 99.1 | — | — |
| 3月末 | 13,516 | △1.8 | 298.75 | △1.8 | 98.9 | — | — |
| 4月末 | 13,619 | △1.0 | 301.01 | △1.1 | 99.0 | — | — |
| 5月末 | 13,975 | 1.6 | 308.81 | 1.5 | 98.9 | — | — |
| 6月末 | 14,537 | 5.6 | 321.14 | 5.5 | 99.2 | — | — |
| 7月末 | 14,224 | 3.4 | 314.24 | 3.2 | 90.5 | — | — |
| (期末) 2023年8月2日 | 14,381 | 4.5 | 317.62 | 4.4 | 99.0 | — | — |

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

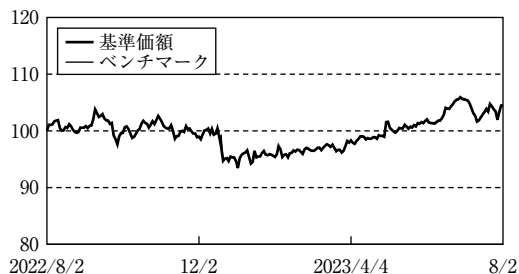
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(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により運営されている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いません。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

(2022年8月2日～2023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) | 3 (2) |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 3 |

(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(2022年8月3日から2023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 139,927 | 千米・ドル 150,066 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル 7,846 | 千カナダ・ドル 8,317 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 5,801 | 千オーストラリア・ドル 6,125 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポール・ドル 1,472 | 千シンガポール・ドル 1,600 |
| | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランド・ドル 1,364 | 千ニュージーランド・ドル 693 |
| 国 | イギリス | 国債証券 | 千英国・ポンド 12,375 | 千英国・ポンド 11,811 |
| | イスラエル | 国債証券 | 千イスラエル・シケル 2,958 | 千イスラエル・シケル 3,463 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ 5,479 | 千デンマーク・クローネ 6,344 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ 4,973 | 千ノルウェー・クローネ 5,407 |

| | | | 買付額 | 売付額 | |
|--------|--------|---------|-----------------------|-----------------------|---------------|
| 外 | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデン・クローナ 5,442 | 千スウェーデン・クローナ 6,715 | |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ 42,032 | 千メキシコ・ペソ 43,381 | |
| | 中国 | 国債証券 | 千中国・元 124,144 | 千中国・元 80,910 | |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット 5,537 | 千マレーシア・リンギット 6,104 | |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ 4,569 | 千ポーランド・ズロチ 5,252 | |
| | EU | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ 1,400 | 千ユーロ 1,595 |
| | | オランダ | 国債証券 | 3,805 | 4,135 |
| | | ベルギー | 国債証券 | 4,664 | 4,981 |
| | | フランス | 国債証券 | 24,307 | 25,853 |
| | | ドイツ | 国債証券 | 23,854 | 24,314 |
| スペイン | | 国債証券 | 17,823 | 18,826 | |
| イタリア | | 国債証券 | 25,835 | 27,960 | |
| フィンランド | | 国債証券 | 1,360 | 1,438 | |
| オーストリア | | 国債証券 | 3,140 | 3,299 | |
| 国 | ユーロ通貨計 | 106,191 | 112,404 | | |

(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(2022年8月3日から2023年8月2日まで)

公社債

| 当 | | | 期 | | |
|---|------------|---------|---|------------|---------|
| 買 | 付 | 金額 | 売 | 付 | 金額 |
| 銘柄 | 柄 | | 銘柄 | 柄 | |
| | | 千円 | | | 千円 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% | 2029/02/15 | 457,653 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% | 2028/08/15 | 556,090 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% | 2028/08/15 | 407,505 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% | 2029/02/15 | 529,441 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% | 2025/08/15 | 395,125 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% | 2025/08/15 | 457,043 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% | 2025/04/15 | 389,676 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.5% | 2025/02/15 | 401,120 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.5% | 2025/02/15 | 354,619 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.75% | 2024/02/15 | 375,844 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.875% | 2024/01/31 | 347,707 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.875% | 2024/01/31 | 352,920 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.875% | 2032/02/15 | 347,470 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.25% | 2023/09/30 | 340,960 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.75% | 2032/08/15 | 323,351 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% | 2023/11/30 | 326,011 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.75% | 2028/02/25 | 322,565 | SPAIN GOVERNMENT BOND 0% | 2026/01/31 | 325,336 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.25% | 2026/12/31 | 319,148 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% | 2032/05/15 | 311,060 |

(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 | |
| | 千米・ドル | 千米・ドル | 千円 | % | % | % | % | % | |
| ア メ リ カ | 96,591 | 85,866 | 12,298,668 | 47.9 | - | 21.4 | 17.5 | 9.0 | |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 5,175 | 千カナダ・ドル 4,777 | 515,533 | 2.0 | - | 1.1 | 0.6 | 0.4 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 4,403 | 千オーストラリア・ドル 4,021 | 381,226 | 1.5 | - | 1.0 | 0.4 | 0.1 | |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 1,105 | 千シンガポール・ドル 1,071 | 114,867 | 0.4 | - | 0.3 | 0.1 | 0.1 | |
| ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル 777 | 千ニュージーランド・ドル 658 | 57,841 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| イギリス | 千英国・ポンド 7,722 | 千英国・ポンド 6,891 | 1,261,707 | 4.9 | - | 3.6 | 1.0 | 0.3 | |
| イスラエル | 千イスラエル・シケル 2,128 | 千イスラエル・シケル 2,016 | 79,448 | 0.3 | - | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 4,400 | 千デンマーク・クローネ 3,927 | 83,021 | 0.3 | - | 0.2 | 0.0 | 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 3,390 | 千ノルウェー・クローネ 3,069 | 43,163 | 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 3,955 | 千スウェーデン・クローナ 3,689 | 49,953 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 32,700 | 千メキシコ・ペソ 30,456 | 258,534 | 1.0 | - | 0.5 | 0.3 | 0.2 | |
| 中 国 | 千中国・元 76,710 | 千中国・元 78,182 | 1,559,481 | 6.1 | - | 2.7 | 2.5 | 0.9 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 4,165 | 千マレーシア・リンギット 4,308 | 136,332 | 0.5 | - | 0.4 | 0.1 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 3,990 | 千ポーランド・ズロチ 3,624 | 128,263 | 0.5 | - | 0.2 | 0.3 | 0.1 | |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| | アイルランド | 1,110 | 952 | 150,055 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| | オランダ | 2,554 | 2,399 | 377,822 | 1.5 | - | 1.0 | 0.4 | 0.1 |
| | ベルギー | 3,113 | 2,959 | 466,086 | 1.8 | - | 1.2 | 0.6 | 0.0 |
| | フランス | 14,277 | 13,432 | 2,115,331 | 8.2 | - | 5.1 | 2.3 | 0.8 |
| | ドイツ | 11,556 | 10,642 | 1,676,023 | 6.5 | - | 3.4 | 2.2 | 0.9 |
| | スペイン | 8,734 | 8,055 | 1,268,543 | 4.9 | - | 2.9 | 1.4 | 0.6 |
| | イタリア | 12,470 | 12,343 | 1,943,780 | 7.6 | - | 4.4 | 2.5 | 0.7 |
| ロ | フィンランド | 1,051 | 852 | 134,316 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | オーストリア | 2,167 | 1,949 | 307,062 | 1.2 | - | 0.7 | 0.4 | 0.1 |
| 小 計 | 57,032 | 53,587 | 8,439,022 | 32.9 | - | 19.5 | 9.9 | 3.5 | |
| 合 計 | - | - | 25,407,067 | 99.0 | - | 51.2 | 32.9 | 14.8 | |

(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 | 2,565 | 1,799 | 257,686 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.3750 | 2040/11/15 | 1,060 | 683 | 97,890 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.8750 | 2051/11/15 | 620 | 389 | 55,779 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.3750 | 2031/11/15 | 1,675 | 1,361 | 195,067 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2025/05/31 | 1,250 | 1,203 | 172,351 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.6250 | 2053/05/15 | 280 | 257 | 36,852 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.8750 | 2051/02/15 | 655 | 412 | 59,147 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.5000 | 2026/08/15 | 467 | 426 | 61,137 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2025/11/15 | 1,879 | 1,775 | 254,285 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.5000 | 2026/02/28 | 1,000 | 899 | 128,806 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.0000 | 2025/08/15 | 460 | 434 | 62,197 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.5000 | 2046/05/15 | 435 | 320 | 45,959 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.3750 | 2026/01/31 | 930 | 835 | 119,711 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.7500 | 2028/01/31 | 660 | 564 | 80,887 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2027/11/15 | 1,220 | 1,120 | 160,522 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2047/11/15 | 70 | 53 | 7,721 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.3750 | 2025/11/30 | 1,000 | 903 | 129,460 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.6250 | 2040/02/15 | 90 | 95 | 13,632 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.6250 | 2027/05/31 | 200 | 187 | 26,860 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2029/05/31 | 630 | 582 | 83,410 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2027/08/15 | 260 | 239 | 34,334 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2047/08/15 | 272 | 209 | 30,016 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 6.1250 | 2027/11/15 | 1,673 | 1,788 | 256,228 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 5.3750 | 2031/02/15 | 1,720 | 1,860 | 266,477 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.1250 | 2025/05/15 | 580 | 551 | 78,961 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2045/05/15 | 240 | 194 | 27,920 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2025/07/15 | 1,000 | 963 | 138,032 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 6.2500 | 2030/05/15 | 1,485 | 1,665 | 238,552 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.5000 | 2024/11/30 | 200 | 190 | 27,262 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.7500 | 2025/03/15 | 1,000 | 947 | 135,721 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.8750 | 2032/02/15 | 630 | 531 | 76,149 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2052/02/15 | 823 | 566 | 81,207 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.3750 | 2027/09/30 | 1,300 | 1,105 | 158,320 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2046/08/15 | 360 | 251 | 36,091 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2025/10/31 | 1,160 | 1,115 | 159,721 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 5.2500 | 2028/11/15 | 1,620 | 1,692 | 242,428 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.6250 | 2026/10/31 | 930 | 849 | 121,699 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.5000 | 2039/02/15 | 100 | 93 | 13,323 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.7500 | 2041/08/15 | 1,520 | 1,032 | 147,931 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 6.0000 | 2026/02/15 | 250 | 257 | 36,871 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 5.2500 | 2029/02/15 | 790 | 827 | 118,486 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.2500 | 2026/11/30 | 870 | 783 | 112,256 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.5000 | 2028/11/30 | 1,000 | 870 | 124,682 |

| 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 | 0.2500 | 2025/08/31 | 1,300 | 1,181 | 169,266 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.6250 | 2026/07/31 | 500 | 445 | 63,824 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2042/11/15 | 50 | 39 | 5,690 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2046/11/15 | 168 | 132 | 19,021 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.7500 | 2026/05/31 | 500 | 449 | 64,361 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.2500 | 2028/05/31 | 1,520 | 1,320 | 189,194 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.5000 | 2030/01/31 | 595 | 571 | 81,906 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.5000 | 2046/02/15 | 170 | 125 | 17,979 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.6250 | 2030/05/15 | 560 | 444 | 63,703 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2028/02/15 | 1,302 | 1,219 | 174,604 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2048/02/15 | 555 | 448 | 64,187 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2024/08/15 | 450 | 436 | 62,514 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.1250 | 2044/08/15 | 155 | 129 | 18,513 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.6250 | 2025/04/15 | 1,000 | 959 | 137,484 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2049/08/15 | 217 | 150 | 21,564 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2042/02/15 | 280 | 210 | 30,164 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.7500 | 2026/08/31 | 300 | 267 | 38,339 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.1250 | 2028/08/31 | 1,420 | 1,219 | 174,618 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.6250 | 2029/02/15 | 200 | 184 | 26,381 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2049/02/15 | 665 | 538 | 77,072 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2029/04/30 | 900 | 838 | 120,064 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2027/04/30 | 800 | 754 | 108,035 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.5000 | 2027/01/31 | 900 | 814 | 116,665 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.3750 | 2025/01/31 | 580 | 548 | 78,530 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.5000 | 2039/08/15 | 35 | 36 | 5,230 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2045/08/15 | 231 | 183 | 26,255 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2047/02/15 | 200 | 161 | 23,139 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2042/08/15 | 260 | 207 | 29,656 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.6250 | 2050/11/15 | 790 | 467 | 66,900 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.6250 | 2030/08/15 | 1,030 | 812 | 116,390 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2024/10/31 | 650 | 625 | 89,659 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2049/11/15 | 550 | 392 | 56,168 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.1250 | 2040/08/15 | 830 | 513 | 73,613 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.1250 | 2040/05/15 | 520 | 324 | 46,526 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2025/11/30 | 1,660 | 1,590 | 227,824 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2025/05/15 | 1,200 | 1,153 | 165,162 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2032/05/15 | 523 | 477 | 68,375 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2052/05/15 | 260 | 205 | 29,476 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.6250 | 2053/02/15 | 685 | 628 | 90,033 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.5000 | 2033/02/15 | 520 | 497 | 71,279 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2048/08/15 | 900 | 726 | 104,092 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.3750 | 2033/05/15 | 350 | 331 | 47,475 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.1250 | 2027/08/31 | 1,000 | 953 | 136,633 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.1250 | 2025/02/28 | 600 | 563 | 80,734 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2032/08/15 | 700 | 631 | 90,415 |

| 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 | 3.0000 | 2052/08/15 | 835 | 678 | 97,177 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.0000 | 2041/11/15 | 850 | 601 | 86,101 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2025/06/30 | 550 | 527 | 75,579 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.8750 | 2029/09/30 | 500 | 490 | 70,300 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.7500 | 2024/11/15 | 1,150 | 1,085 | 155,442 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.0000 | 2024/12/15 | 600 | 566 | 81,117 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2045/11/15 | 100 | 81 | 11,604 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.8750 | 2024/08/31 | 1,000 | 963 | 137,987 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.6250 | 2026/09/30 | 90 | 82 | 11,800 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.7500 | 2026/04/15 | 770 | 752 | 107,775 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.1250 | 2032/11/15 | 1,480 | 1,487 | 213,007 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.0000 | 2052/11/15 | 290 | 284 | 40,816 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.6250 | 2027/03/31 | 1,200 | 1,047 | 150,015 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.1250 | 2043/02/15 | 90 | 75 | 10,847 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.0000 | 2025/02/15 | 450 | 428 | 61,439 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2029/03/31 | 1,000 | 907 | 129,958 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2027/05/15 | 455 | 422 | 60,554 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2047/05/15 | 315 | 254 | 36,418 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.8750 | 2025/04/30 | 1,000 | 963 | 138,004 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.5000 | 2025/01/31 | 750 | 720 | 103,255 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.6250 | 2031/05/15 | 822 | 690 | 98,833 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2051/05/15 | 880 | 624 | 89,416 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.7500 | 2026/04/30 | 2,580 | 2,324 | 332,955 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.8750 | 2026/09/30 | 680 | 608 | 87,127 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2024/12/31 | 530 | 508 | 72,839 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.3750 | 2024/08/15 | 680 | 645 | 92,515 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 1.2500 | 2031/08/15 | 770 | 623 | 89,285 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.0000 | 2051/08/15 | 685 | 444 | 63,711 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.5000 | 2027/10/31 | 510 | 434 | 62,261 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.0000 | 2029/10/31 | 720 | 711 | 101,953 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 4.1250 | 2027/10/31 | 600 | 594 | 85,179 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.1250 | 2024/11/30 | 400 | 383 | 54,975 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.3750 | 2048/11/15 | 800 | 692 | 99,133 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.3750 | 2029/05/15 | 315 | 285 | 40,885 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.3750 | 2025/04/30 | 280 | 258 | 36,993 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.5000 | 2027/04/30 | 427 | 369 | 52,976 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.0000 | 2044/11/15 | 168 | 136 | 19,610 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2024/11/15 | 1,050 | 1,010 | 144,663 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.6250 | 2027/12/31 | 900 | 767 | 109,948 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 3.8750 | 2029/11/30 | 410 | 402 | 57,664 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.2500 | 2041/05/15 | 590 | 438 | 62,874 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.1250 | 2026/05/31 | 239 | 223 | 32,005 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 5.0000 | 2037/05/15 | 300 | 331 | 47,428 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.6250 | 2029/07/31 | 700 | 641 | 91,907 |
| UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 2.7500 | 2027/07/31 | 1,570 | 1,476 | 211,536 |
| 小 計 | - | - | 96,591 | 85,866 | 12,298,668 |

| 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 | 1.0000 | 2026/09/01 | 145 | 131 | 14,178 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2028/09/01 | 130 | 126 | 13,601 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2030/12/01 | 470 | 374 | 40,368 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.5000 | 2045/12/01 | 85 | 84 | 9,162 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 5.7500 | 2033/06/01 | 361 | 423 | 45,702 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2027/03/01 | 165 | 149 | 16,077 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 5.7500 | 2029/06/01 | 130 | 143 | 15,482 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2024/11/01 | 539 | 525 | 56,702 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2055/12/01 | 45 | 39 | 4,216 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2025/09/01 | 340 | 312 | 33,672 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2025/10/01 | 60 | 57 | 6,254 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2025/04/01 | 130 | 123 | 13,272 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2051/12/01 | 250 | 185 | 19,985 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.5000 | 2028/03/01 | 170 | 166 | 17,971 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2031/12/01 | 90 | 76 | 8,210 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2048/12/01 | 166 | 146 | 15,784 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2024/08/01 | 150 | 146 | 15,811 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2032/06/01 | 290 | 254 | 27,411 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2025/05/01 | 130 | 127 | 13,772 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2064/12/01 | 289 | 246 | 26,571 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2031/06/01 | 110 | 93 | 10,113 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 4.0000 | 2041/06/01 | 70 | 74 | 7,990 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2027/09/01 | 250 | 237 | 25,636 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2026/03/01 | 300 | 269 | 29,073 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2030/06/01 | 310 | 264 | 28,509 |
| 小 計 | - | - | 5,175 | 4,777 | 515,533 |
| (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 | 150 | 156 | 14,830 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2047/03/21 | 151 | 121 | 11,553 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2035/06/21 | 122 | 107 | 10,175 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2051/06/21 | 110 | 64 | 6,125 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2039/06/21 | 130 | 115 | 10,983 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2029/04/21 | 83 | 80 | 7,652 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2030/05/21 | 143 | 131 | 12,472 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2041/05/21 | 70 | 56 | 5,395 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/11/21 | 300 | 282 | 26,750 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2032/11/21 | 280 | 232 | 22,009 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 4.7500 | 2027/04/21 | 360 | 372 | 35,328 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2028/11/21 | 150 | 142 | 13,549 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2027/11/21 | 320 | 307 | 29,172 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2032/05/21 | 20 | 16 | 1,518 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2030/12/21 | 340 | 277 | 26,313 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 4.2500 | 2026/04/21 | 395 | 399 | 37,908 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2031/06/21 | 70 | 58 | 5,559 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2031/11/21 | 451 | 358 | 33,959 |

| 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 |
| (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 | 千円 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2037/04/21 | 468 | 450 | 42,728 |
| AUSTRALIA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2024/04/21 | 290 | 287 | 27,238 |
| 小 計 | - | - | 4,403 | 4,021 | 381,226 |
| (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 | 3.3750 | 2033/09/01 | 60 | 61 | 6,620 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.6250 | 2032/08/01 | 50 | 48 | 5,193 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2072/08/01 | 27 | 30 | 3,274 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 1.6250 | 2031/07/01 | 90 | 81 | 8,714 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.6250 | 2028/05/01 | 70 | 68 | 7,390 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 1.8750 | 2051/10/01 | 40 | 34 | 3,710 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2046/03/01 | 60 | 60 | 6,485 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.8750 | 2030/09/01 | 45 | 44 | 4,792 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2024/09/01 | 37 | 36 | 3,942 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.8750 | 2029/07/01 | 90 | 89 | 9,586 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.3750 | 2039/07/01 | 85 | 79 | 8,542 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.2500 | 2036/08/01 | 65 | 60 | 6,437 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.1250 | 2026/06/01 | 135 | 130 | 14,009 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 2.3750 | 2025/06/01 | 116 | 113 | 12,196 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 1.8750 | 2050/03/01 | 40 | 34 | 3,663 |
| SINGAPORE GOVERNMENT BOND | 3.5000 | 2027/03/01 | 95 | 96 | 10,307 |
| 小 計 | - | - | 1,105 | 1,071 | 114,867 |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2031/05/15 | 10 | 7 | 696 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2024/05/15 | 119 | 114 | 10,041 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2041/05/15 | 125 | 78 | 6,864 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 4.5000 | 2027/04/15 | 90 | 88 | 7,804 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2037/04/15 | 110 | 87 | 7,642 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2026/05/15 | 25 | 22 | 1,941 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2028/05/15 | 70 | 56 | 4,976 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 4.5000 | 2030/05/15 | 60 | 59 | 5,204 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2051/05/15 | 38 | 25 | 2,262 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 3.5000 | 2033/04/14 | 50 | 45 | 3,979 |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2029/04/20 | 80 | 73 | 6,428 |
| 小 計 | - | - | 777 | 658 | 57,841 |
| (イギリス) | | | 千英国・ポンド | 千英国・ポンド | |
| UNITED KINGDOM GILT | 1.7500 | 2037/09/07 | 160 | 113 | 20,870 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.7500 | 2038/01/29 | 455 | 415 | 76,091 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.5000 | 2045/01/22 | 296 | 252 | 46,174 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2040/12/07 | 290 | 279 | 51,112 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.2500 | 2033/01/31 | 230 | 209 | 38,392 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2046/12/07 | 361 | 343 | 62,969 |
| UNITED KINGDOM GILT | 0.3750 | 2030/10/22 | 115 | 87 | 15,932 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.0000 | 2063/10/22 | 125 | 115 | 21,187 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.1250 | 2027/01/29 | 635 | 618 | 113,230 |
| UNITED KINGDOM GILT | 1.6250 | 2071/10/22 | 124 | 58 | 10,747 |

| 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 | 4.7500 | 2030/12/07 | 230 | 235 | 43,176 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.5000 | 2025/10/22 | 555 | 534 | 97,826 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.7500 | 2053/10/22 | 52 | 45 | 8,316 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2039/09/07 | 570 | 549 | 100,604 |
| UNITED KINGDOM GILT | 0.2500 | 2025/01/31 | 458 | 426 | 78,049 |
| UNITED KINGDOM GILT | 0.5000 | 2029/01/31 | 417 | 335 | 61,466 |
| UNITED KINGDOM GILT | 2.5000 | 2065/07/22 | 170 | 110 | 20,207 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.7500 | 2052/07/22 | 49 | 43 | 7,875 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2027/12/07 | 255 | 250 | 45,935 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.5000 | 2068/07/22 | 371 | 310 | 56,874 |
| UNITED KINGDOM GILT | 0.2500 | 2031/07/31 | 280 | 203 | 37,257 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2049/12/07 | 599 | 571 | 104,673 |
| UNITED KINGDOM GILT | 4.2500 | 2055/12/07 | 330 | 317 | 58,219 |
| UNITED KINGDOM GILT | 1.0000 | 2032/01/31 | 475 | 362 | 66,385 |
| UNITED KINGDOM GILT | 3.2500 | 2044/01/22 | 120 | 99 | 18,129 |
| 小 計 | - | - | 7,722 | 6,891 | 1,261,707 |
| (イスラエル) | | | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 1.0000 | 2030/03/31 | 255 | 213 | 8,420 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 1.3000 | 2032/04/30 | 100 | 81 | 3,215 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 1.5000 | 2037/05/31 | 170 | 125 | 4,958 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 5.5000 | 2042/01/31 | 200 | 241 | 9,516 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 0.5000 | 2026/02/27 | 290 | 265 | 10,462 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 6.2500 | 2026/10/30 | 190 | 212 | 8,352 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 2.0000 | 2027/03/31 | 280 | 264 | 10,400 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 0.4000 | 2024/10/31 | 265 | 253 | 9,971 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 3.7500 | 2047/03/31 | 228 | 217 | 8,563 |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED | 2.2500 | 2028/09/28 | 150 | 141 | 5,586 |
| 小 計 | - | - | 2,128 | 2,016 | 79,448 |
| (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 | 0.5000 | 2029/11/15 | 700 | 611 | 12,932 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2052/11/15 | 660 | 329 | 6,965 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2027/11/15 | 200 | 181 | 3,842 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2024/11/15 | 970 | 929 | 19,656 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2031/11/15 | 780 | 624 | 13,200 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 4.5000 | 2039/11/15 | 820 | 987 | 20,886 |
| DENMARK GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2025/11/15 | 270 | 261 | 5,537 |
| 小 計 | - | - | 4,400 | 3,927 | 83,021 |
| (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 | 290 | 236 | 3,328 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2025/03/13 | 450 | 432 | 6,081 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2026/02/19 | 660 | 616 | 8,674 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2033/08/15 | 370 | 343 | 4,823 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 2.1250 | 2032/05/18 | 380 | 330 | 4,645 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 1.3750 | 2030/08/19 | 135 | 113 | 1,601 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2028/04/26 | 705 | 643 | 9,051 |

| 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 |
| (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 | 千円 |
| NORWAY GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2029/09/06 | 400 | 352 | 4,956 |
| 小 計 | - | - | 3,390 | 3,069 | 43,163 |
| (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 | 500 | 446 | 6,043 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 0.1250 | 2031/05/12 | 700 | 579 | 7,848 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 0.7500 | 2028/05/12 | 530 | 484 | 6,553 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 3.5000 | 2039/03/30 | 315 | 348 | 4,719 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2026/11/12 | 630 | 591 | 8,014 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 2.2500 | 2032/06/01 | 320 | 312 | 4,229 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2033/11/11 | 350 | 325 | 4,404 |
| SWEDEN GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2025/05/12 | 610 | 601 | 8,141 |
| 小 計 | - | - | 3,955 | 3,689 | 49,953 |
| (メキシコ) | | | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | |
| MEXICAN BONOS | 7.7500 | 2034/11/23 | 1,300 | 1,202 | 10,206 |
| MEXICAN BONOS | 7.7500 | 2042/11/13 | 3,400 | 3,034 | 25,758 |
| MEXICAN BONOS | 8.0000 | 2047/11/07 | 2,300 | 2,096 | 17,793 |
| MEXICAN BONOS | 7.7500 | 2031/05/29 | 3,300 | 3,095 | 26,279 |
| MEXICAN BONOS | 10.0000 | 2036/11/20 | 600 | 656 | 5,574 |
| MEXICAN BONOS | 8.0000 | 2024/09/05 | 2,100 | 2,036 | 17,285 |
| MEXICAN BONOS | 5.0000 | 2025/03/06 | 800 | 739 | 6,280 |
| MEXICAN BONOS | 8.5000 | 2029/05/31 | 2,300 | 2,263 | 19,215 |
| MEXICAN BONOS | 5.7500 | 2026/03/05 | 3,500 | 3,190 | 27,084 |
| MEXICAN BONOS | 8.5000 | 2038/11/18 | 1,200 | 1,162 | 9,864 |
| MEXICAN BONOS | 8.0000 | 2053/07/31 | 1,000 | 903 | 7,670 |
| MEXICAN BONOS | 5.5000 | 2027/03/04 | 5,700 | 5,029 | 42,692 |
| MEXICAN BONOS | 10.0000 | 2024/12/05 | 3,600 | 3,583 | 30,416 |
| MEXICAN BONOS | 7.5000 | 2033/05/26 | 1,600 | 1,462 | 12,411 |
| 小 計 | - | - | 32,700 | 30,456 | 258,534 |
| (中国) | | | 千中国・元 | 千中国・元 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 4.0800 | 2048/10/22 | 1,250 | 1,473 | 29,387 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7600 | 2032/05/15 | 1,400 | 1,406 | 28,055 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/06/15 | 3,400 | 3,434 | 68,513 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6900 | 2032/08/15 | 1,100 | 1,098 | 21,919 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.8100 | 2050/09/14 | 1,290 | 1,471 | 29,344 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4400 | 2027/10/15 | 4,000 | 4,006 | 79,911 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.9900 | 2025/04/09 | 5,550 | 5,540 | 110,515 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6400 | 2028/01/15 | 3,100 | 3,122 | 62,291 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4600 | 2026/02/15 | 3,400 | 3,417 | 68,171 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6800 | 2030/05/21 | 2,400 | 2,405 | 47,979 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2032/02/17 | 1,950 | 1,958 | 39,059 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.3900 | 2050/03/16 | 1,870 | 1,986 | 39,629 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2032/11/15 | 1,800 | 1,811 | 36,142 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.5300 | 2051/10/18 | 800 | 871 | 17,390 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.9900 | 2024/09/15 | 2,000 | 1,999 | 39,891 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8900 | 2031/11/18 | 800 | 813 | 16,218 |

| 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 | 3.0100 | 2028/05/13 | 1,700 | 1,745 | 34,826 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0200 | 2031/05/27 | 3,300 | 3,393 | 67,693 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2029/03/24 | 3,600 | 3,651 | 72,830 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.1800 | 2025/08/25 | 1,400 | 1,400 | 27,925 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2800 | 2025/11/25 | 6,900 | 6,909 | 137,813 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1200 | 2052/10/25 | 700 | 709 | 14,150 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0200 | 2025/10/22 | 4,500 | 4,594 | 91,639 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2032/09/01 | 500 | 495 | 9,889 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7900 | 2029/12/15 | 4,100 | 4,136 | 82,503 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.3200 | 2052/04/15 | 850 | 893 | 17,827 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4800 | 2027/04/15 | 3,750 | 3,769 | 75,193 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.7200 | 2051/04/12 | 1,100 | 1,238 | 24,710 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2600 | 2025/02/24 | 4,300 | 4,309 | 85,952 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8500 | 2027/06/04 | 2,800 | 2,854 | 56,946 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.8600 | 2049/07/22 | 1,100 | 1,261 | 25,156 |
| 小 計 | - | - | 76,710 | 78,182 | 1,559,481 |
| (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 | 170 | 183 | 5,796 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 5.2480 | 2028/09/15 | 165 | 177 | 5,604 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.9550 | 2025/09/15 | 150 | 151 | 4,798 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.2320 | 2031/06/30 | 100 | 102 | 3,250 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 2.6320 | 2031/04/15 | 350 | 321 | 10,171 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.5020 | 2027/05/31 | 390 | 388 | 12,286 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.7570 | 2040/05/22 | 120 | 115 | 3,656 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.9210 | 2048/07/06 | 490 | 540 | 17,096 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.4980 | 2030/04/15 | 530 | 552 | 17,488 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.2540 | 2035/05/31 | 240 | 246 | 7,800 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.8930 | 2038/06/08 | 600 | 659 | 20,871 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.8440 | 2033/04/15 | 140 | 139 | 4,427 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.8820 | 2025/03/14 | 300 | 302 | 9,572 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 3.8920 | 2027/03/15 | 270 | 273 | 8,653 |
| MALAYSIA GOVERNMENT BOND | 4.3920 | 2026/04/15 | 150 | 153 | 4,858 |
| 小 計 | - | - | 4,165 | 4,308 | 136,332 |
| (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 | 170 | 127 | 4,508 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2027/05/25 | 600 | 567 | 20,100 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 2.2500 | 2024/10/25 | 215 | 206 | 7,304 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2024/07/25 | 110 | 104 | 3,691 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2025/07/25 | 165 | 158 | 5,608 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/10/25 | 795 | 690 | 24,450 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2026/10/25 | 110 | 93 | 3,320 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2027/07/25 | 410 | 369 | 13,075 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2030/10/25 | 170 | 129 | 4,588 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2026/07/25 | 635 | 586 | 20,758 |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND | 5.7500 | 2029/04/25 | 340 | 347 | 12,290 |

| 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 | 2.7500 | 2028/04/25 | 270 | 242 | 8,564 |
| 小 計 | - | - | 3,990 | 3,624 | 128,263 |
| (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 | 25 | 22 | 3,552 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2000 | 2030/10/18 | 168 | 138 | 21,813 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2031/10/18 | 65 | 51 | 8,087 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.5500 | 2041/04/22 | 25 | 15 | 2,480 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 3.4000 | 2024/03/18 | 40 | 40 | 6,300 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2045/02/18 | 121 | 95 | 15,041 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.7000 | 2037/05/15 | 85 | 70 | 11,079 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.9000 | 2028/05/15 | 110 | 100 | 15,815 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.3000 | 2033/05/15 | 135 | 115 | 18,223 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.1000 | 2029/05/15 | 90 | 81 | 12,855 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2050/05/15 | 93 | 62 | 9,882 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 5.4000 | 2025/03/13 | 153 | 158 | 24,925 |
| (ユーロ・・・オランダ) | | | | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2052/01/15 | 133 | 60 | 9,529 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2029/01/15 | 220 | 189 | 29,802 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2047/01/15 | 160 | 156 | 24,601 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2033/01/15 | 280 | 272 | 42,874 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2024/07/15 | 130 | 128 | 20,200 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2026/01/15 | 185 | 171 | 27,069 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 5.5000 | 2028/01/15 | 105 | 116 | 18,335 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2054/01/15 | 70 | 57 | 9,056 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2042/01/15 | 262 | 291 | 45,839 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2032/07/15 | 25 | 20 | 3,219 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2027/01/15 | 335 | 303 | 47,815 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 4.0000 | 2037/01/15 | 289 | 321 | 50,656 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2030/07/15 | 45 | 37 | 5,854 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2030/01/15 | 70 | 68 | 10,813 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2031/07/15 | 120 | 96 | 15,176 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2029/07/15 | 125 | 107 | 16,978 |
| (ユーロ・・・ベルギー) | | | | | |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2045/06/22 | 150 | 155 | 24,431 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 5.0000 | 2035/03/28 | 423 | 490 | 77,294 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 2.2500 | 2057/06/22 | 112 | 83 | 13,201 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2031/06/22 | 40 | 34 | 5,407 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 1.4000 | 2053/06/22 | 195 | 118 | 18,655 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2026/06/22 | 240 | 226 | 35,679 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 0.1000 | 2030/06/22 | 145 | 119 | 18,818 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 0.9000 | 2029/06/22 | 169 | 150 | 23,746 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 0.3500 | 2032/06/22 | 90 | 70 | 11,166 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 1.7000 | 2050/06/22 | 44 | 29 | 4,722 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 4.5000 | 2026/03/28 | 140 | 144 | 22,811 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 4.0000 | 2032/03/28 | 240 | 256 | 40,331 |

| 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 | 0.8000 | 2027/06/22 | 190 | 174 | 27,557 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 4.2500 | 2041/03/28 | 260 | 286 | 45,085 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 0.8000 | 2025/06/22 | 20 | 19 | 3,011 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 3.3000 | 2054/06/22 | 105 | 98 | 15,545 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2027/10/22 | 420 | 371 | 58,486 |
| KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2033/06/22 | 130 | 127 | 20,134 |
| (ユーロ・・・フランス) | | | | | |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 5.5000 | 2029/04/25 | 1,340 | 1,518 | 239,175 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 3.5000 | 2026/04/25 | 1,221 | 1,233 | 194,327 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 3.0000 | 2033/05/25 | 770 | 764 | 120,351 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 6.0000 | 2025/10/25 | 147 | 155 | 24,530 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 4.5000 | 2041/04/25 | 375 | 429 | 67,572 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 2.5000 | 2026/09/24 | 1,310 | 1,288 | 202,973 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 4.0000 | 2060/04/25 | 358 | 394 | 62,056 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 5.7500 | 2032/10/25 | 78 | 94 | 14,922 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 3.0000 | 2054/05/25 | 70 | 63 | 9,946 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.7500 | 2053/05/25 | 742 | 372 | 58,654 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.0000 | 2025/02/25 | 360 | 342 | 53,881 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 1.7500 | 2024/11/25 | 160 | 156 | 24,672 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 2.2500 | 2024/05/25 | 175 | 173 | 27,272 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 4.0000 | 2055/04/25 | 255 | 278 | 43,877 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.0000 | 2031/11/25 | 710 | 556 | 87,635 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.0000 | 2030/11/25 | 1,005 | 813 | 128,129 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 4.7500 | 2035/04/25 | 1,000 | 1,147 | 180,727 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.0000 | 2029/11/25 | 970 | 810 | 127,561 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 1.2500 | 2038/05/25 | 20 | 15 | 2,379 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.5000 | 2025/05/25 | 415 | 395 | 62,224 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 2.5000 | 2043/05/25 | 620 | 535 | 84,395 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.7500 | 2028/02/25 | 1,196 | 1,085 | 171,000 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 0.0000 | 2025/03/25 | 330 | 312 | 49,279 |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT | 2.0000 | 2048/05/25 | 650 | 493 | 77,782 |
| (ユーロ・・・ドイツ) | | | | | |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 6.2500 | 2030/01/04 | 170 | 207 | 32,634 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2031/08/15 | 713 | 586 | 92,283 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 5.6250 | 2028/01/04 | 440 | 494 | 77,941 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.8000 | 2025/06/12 | 890 | 884 | 139,356 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2036/05/15 | 283 | 202 | 31,921 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.2000 | 2024/06/14 | 140 | 136 | 21,444 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 5.5000 | 2031/01/04 | 325 | 389 | 61,414 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.5000 | 2046/08/15 | 107 | 104 | 16,439 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2035/05/15 | 552 | 407 | 64,214 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2026/04/10 | 820 | 760 | 119,697 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 6.5000 | 2027/07/04 | 160 | 182 | 28,722 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 3.2500 | 2042/07/04 | 148 | 159 | 25,183 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.2000 | 2028/04/13 | 750 | 736 | 116,019 |

| 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 | 2.5000 | 2044/07/04 | 620 | 603 | 94,966 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.4000 | 2028/10/19 | 350 | 346 | 54,641 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.2000 | 2024/12/12 | 10 | 9 | 1,552 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 4.2500 | 2039/07/04 | 234 | 280 | 44,133 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2026/10/09 | 1,000 | 916 | 144,315 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2027/04/16 | 150 | 136 | 21,421 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2030/02/15 | 120 | 102 | 16,091 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2024/10/18 | 500 | 480 | 75,660 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 1.7000 | 2032/08/15 | 300 | 280 | 44,211 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.1000 | 2029/11/15 | 335 | 326 | 51,436 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 2.3000 | 2033/02/15 | 520 | 510 | 80,341 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 1.8000 | 2053/08/15 | 100 | 82 | 13,040 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2029/08/15 | 260 | 223 | 35,255 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 1.3000 | 2027/10/15 | 355 | 336 | 52,975 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 4.0000 | 2037/01/04 | 100 | 114 | 18,085 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 1.0000 | 2038/05/15 | 90 | 71 | 11,270 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2050/08/15 | 788 | 397 | 62,526 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 4.7500 | 2040/07/04 | 78 | 99 | 15,668 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE | 0.0000 | 2052/08/15 | 148 | 70 | 11,154 |
| (ユーロ・・・スペイン) | | | | | |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 3.5500 | 2033/10/31 | 400 | 399 | 62,854 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 3.4500 | 2043/07/30 | 250 | 231 | 36,498 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2026/05/31 | 950 | 936 | 147,422 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2028/01/31 | 790 | 683 | 107,704 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 2.5500 | 2032/10/31 | 55 | 51 | 8,034 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 3.9000 | 2039/07/30 | 570 | 569 | 89,730 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 4.7000 | 2041/07/30 | 40 | 44 | 6,945 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 1.9000 | 2052/10/31 | 430 | 273 | 43,148 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2025/05/31 | 1,020 | 958 | 150,955 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 3.1500 | 2033/04/30 | 351 | 340 | 53,617 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 0.8000 | 2029/07/30 | 278 | 240 | 37,919 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 3.4500 | 2066/07/30 | 214 | 187 | 29,472 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 4.2000 | 2037/01/31 | 230 | 240 | 37,930 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2031/10/31 | 810 | 643 | 101,264 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2027/01/31 | 775 | 692 | 109,012 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 5.1500 | 2028/10/31 | 549 | 598 | 94,174 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2030/10/31 | 360 | 312 | 49,150 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 5.1500 | 2044/10/31 | 182 | 212 | 33,518 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND | 1.9500 | 2030/07/30 | 480 | 439 | 69,189 |
| (ユーロ・・・イタリア) | | | | | |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.8500 | 2049/09/01 | 449 | 407 | 64,210 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.7000 | 2030/06/15 | 455 | 450 | 70,993 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.8000 | 2026/04/15 | 520 | 522 | 82,323 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 4.0000 | 2031/10/30 | 350 | 351 | 55,400 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 5.0000 | 2034/08/01 | 920 | 983 | 154,951 |

| 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 | 2.8000 | 2029/06/15 | 588 | 559 | 88,073 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 4.7500 | 2044/09/01 | 676 | 700 | 110,247 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 5.7500 | 2033/02/01 | 803 | 907 | 142,910 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 4.5000 | 2053/10/01 | 60 | 59 | 9,342 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 5.0000 | 2040/09/01 | 235 | 251 | 39,572 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 1.1000 | 2027/04/01 | 530 | 485 | 76,441 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.4000 | 2025/03/28 | 1,110 | 1,105 | 174,066 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 2.6500 | 2027/12/01 | 300 | 288 | 45,420 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 1.6500 | 2030/12/01 | 345 | 296 | 46,712 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 2.1000 | 2026/07/15 | 690 | 661 | 104,228 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 0.9500 | 2030/08/01 | 320 | 263 | 41,574 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 5.0000 | 2039/08/01 | 283 | 301 | 47,555 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.2500 | 2038/03/01 | 163 | 143 | 22,560 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.3500 | 2035/03/01 | 390 | 358 | 56,419 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.4000 | 2028/04/01 | 495 | 489 | 77,145 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 2.8000 | 2067/03/01 | 118 | 81 | 12,821 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.8000 | 2028/08/01 | 500 | 502 | 79,143 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.5000 | 2026/01/15 | 1,090 | 1,088 | 171,344 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 4.4500 | 2043/09/01 | 160 | 158 | 25,019 |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO | 3.8500 | 2029/12/15 | 920 | 922 | 145,301 |
| (ユーロ・・・フィンランド) | | | | | |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 1.3750 | 2027/04/15 | 65 | 61 | 9,653 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2043/04/15 | 185 | 111 | 17,506 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2030/09/15 | 20 | 16 | 2,551 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2028/09/15 | 120 | 106 | 16,696 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2024/04/15 | 70 | 69 | 10,907 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.1250 | 2036/04/15 | 40 | 27 | 4,271 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2038/04/15 | 30 | 28 | 4,417 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2024/09/15 | 100 | 96 | 15,152 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 1.1250 | 2034/04/15 | 100 | 81 | 12,873 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.1250 | 2031/09/15 | 90 | 71 | 11,234 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2029/09/15 | 50 | 43 | 6,795 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.8750 | 2025/09/15 | 88 | 83 | 13,204 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2033/09/15 | 30 | 29 | 4,673 |
| FINLAND GOVERNMENT BOND | 0.1250 | 2052/04/15 | 63 | 27 | 4,376 |
| (ユーロ・・・オーストリア) | | | | | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 4.1500 | 2037/03/15 | 221 | 241 | 38,030 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2025/04/20 | 240 | 226 | 35,743 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 6.2500 | 2027/07/15 | 90 | 100 | 15,839 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.7500 | 2026/10/20 | 240 | 223 | 35,193 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2047/02/20 | 175 | 124 | 19,564 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2028/10/20 | 218 | 186 | 29,378 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 3.8000 | 2062/01/26 | 57 | 63 | 9,936 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 2.1000 | 2117/09/20 | 136 | 94 | 14,882 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.7500 | 2028/02/20 | 85 | 76 | 12,121 |

| 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・・・オーストリア) | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.9000 | 2032/02/20 | 240 | 200 | 31,591 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.5000 | 2027/04/20 | 245 | 223 | 35,221 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 2.9000 | 2033/02/20 | 80 | 78 | 12,324 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 1.8500 | 2049/05/23 | 80 | 60 | 9,484 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2030/02/20 | 60 | 49 | 7,750 |
| 小 計 | - | - | 57,032 | 53,587 | 8,439,022 |
| 合 計 | - | - | - | - | 25,407,067 |

(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

2023年8月2日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 25,407,067 | % 89.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,839,514 | 10.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 28,246,581 | 100.0 |

(注1) 当期末における外貨建資産(25,699,185千円)の投資信託財産総額(28,246,581千円)に対する比率は、91.0%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=143.23円、1カナダ・ドル=107.90円、1オーストラリア・ドル=94.80円、1シンガポール・ドル=107.24円、1ニュージーランド・ドル=87.83円、1英国・ポンド=183.09円、1イスラエル・シケル=39.39円、1デンマーク・クローネ=21.14円、1ノルウェー・クローネ=14.06円、1スウェーデン・クローナ=13.54円、1メキシコ・ペソ=8.48円、1中国・元=19.94円、1マレーシア・リンギット=31.64円、1ポーランド・ズロチ=35.38円、1ユーロ=157.48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

2023年8月2日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 28,293,027,767円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,599,215,224 |
| 公 社 債(評価額) | 25,407,067,284 |
| 未 収 入 金 | 94,128,302 |
| 未 収 利 息 | 163,003,108 |
| 前 払 費 用 | 29,613,849 |
| (B) 負 債 | 2,634,967,203 |
| 未 払 金 | 46,672,938 |
| 未 払 解 約 金 | 2,588,294,265 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 25,658,060,564 |
| 元 本 | 17,841,895,622 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 7,816,164,942 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 17,841,895,622口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 14,381円 |

<注記事項>

| | |
|-----------|-----------------|
| 期首元本額 | 19,658,308,197円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,728,403,526円 |
| 期中一部解約元本額 | 26,544,816,101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) | 2,052,905,320円 |
| シェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド | 494,478,274円 |
| 外国債券インデックス・ファンドV A(適格機関投資家限定) | 2,054,919円 |
| ブラックロック・インデックス投資戦略ファンド | 278,763,911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) | 2,927,793,933円 |
| ブラックロックLifePathファンド2055 | 225,723,564円 |
| ブラックロックLifePathファンド2045 | 297,035,519円 |
| ブラックロックLifePathファンド2035 | 574,301,416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 | 2,518,372,061円 |
| ブラックロックLifePathファンド2030 | 510,334,315円 |
| ブラックロックLifePathファンド2040 | 410,510,199円 |
| ブラックロックLifePathファンド2050 | 173,453,372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) | 6,171,318,031円 |
| ブラックロックLifePathファンド2025 | 195,788,786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) | 865,406,807円 |
| ブラックロックLifePathファンド2060 | 47,636,278円 |
| ブラックロックLifePathファンド2065 | 96,018,917円 |
| 合計 | 17,841,895,622円 |

■損益の状況

自2022年8月3日 至2023年8月2日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 929,736,558円 |
| 受 取 利 息 | 929,744,632 |
| そ の 他 収 益 金 | 6,777 |
| 支 払 利 息 | △ 14,851 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 34,124,747 |
| 売 買 益 | 3,415,318,435 |
| 売 買 損 | △3,449,443,182 |
| (C) そ の 他 費 用 | △ 6,967,474 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 888,644,337 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 7,393,598,344 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △9,822,217,678 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 9,356,139,939 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 7,816,164,942 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 7,816,164,942 |

(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。