

○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	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 日本を除く世界の主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券に投資し、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 外貨建資産およびマザーファンド受益証券組入れに伴う実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行います。 	
主要運用対象	ベビーフンド	外国債券インデックス・マザー・ファンド受益証券
	マザーファンド	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
組入制限	ベビーフンド	<ul style="list-style-type: none"> マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 公社債への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 公社債への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等全額とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

ステート・ストリート 先進国債券インデックス・ オープン(為替ヘッジあり)

第7期運用報告書(全体版)
(決算日2023年2月20日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)」は、2023年2月20日に第7期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間(営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎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、円ヘッジベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
3期('19年 2月20日)	9,831	0	1.5	9,962	1.9	99.9	-	8,172
4期('20年 2月20日)	10,461	0	6.4	10,639	6.8	100.0	-	10,771
5期('21年 2月22日)	10,553	0	0.9	10,789	1.4	100.5	-	9,380
6期('22年 2月21日)	10,108	0	△ 4.2	10,371	△ 3.9	100.0	-	13,679
7期('23年 2月20日)	8,715	0	△13.8	8,966	△13.6	101.5	-	14,329

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営される債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

(注2) 先物比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

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、円ヘッジベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
'22年 2月21日	10,108	-	10,371	-	100.0	-
2月末	10,079	△ 0.3	10,339	△ 0.3	99.1	-
3月末	9,811	△ 2.9	10,065	△ 3.0	104.7	-
4月末	9,593	△ 5.1	9,845	△ 5.1	101.0	-
5月末	9,493	△ 6.1	9,741	△ 6.1	100.1	-
6月末	9,232	△ 8.7	9,478	△ 8.6	105.1	-
7月末	9,500	△ 6.0	9,762	△ 5.9	96.7	-
8月末	9,175	△ 9.2	9,418	△ 9.2	100.1	-
9月末	8,783	△13.1	9,024	△13.0	102.5	-
10月末	8,764	△13.3	9,006	△13.2	102.8	-
11月末	8,893	△12.0	9,137	△11.9	95.5	-
12月末	8,723	△13.7	8,959	△13.6	96.3	-
'23年 1月末	8,854	△12.4	9,103	△12.2	97.7	-
(期末)						
'23年 2月20日	8,715	△13.8	8,966	△13.6	101.5	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営される債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

当期の運用実績

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)で、前期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化したものです。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第7期	10,108円	8,715円	0円	-13.8%	-13.6%

当期末の基準価額は8,715円となり、前期末の10,108円に比べて1,393円の下落となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-13.8%となり、ベンチマークの騰落率(-13.6%)を0.2%下回りました。主な要因は、以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、見送りとしております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

投資環境

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、インフレ圧力の長期化に対する懸念が高まり債券が大きく売られました。米国10年債利回りは前期末の1.93%から3.81%へ上昇しました。

米国10年国債利回りの推移

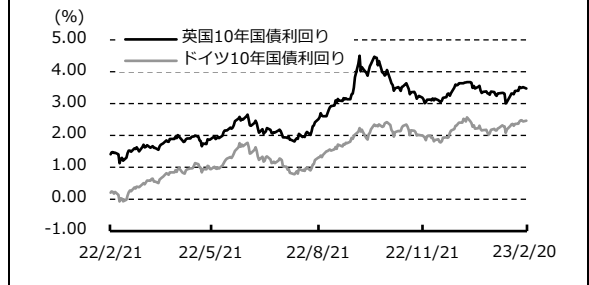


欧州債券市場

欧州債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

インフレ上昇に対する懸念や欧州中央銀行(ECB)による大幅な利上げを背景にドイツ国債が大きく売られました。独10年債利回りは前期末の0.21%から上昇し2.46%で期末を迎えました。英国債券市場は、9月、新政権誕生後に発表された大規模経済政策案を受けて財政悪化懸念が高まり債券が大きく売られました。英10年債利回りは前期末の1.41%から上昇し3.47%となりました。

英独10年国債利回りの推移

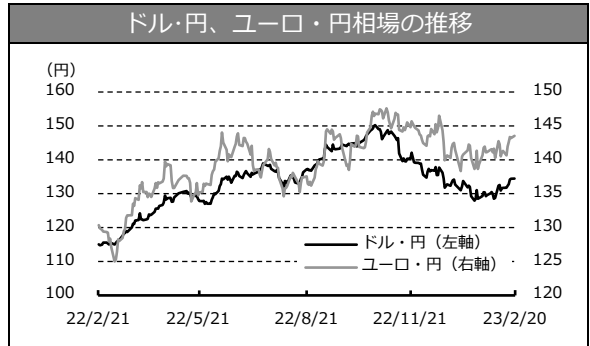


為替市況

ドル・円相場は、円安ドル高となりました。

米連邦準備理事会(FRB)が積極的な金融引き締め
の継続姿勢を示す一方、日銀は現行の金融緩和政策方針
を維持していることから、日米の金融政策方針の違い
と金利差の拡大を背景に円安ドル高が進みました。前
期末に115円台であった米ドル・円は134円台への円
安ドル高となりました。

ユーロ・円相場は、ECBによる継続的な利上げが日
本との金利差拡大につながりユーロが対円で上昇しま
した。前期末に130円台であったユーロ・円は143円台への円安ユーロ高となり当期末を迎えました。



運用の概況

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

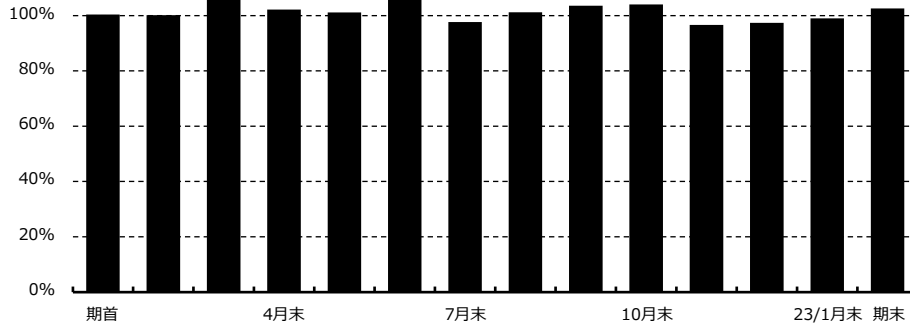
当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象とし、実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

マザーファンドは、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とし、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

マザーファンドの組入状況

当期も、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。

マザーファンド組入比率の推移



今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、主として日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等に投資するとともに、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことで、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年2月22日~2023年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,241円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	20円	0.219%	(a)信託報酬 = 期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投 信 会 社)	(16)	(0.176)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(1)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	4	0.048	(b)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)	(3)	(0.037)	・ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び 資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.011)	・ 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)	(0.000)	・ その他は、LEI支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	24円	0.267%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

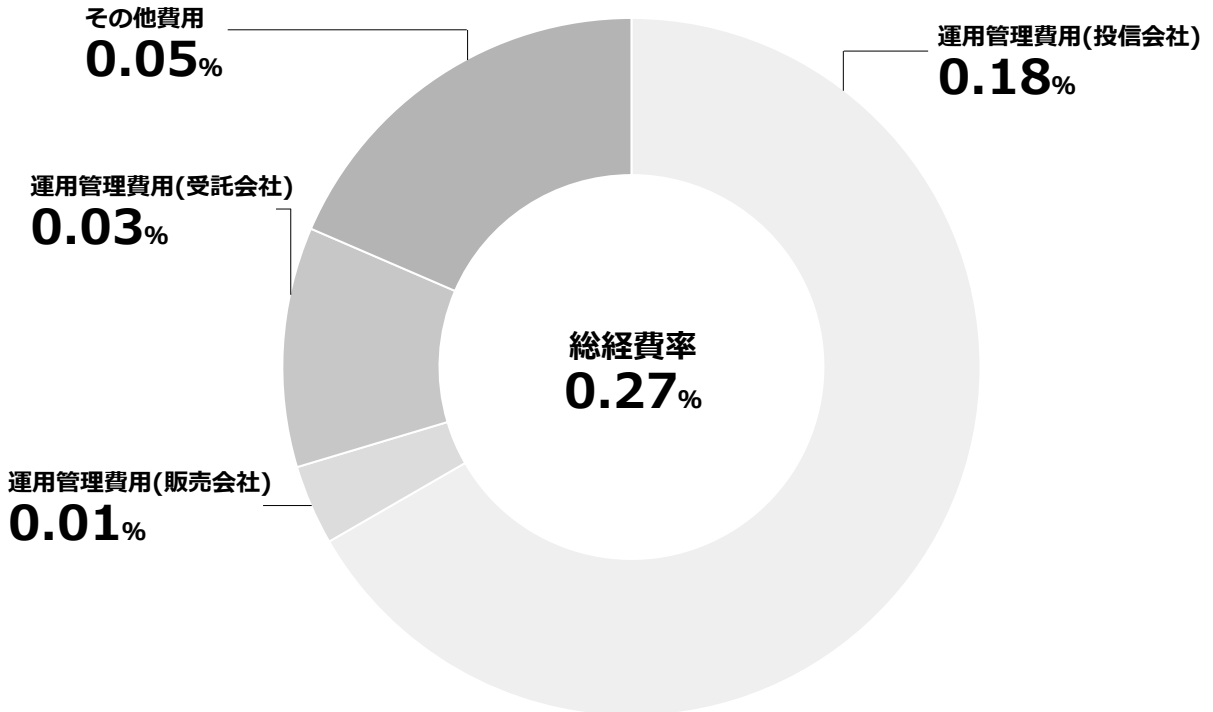
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した**総経費率(年率)**は**0.27%**です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎売買および取引の状況('22年2月22日から'23年2月20日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス・マザー・ファンド	3,006,777	7,714,464	2,636,200	6,994,898

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年2月22日から'23年2月20日まで)

○公社債(外国債券インデックス・マザー・ファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	903,570	US TREASURY N/B 1.5% 23/3/31(アメリカ)	1,151,086
US TREASURY N/B 2% 24/5/31(アメリカ)	811,879	US TREASURY N/B 2.625% 23/2/28(アメリカ)	1,024,526
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.91% 28/10/14(中国)	791,150	US TREASURY N/B 1.625% 23/5/31(アメリカ)	842,025
US TREASURY N/B 1.875% 32/2/15(アメリカ)	729,654	US TREASURY N/B 1.75% 23/5/15(アメリカ)	789,926
US TREASURY N/B 2.875% 32/5/15(アメリカ)	675,398	US TREASURY N/B 2.5% 23/8/15(アメリカ)	757,818
US TREASURY N/B 2.75% 32/8/15(アメリカ)	627,604	US TREASURY N/B 2.875% 23/9/30(アメリカ)	751,554
US TREASURY N/B 1.625% 29/8/15(アメリカ)	601,012	US TREASURY N/B 2% 23/2/15(アメリカ)	740,736
US TREASURY N/B 0.625% 27/11/30(アメリカ)	509,980	US TREASURY N/B 1.375% 23/9/30(アメリカ)	708,478
US TREASURY N/B 1.75% 29/1/31(アメリカ)	497,969	GERMAN GOVERNMENT BOND 2% 23/8/15(ユーロ・ドイツ)	684,347
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.26% 25/2/24(中国)	467,090	US TREASURY N/B 1.625% 23/10/31(アメリカ)	670,740

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('22年2月22日から'23年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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('23年2月20日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評価額
外国債券インデックス・マザー・ファンド	千口 5,435,093	千口 5,805,670	千円 14,697,054

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における外国債券インデックス・マザー・ファンド全体の口数は39,505,032千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('23年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス・マザー・ファンド	千円 14,697,054	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	44,258	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	14,741,312	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=134.45円、1カナダドル=99.65円、1メキシコペソ=7.318円、1ユーロ=143.53円、1英ポンド=161.61円、1スウェーデンクローナ=12.84円、1ノルウェークローネ=13.04円、1デンマーククローネ=19.28円、1ポーランドズロチ=30.1579円、1オーストラリアドル=92.33円、1ニューージーランドドル=83.74円、1シンガポールドル=100.55円、1マレーシアリングギット=30.373円、1人民元=19.5628円、1イスラエルシエケル=37.9437円、1オフショア人民元=19.5301円です。

(注2) 外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純資産(100,034,793千円)の投資信託財産総額(100,062,232千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	29,544,881,744
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	26,517,623
外国債券インデックス・マザー・ファンド(評価額)	14,697,054,794
未 収 入 金	14,821,309,327
(B) 負 債	15,215,111,334
未 払 金	15,173,361,625
未 払 解 約 金	26,928,323
未 払 信 託 報 酬	14,115,591
未 払 利 息	70
そ の 他 未 払 費 用	705,725
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	14,329,770,410
元 本	16,441,934,299
次 期 繰 越 損 益 金	△ 2,112,163,889
(D) 受 益 権 総 口 数	16,441,934,299口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	8,715円

- (注1) 期首元本額 13,534,140,302円
 期中追加設定元本額 9,404,412,602円
 期中一部解約元本額 6,496,618,605円
- (注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は2,112,163,889円です。

◎損益の状況

当期(自'22年2月22日 至'23年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 20,293
支 払 利 息	△ 20,293
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,562,223,116
売 買 益	1,631,955,686
売 買 損	△3,194,178,802
(C) 信 託 報 酬 等	△ 31,823,847
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,594,067,256
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 231,753,913
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 286,342,720
(配 当 等 相 当 額)	(1,656,609,736)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,942,952,456)
(G) 計 (D+E+F)	△2,112,163,889
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△2,112,163,889
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 286,342,720
(配 当 等 相 当 額)	(1,676,104,807)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,962,447,527)
分 配 準 備 積 立 金	642,648,797
繰 越 損 益 金	△2,468,469,966

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	298,787,838 円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0 円
C	収益調整金	1,676,104,807 円
D	分配準備積立金	343,860,959 円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,318,753,604 円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,410 円
G	分配金	0 円
H	分配金(1万口当たり)	0 円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第7期 (2022年2月22日～ 2023年2月20日)
当期分配金	-円
(対基準価額比率)	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	1,410円

- (注1) 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

第22期 運用報告書 (決算日2023年2月20日)

外国債券インデックス・マザー・ファンドの第22期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。 ・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。 ・ 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。
主要運用対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債など
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 公社債への投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎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、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
18期('19年 2月20日)	22,809	2.1	22,997	2.1	98.9	-	145,994
19期('20年 2月20日)	24,348	6.7	24,550	6.8	98.8	-	178,554
20期('21年 2月22日)	24,865	2.1	25,103	2.3	99.0	-	139,557
21期('22年 2月21日)	25,264	1.6	25,509	1.6	99.6	-	113,258
22期('23年 2月20日)	25,315	0.2	25,566	0.2	99.0	-	100,006

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算および合成して指数化しています。円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

◎当期中の基準価額と市況等の推移

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、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '22年 2月21日	25,264	-	25,509	-	99.6	-
2月末	25,138	△ 0.5	25,382	△ 0.5	99.0	-
3月末	25,970	2.8	26,220	2.8	98.9	-
4月末	26,030	3.0	26,284	3.0	98.8	-
5月末	25,867	2.4	26,115	2.4	99.0	-
6月末	26,487	4.8	26,748	4.9	99.0	-
7月末	26,671	5.6	26,944	5.6	99.0	-
8月末	26,354	4.3	26,596	4.3	99.0	-
9月末	26,117	3.4	26,362	3.3	98.9	-
10月末	26,887	6.4	27,153	6.4	98.8	-
11月末	26,084	3.2	26,335	3.2	98.8	-
12月末	24,802	△ 1.8	25,038	△ 1.8	98.8	-
'23年 1月末	25,098	△ 0.7	25,347	△ 0.6	98.7	-
(期末) '23年 2月20日	25,315	0.2	25,566	0.2	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算および合成して指数化しています。円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

当期の運用実績

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)で、前期末の基準価額にあわせて指数化しています。

当期末の基準価額は25,315円となり、前期末の25,264円に比べて51円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+0.2%となり、ベンチマークの騰落率(+0.2%)とほぼ同水準となりました。

投資環境

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、インフレ圧力の長期化に対する懸念が高まり債券が大きく売られました。米国10年債利回りは前期末の1.93%から3.81%へ上昇しました。

米国10年国債利回りの推移

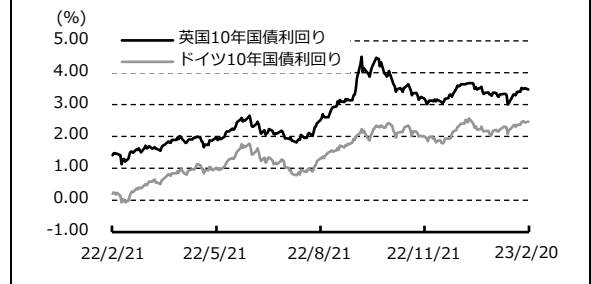


欧州債券市場

欧州債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

インフレ上昇に対する懸念や欧州中央銀行(ECB)による大幅な利上げを背景にドイツ国債が大きく売られました。独10年債利回りは前期末の0.21%から上昇し2.46%で期末を迎えました。英国債券市場は、9月、新政権誕生後に発表された大規模経済政策案を受けて財政悪化懸念が高まり債券が大きく売られました。英10年債利回りは前期末の1.41%から上昇し3.47%となりました。

英独10年国債利回りの推移

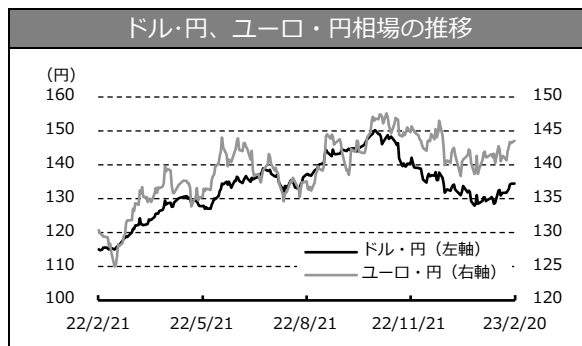


為替市況

ドル・円相場は、円安ドル高となりました。

米連邦準備理事会(FRB)が積極的な金融引き締め
の継続姿勢を示す一方、日銀は現行の金融緩和政策方針
を維持していることから、日米の金融政策方針の違い
と金利差の拡大を背景に円安ドル高が進みました。前
期末に115円台であった米ドル・円は134円台への円
安ドル高となりました。

ユーロ・円相場は、ECBによる継続的な利上げが日
本との金利差拡大につながりユーロが対円で上昇しま
した。前期末に130円台であったユーロ・円は143円台への円安ユーロ高となり当期末を迎えました。



運用の概況

(2022年2月22日から2023年2月20日まで)

当マザーファンドは、主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債を主な投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

当期は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の収益率を捉える目的で、層化抽出法の発想に従って、ファンドの国別通貨別の配分や、各国別とファンド全体のデュレーション(金利感応度)、債券の満期構成などをベンチマークに合致させるように努めつつ、インデックス構成国の国債に分散投資しました。

インデックスの構成銘柄変更のタイミングに合わせて、各月末にファンドのリスク特性をベンチマークに合わせるべくリバランス(銘柄の入れ替え)を行うとともに、月中における資金流入出に対応した取引や、ファンドで受け取った利金の再投資も行いました。

組入銘柄数は、500銘柄前後で期を通じて安定的に運用を行いました。また、債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

今後の運用方針

今後も引き続き、主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債などに投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年2月22日~2023年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	25,958円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (保管費用)	9円 (9)	0.036% (0.036)	(a)その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 ・ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	・ その他は、LEI支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	9円	0.036%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('22年2月22日から'23年2月20日まで)

○公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千米ドル 105,603	千米ドル 157,910
	カナダ	千カナダドル 7,390	千カナダドル 9,486
	メキシコ	千メキシコペソ 15,305	千メキシコペソ 35,003
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 11,739	20,142
	イタリア	国債証券 9,818	22,113
	フランス	国債証券 9,895	23,139
	オランダ	国債証券 1,165	3,848
	スペイン	国債証券 6,086	14,048
	ベルギー	国債証券 1,927	4,751
	オーストリア	国債証券 1,150	2,941
	フィンランド	国債証券 406	1,200
	アイルランド	国債証券 176	1,516
	イギリス	千英ポンド 8,575	千英ポンド 11,841
	スウェーデン	千スウェーデンクローナ 3,157	千スウェーデンクローナ 11,823
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,493	千ノルウェークローネ 7,785
	デンマーク	千デンマーククローネ 1,831	千デンマーククローネ 8,148
	ポーランド	千ポーランドズロチ 4,113	千ポーランドズロチ 6,321
	オーストラリア	千オーストラリアドル 3,049	千オーストラリアドル 4,984
	国	ニュージーランド	千ニュージーランドドル 2,441
シンガポール		千シンガポールドル 848	千シンガポールドル 1,812
マレーシア		千マレーシアリンギット 5,582	千マレーシアリンギット 8,160
中国		千人民元 170,044	千人民元 -
イスラエル		千イスラエルシケル 497	千イスラエルシケル 3,990

(注1) 金額は受渡代金です(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) 地域は発行通貨によって区分しています。ただし、ユーロ建ての外国公社債は発行体の国籍によって区分しています。以下同じです。

(注4) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年2月22日から'23年2月20日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	903,570	US TREASURY N/B 1.5% 23/3/31(アメリカ)	1,151,086
US TREASURY N/B 2% 24/5/31(アメリカ)	811,879	US TREASURY N/B 2.625% 23/2/28(アメリカ)	1,024,526
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.91% 28/10/14(中国)	791,150	US TREASURY N/B 1.625% 23/5/31(アメリカ)	842,025
US TREASURY N/B 1.875% 32/2/15(アメリカ)	729,654	US TREASURY N/B 1.75% 23/5/15(アメリカ)	789,926
US TREASURY N/B 2.875% 32/5/15(アメリカ)	675,398	US TREASURY N/B 2.5% 23/8/15(アメリカ)	757,818
US TREASURY N/B 2.75% 32/8/15(アメリカ)	627,604	US TREASURY N/B 2.875% 23/9/30(アメリカ)	751,554
US TREASURY N/B 1.625% 29/8/15(アメリカ)	601,012	US TREASURY N/B 2% 23/2/15(アメリカ)	740,736
US TREASURY N/B 0.625% 27/11/30(アメリカ)	509,980	US TREASURY N/B 1.375% 23/9/30(アメリカ)	708,478
US TREASURY N/B 1.75% 29/1/31(アメリカ)	497,969	GERMAN GOVERNMENT BOND 2% 23/8/15(ユーロ・ドイツ)	684,347
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.26% 25/2/24(中国)	467,090	US TREASURY N/B 1.625% 23/10/31(アメリカ)	670,740

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('22年2月22日から'23年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※ 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('23年2月20日現在)

○外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 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 413,050	千米ドル 368,815	千円 49,587,214	49.6	—	21.5	17.6	10.4
カ ナ ダ	千カナダドル 22,190	千カナダドル 20,713	2,064,067	2.1	—	1.1	0.4	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 123,800	千メキシコペソ 117,762	861,788	0.9	—	0.5	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	47,280	45,157	6,481,422	6.5	—	3.6	2.0	0.9
イ タ リ ア	56,020	52,231	7,496,742	7.5	—	4.1	2.5	0.9
フ ラ ン ス	62,880	58,791	8,438,281	8.4	—	5.1	2.5	0.9
オ ラ ン ダ	11,420	10,477	1,503,778	1.5	—	0.9	0.5	0.1
ス ペ イ ン	36,670	34,563	4,960,920	5.0	—	2.9	1.5	0.5
ベルギー	13,730	12,906	1,852,408	1.9	—	1.4	0.4	0.1
オーストリア	9,145	8,285	1,189,276	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フィンランド	4,110	3,503	502,845	0.5	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	4,970	4,367	626,886	0.6	—	0.5	0.2	—
イ ギ リ ス	千英ポンド 31,740	千英ポンド 29,478	4,764,045	4.8	—	3.6	1.0	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 15,850	千スウェーデンクローナ 15,416	197,951	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 15,800	千ノルウェークローネ 14,776	192,683	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 18,030	千デンマーククローネ 16,905	325,941	0.3	—	0.2	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 16,200	千ポーランドズロチ 14,223	428,954	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 18,730	千オーストラリアドル 17,022	1,571,685	1.6	—	1.1	0.4	0.0
ニュージーランド	千ニューージーランドドル 2,910	千ニューージーランドドル 2,439	204,257	0.2	—	0.1	0.1	—
シンガポール	千シンガポールドル 4,620	千シンガポールドル 4,456	448,079	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 17,750	千マレーシアリンギット 17,935	544,760	0.5	—	0.2	0.3	0.1
中 国	千人民元 223,400	千人民元 224,531	4,392,462	4.4	—	2.0	2.4	—
イスラエル	千イスラエルシエケル 8,850	千イスラエルシエケル 8,712	330,566	0.3	—	0.2	0.1	0.0
合 計	—	—	98,967,020	99.0	—	50.7	33.1	15.1

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する邦貨換算金額(評価額)の比率です。

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

(注4) 金額の単位未満は切り捨てています。

○外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,550	4,205	565,484	2026/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	1,050	1,004	134,996	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,000	765	102,985	2046/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	500	538	72,432	2036/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	900	1,030	138,545	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,300	3,214	432,228	2024/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,000	3,910	525,804	2024/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	6,500	6,311	848,560	2024/ 2/29
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	6,200	6,007	807,703	2024/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	6,500	6,275	843,678	2024/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	6,000	5,821	782,719	2024/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	6,000	5,779	777,110	2024/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,000	3,844	516,918	2024/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	3,000	2,884	387,830	2024/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	8,300	8,001	1,075,831	2024/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,800	3,632	488,398	2024/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,300	5,082	683,302	2024/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	7,700	7,383	992,762	2024/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,500	2,392	321,655	2024/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,500	2,401	322,890	2025/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	5,000	4,753	639,162	2025/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	3,900	3,762	505,838	2025/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,000	4,807	646,331	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	7,500	6,896	927,232	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,200	4,936	663,691	2025/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,900	2,788	374,872	2025/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,600	4,434	596,195	2025/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,500	4,244	570,661	2025/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.25	4,000	3,605	484,776	2025/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,500	2,412	324,334	2025/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	4,000	3,782	508,536	2025/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,300	2,211	297,372	2025/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	3,000	2,865	385,246	2025/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	1,000	987	132,769	2026/ 1/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,300	2,194	295,005	2026/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	3,000	2,775	373,193	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	3,000	2,847	382,835	2026/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,300	2,165	291,200	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.75	3,200	2,876	386,711	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,682	495,112	2026/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	4,000	3,581	481,541	2026/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	3,500	3,193	429,307	2026/ 8/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,500	3,176	427,065	2026/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,657	491,771	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,200	1,955	262,883	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	3,000	2,693	362,132	2026/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	4,800	4,336	583,067	2027/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,500	3,256	437,892	2027/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	2,100	1,868	251,264	2027/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,200	3,913	526,198	2027/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,800	1,694	227,782	2027/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,714	230,560	2027/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,500	2,976	400,154	2027/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,000	1,850	248,732	2027/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,200	3,073	413,215	2027/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,200	2,707	364,040	2027/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,697	228,281	2027/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,800	2,582	347,166	2027/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	6,500	5,539	744,782	2027/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,950	2,507	337,179	2027/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,300	2,166	291,236	2028/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,400	1,220	164,149	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,400	3,213	432,077	2028/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,200	3,649	490,640	2028/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,000	3,468	466,394	2028/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,000	3,773	507,338	2028/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	600	517	69,543	2028/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,500	2,166	291,286	2028/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,200	3,053	410,492	2028/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	4,900	4,270	574,138	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,000	3,458	465,028	2028/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	4,100	3,615	486,064	2029/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,000	4,633	622,960	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,500	2,277	306,241	2029/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.25	2,800	2,682	360,695	2029/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	6,000	5,223	702,333	2029/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,000	2,629	353,561	2029/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,500	1,284	172,644	2030/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,800	2,231	299,976	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	4,000	3,169	426,164	2030/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	4,000	3,219	432,886	2030/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	4,200	3,441	462,648	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,400	3,724	500,717	2031/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,100	3,346	449,932	2031/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,000	3,277	440,680	2031/11/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,000	3,410	458,495	2032/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,900	4,535	609,754	2032/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,800	4,389	590,101	2032/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	700	715	96,217	2032/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	321	43,271	2038/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	600	571	76,904	2039/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	500	521	70,053	2039/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	750	793	106,651	2039/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	500	527	70,901	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,000	640	86,147	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	900	892	119,979	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	2,500	1,591	214,030	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,000	1,039	139,728	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,000	1,992	267,881	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,800	1,990	267,657	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,400	1,011	136,054	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,050	1,573	211,561	2041/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	800	775	104,228	2041/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	950	838	112,684	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	3,000	2,188	294,272	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,400	1,230	165,480	2042/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,200	1,031	138,683	2042/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,200	987	132,784	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	3,300	3,001	403,614	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,000	820	110,354	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	298	40,145	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	700	609	81,994	2043/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,750	1,462	196,602	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,100	1,034	139,021	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,300	1,218	163,772	2044/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,000	863	116,083	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,000	771	103,678	2045/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,100	926	124,589	2045/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,100	905	121,770	2045/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	841	113,148	2045/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,200	872	117,343	2046/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	800	656	88,316	2046/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	755	101,516	2047/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	838	112,754	2047/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	400	53,787	2047/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,000	800	107,638	2047/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	550	461	62,043	2048/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,700	1,460	196,342	2048/ 5/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	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	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,500	1,259	169,343	2048/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	2,050	1,846	248,286	2048/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,700	1,432	192,548	2049/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,000	1,645	221,243	2049/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,000	721	96,951	2049/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,500	1,851	248,995	2049/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,200	1,494	200,883	2050/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,500	834	112,173	2050/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,700	1,551	208,577	2050/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	800	491	66,069	2050/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,850	3,173	426,681	2051/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,000	2,943	395,787	2051/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,600	1,076	144,735	2051/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	2,500	1,627	218,848	2051/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,100	1,499	201,623	2052/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,500	2,051	275,832	2052/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,800	1,516	203,855	2052/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	2,350	2,398	322,424	2052/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	400	423	56,960	2038/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	200	225	30,363	2037/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.0	2,000	2,092	281,389	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.375	500	550	73,979	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.125	300	326	43,840	2027/11/15
小計					49,587,214	
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	750	853	85,044	2029/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	450	533	53,203	2037/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	800	782	77,932	2024/ 3/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,400	2,344	233,590	2024/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,290	2,197	218,988	2024/ 9/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	2,500	2,412	240,369	2025/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,100	1,029	102,577	2026/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,050	951	94,771	2027/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	550	515	51,384	2028/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,780	1,546	154,149	2030/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,000	1,741	173,571	2031/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,900	1,705	169,914	2032/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	600	616	61,397	2045/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	650	588	58,682	2048/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,520	1,158	115,484	2051/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	720	509	50,814	2053/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	430	380	37,879	2064/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	700	846	84,312	2033/ 6/ 1
小計					2,064,067	

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	13,000	12,069	88,328	2031/ 5/29
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	15,000	14,610	106,918	2023/12/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	18,000	17,852	130,645	2024/12/ 5
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	22,000	20,521	150,177	2027/ 6/ 3
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	12,000	11,676	85,450	2029/ 5/31
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	7,500	6,843	50,080	2034/11/23
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	7,200	7,785	56,976	2036/11/20
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	9,000	8,552	62,585	2038/11/18
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	8,500	7,436	54,420	2042/11/13
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	9,100	8,169	59,785	2047/11/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	2,500	2,243	16,419	2053/ 7/31
小計					861,788	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,400	2,294	329,335	2025/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,250	3,114	447,059	2025/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,900	1,737	249,405	2027/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,050	1,878	269,619	2027/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	373	53,642	2025/10/10
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	950	1,058	151,909	2042/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,150	1,167	167,623	2046/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	750	737	105,824	2024/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,150	3,064	439,805	2024/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,000	1,878	269,616	2026/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,800	1,598	229,414	2028/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,800	1,582	227,185	2029/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,550	1,326	190,448	2029/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	846	121,469	2030/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	754	108,349	2030/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	744	106,876	2031/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	981	140,823	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	1,850	1,737	249,452	2032/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	884	126,983	2035/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,100	1,108	159,099	2044/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,150	905	129,932	2048/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,700	900	129,259	2050/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	354	50,841	2052/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	250	217	31,208	2053/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,400	1,558	223,753	2028/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.625	1,300	1,484	213,098	2028/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,380	1,617	232,166	2037/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	700	862	123,828	2039/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,200	1,469	210,985	2034/ 7/ 4

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	850	1,114	160,002	2040/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,100	1,339	192,198	2031/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	850	1,053	151,181	2030/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5	1,200	1,393	200,068	2027/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,200	2,013	288,952	2026/ 8/15
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,500	1,543	221,498	2026/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,350	1,309	187,909	2037/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,000	1,060	152,191	2034/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.25	900	1,017	146,043	2026/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,000	1,070	153,589	2039/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.25	1,800	1,962	281,697	2029/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	800	897	128,873	2033/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	800	916	131,502	2031/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	300	303	43,562	2024/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	2,250	2,210	317,288	2024/ 5/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	1,800	1,810	259,813	2024/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	1,850	1,746	250,606	2025/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,200	1,237	177,644	2025/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,350	2,255	323,678	2025/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,000	1,924	276,280	2025/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	2,600	2,449	351,540	2026/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,700	2,485	356,683	2026/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	1,200	1,135	163,004	2027/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.05	1,000	937	134,501	2027/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,500	2,316	332,487	2028/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	2,100	2,209	317,196	2028/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,300	1,239	177,896	2028/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,500	1,433	205,730	2029/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	1,100	1,077	154,662	2030/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	1,000	844	121,161	2030/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,000	846	121,497	2030/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	2,000	1,578	226,561	2031/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,430	1,084	155,676	2031/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	2,250	1,846	265,058	2032/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	1,000	849	121,858	2033/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.35	700	634	91,122	2035/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,200	951	136,636	2036/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	900	760	109,083	2038/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,050	1,127	161,787	2040/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	1,070	732	105,077	2041/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	650	679	97,523	2044/ 9/ 1

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	700	587	84,290	2046/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	500	379	54,513	2047/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	800	691	99,253	2048/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	750	687	98,606	2049/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	800	561	80,614	2050/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	720	421	60,513	2051/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	600	418	60,019	2067/ 3/ 1
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,400	1,644	236,056	2041/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,150	1,349	193,693	2060/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	871	125,085	2024/ 3/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	2,400	2,377	341,232	2024/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	3,500	3,317	476,192	2025/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,100	2,142	307,511	2026/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,800	2,599	373,142	2026/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,250	1,161	166,721	2027/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,600	2,596	372,679	2027/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,500	2,253	323,486	2028/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,300	2,053	294,731	2028/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,200	1,915	274,926	2029/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,400	1,163	166,965	2029/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,100	2,063	296,178	2030/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,800	1,452	208,501	2030/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,251	179,604	2031/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,100	1,614	231,670	2032/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,500	1,249	179,283	2034/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,800	1,438	206,516	2036/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,200	992	142,412	2039/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,100	710	101,982	2040/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,200	953	136,852	2048/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,700	1,183	169,901	2050/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	380	202	29,074	2053/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	150	57	8,251	2072/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,200	1,400	201,006	2035/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,700	1,957	280,941	2029/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,600	1,982	284,504	2032/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	1,650	1,781	255,665	2025/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,750	1,665	239,076	2025/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,200	1,994	286,239	2031/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,500	1,510	216,813	2045/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	900	990	142,136	2038/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,200	1,382	198,386	2055/ 4/25

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	2,800	2,742	393,651	2024/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,400	2,183	313,465	2026/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	850	583	83,739	2066/ 5/25
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	750	858	123,175	2042/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	600	682	97,941	2037/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	600	591	84,965	2024/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	900	847	121,585	2025/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,250	1,160	166,571	2026/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	700	644	92,570	2027/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	800	724	103,917	2028/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	450	387	55,576	2029/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	411	59,053	2030/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	720	103,423	2031/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	900	881	126,567	2033/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	264	38,033	2038/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	470	328	47,149	2040/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	730	742	106,620	2047/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	600	293	42,066	2052/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	170	148	21,249	2054/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	700	789	113,309	2028/ 1/15
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8	600	609	87,520	2024/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	1,000	1,009	144,830	2024/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,100	2,091	300,137	2024/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	1,350	1,309	187,908	2025/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.65	1,600	1,659	238,136	2025/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	1,000	940	134,967	2026/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,700	1,596	229,206	2027/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,500	1,392	199,928	2027/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	800	734	105,400	2028/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,000	914	131,281	2028/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,000	904	129,840	2029/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,000	847	121,576	2029/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,150	953	136,794	2030/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	1,200	1,099	157,739	2030/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	1,500	1,161	166,754	2031/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7	2,200	1,742	250,138	2032/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	1,200	1,084	155,634	2033/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	950	785	112,695	2035/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7	900	1,012	145,311	2041/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	380	236	33,968	2042/ 7/30

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	550	662	95,131	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	720	594	85,318	2048/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	820	436	62,666	2050/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	500	328	47,126	2052/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	250	119	17,182	2071/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	1,550	1,515	217,557	2025/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	750	652	93,605	2046/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	1,100	1,163	166,925	2037/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9	900	1,031	148,067	2040/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9	1,800	1,964	281,954	2026/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	1,100	1,211	173,924	2028/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	500	454	65,263	2066/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	1,100	1,268	182,014	2029/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	900	1,075	154,410	2032/ 7/30
(ベルギー)						
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	620	616	88,469	2024/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	1,200	1,144	164,326	2025/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,000	1,050	150,764	2026/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	300	276	39,616	2027/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	550	497	71,337	2028/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	750	668	95,879	2029/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	400	328	47,110	2030/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	900	773	111,008	2031/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,250	1,347	193,338	2032/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	200	157	22,535	2032/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	450	380	54,610	2033/ 4/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	450	443	63,651	2034/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	300	239	34,323	2037/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	300	251	36,032	2038/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	280	173	24,898	2040/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	640	720	103,417	2041/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	440	467	67,143	2045/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	550	392	56,346	2047/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	450	320	45,934	2050/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	470	370	53,240	2057/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	200	152	21,817	2066/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	280	114	16,486	2071/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	850	958	137,591	2028/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	900	1,062	152,526	2035/ 3/28
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	550	538	77,322	2024/10/21
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2	750	719	103,293	2025/10/20

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.85	450	477	68,563	2026/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	800	742	106,633	2026/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	750	678	97,326	2028/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	500	434	62,428	2029/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	950	776	111,380	2030/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	550	435	62,517	2031/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	300	280	40,321	2034/ 5/23
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	250	144	20,685	2040/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	290	292	41,997	2044/ 6/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	405	297	42,762	2047/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	390	225	32,331	2051/ 3/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	220	255	36,727	2062/ 1/26
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	150	90	12,976	2086/11/ 2
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1	210	153	21,999	2117/ 9/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.85	130	53	7,620	2120/ 6/30
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.15	800	891	127,963	2037/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	700	797	114,425	2027/ 7/15
(フィンランド)						
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	470	449	64,574	2024/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	480	448	64,391	2026/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	120	108	15,547	2027/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	200	199	28,611	2028/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	150	131	18,922	2028/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	220	189	27,150	2029/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	200	160	23,092	2030/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	180	151	21,790	2031/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	230	181	26,082	2031/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.125	300	245	35,240	2034/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	280	191	27,421	2036/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	150	92	13,264	2040/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.625	235	220	31,696	2042/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	230	168	24,211	2047/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	215	99	14,322	2052/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	450	463	66,524	2025/ 7/ 4
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	100	78	11,295	2032/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.55	70	44	6,387	2041/ 4/22
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	450	472	67,870	2025/ 3/13
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	240	200	28,742	2037/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	78	11,205	2031/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	300	219	31,458	2035/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	520	473	67,975	2028/ 5/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	800	757	108,793	2026/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1	500	451	64,857	2029/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	190	161	23,204	2033/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	500	447	64,173	2031/ 3/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	480	333	47,931	2050/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	320	258	37,043	2045/ 2/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	400	389	55,946	2030/ 5/15
小計					33,052,561	
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド		
UK GILT BOND	国債証券	4.25	650	676	109,294	2049/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,220	1,306	211,064	2042/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,000	1,074	173,704	2034/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	430	444	71,878	2039/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.0	870	900	145,449	2060/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	5.0	1,720	1,769	285,937	2025/ 3/ 7
UK GILT BOND	国債証券	2.0	800	772	124,802	2025/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.5	1,150	1,078	174,347	2026/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,280	1,323	213,935	2040/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	1,000	924	149,356	2045/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	3.75	850	819	132,370	2052/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	887	143,469	2036/ 3/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	800	869	140,502	2030/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	6.0	1,050	1,185	191,664	2028/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	0.375	1,000	791	127,931	2030/10/22
UK GILT BOND	国債証券	0.875	1,400	1,186	191,769	2029/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	600	544	87,997	2028/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	870	469	75,872	2071/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.0	150	145	23,478	2024/ 4/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	900	577	93,254	2049/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,030	621	100,449	2057/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.5	970	711	114,961	2065/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.75	1,100	1,083	175,114	2024/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	650	613	99,068	2068/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	900	929	150,263	2046/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,300	1,373	221,944	2032/ 6/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,050	1,087	175,670	2027/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	902	145,778	2055/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	600	657	106,299	2038/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.25	1,300	1,184	191,380	2027/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	0.25	1,150	875	141,425	2031/ 7/31
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,300	991	160,214	2037/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.125	650	433	70,126	2039/ 1/31

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) UK GILT BOND	国債証券	% 3.25	千英ポンド 300	千英ポンド 267	千円 43,265	2044/ 1/22
小計					4,764,045	
(スウェーデン) SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	千スウェーデンクローナ 3,000	千スウェーデンクローナ 2,833	36,378	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,850	2,828	36,316	2025/ 5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	4,200	3,851	49,458	2028/ 5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	3,000	2,695	34,616	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,800	3,207	41,181	2039/ 3/30
小計					197,951	
(ノルウェー) NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	千ノルウェークローネ 3,200	千ノルウェークローネ 3,037	39,614	2026/ 2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	2,400	2,388	31,142	2024/ 3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,500	3,308	43,139	2027/ 2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,200	2,924	38,139	2029/ 9/ 6
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	2,200	1,931	25,193	2030/ 8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.125	1,300	1,185	15,454	2032/ 5/18
小計					192,683	
(デンマーク) DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	千デンマーククローネ 3,500	千デンマーククローネ 3,401	65,578	2025/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	4,000	3,622	69,832	2027/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	3,900	3,393	65,429	2029/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	4,100	5,119	98,699	2039/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,530	1,369	26,400	2052/11/15
小計					325,941	
(ポーランド) POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	千ポーランドズロチ 3,000	千ポーランドズロチ 2,879	86,850	2024/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	2,900	2,699	81,425	2025/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	3,000	2,641	79,662	2026/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	3,400	3,300	99,527	2029/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,900	2,017	60,854	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,000	684	20,634	2032/ 4/25
小計					428,954	
(オーストラリア) AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	千オーストラリアドル 400	千オーストラリアドル 395	36,559	2024/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,100	1,094	101,062	2025/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,450	1,482	136,883	2026/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,500	1,569	144,908	2027/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	650	626	57,884	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	700	655	60,531	2028/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	900	859	79,401	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	450	440	40,649	2029/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,900	1,754	161,977	2030/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,700	1,384	127,845	2030/12/21

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	910	721	66,649	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,400	1,925	177,774	2032/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,600	1,691	156,143	2033/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	400	353	32,618	2035/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	350	313	28,972	2039/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	500	409	37,784	2041/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	570	465	42,948	2047/ 3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	900	539	49,773	2051/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	350	339	31,317	2037/ 4/21
小計					1,571,685	
(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	国債証券	2.75	850	817	68,463	2025/ 4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	800	649	54,386	2028/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	800	659	55,236	2032/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	290	188	15,814	2041/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	170	123	10,356	2051/ 5/15
小計					204,257	
(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	国債証券	3.5	840	850	85,492	2027/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	60	59	5,951	2024/ 2/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	1,280	1,255	126,242	2025/ 6/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	800	780	78,484	2030/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	350	354	35,609	2033/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	240	213	21,511	2039/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	350	334	33,659	2042/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	200	192	19,358	2046/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	300	246	24,759	2050/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	190	158	15,934	2051/10/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	10	10	1,074	2072/ 8/ 1
小計					448,079	
(マレーシア)			千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット		
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.502	1,000	993	30,164	2027/ 5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.478	1,900	1,906	57,900	2024/ 6/14
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.757	200	187	5,686	2040/ 5/22
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.065	2,750	2,595	78,845	2050/ 6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.955	5,000	5,053	153,490	2025/ 9/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	2,500	2,530	76,843	2026/11/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.498	900	940	28,562	2030/ 4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.935	1,500	1,614	49,041	2043/ 9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.736	1,550	1,632	49,582	2046/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.921	450	482	14,642	2048/ 7/ 6
小計					544,760	
(中国)			千人民元	千人民元		
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.26	24,000	23,919	467,926	2025/ 2/24

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)		%	千人民元	千人民元	千円	
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.24	11,800	11,747	229,818	2025/ 5/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.18	13,000	12,901	252,396	2025/ 8/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.69	39,100	39,211	767,087	2026/ 8/12
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.37	21,000	20,776	406,453	2027/ 1/20
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.48	12,000	11,905	232,911	2027/ 4/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.91	40,000	40,312	788,615	2028/10/14
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.02	20,700	20,965	410,144	2031/ 5/27
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.89	20,800	20,821	407,336	2031/11/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.86	6,200	6,789	132,825	2049/ 7/22
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.53	7,700	8,006	156,620	2051/10/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.32	7,100	7,173	140,324	2052/ 4/15
小計					4,392,462	
(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 FIXED BOND	国債証券	-	800	786	29,860	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,800	1,721	65,317	2025/ 8/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,800	1,710	64,914	2027/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,700	1,595	60,537	2028/ 9/28
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	680	573	21,765	2030/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	890	1,104	41,896	2042/ 1/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,180	1,219	46,275	2047/ 3/31
小計					330,566	
合計					98,967,020	

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('23年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 98,967,020	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,095,212	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	100,062,232	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=134.45円、1カナダドル=99.65円、1メキシコペソ=7.318円、1ユーロ=143.53円、1英ポンド=161.61円、1スウェーデンクローナ=12.84円、1ノルウェークローネ=13.04円、1デンマーククローネ=19.28円、1ポーランドズロチ=30.1579円、1オーストラリアドル=92.33円、1ニューージーランドドル=83.74円、1シンガポールドル=100.55円、1マレーシアリンギット=30.373円、1人民元=19.5628円、1イスラエルシェケル=37.9437円、1オフショア人民元=19.5301円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(100,034,793千円)の投資信託財産総額(100,062,232千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	100,109,182,229
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	358,861,951
公 社 債 (評 価 額)	98,967,020,992
未 収 入 金	46,949,635
未 収 利 息	693,324,926
前 払 費 用	43,024,725
(B) 負 債	102,997,113
未 払 金	47,048,400
未 払 解 約 金 息	55,948,622
未 払 利 息	73
そ の 他 未 払 費 用	18
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	100,006,185,116
元 本	39,505,032,684
次 期 繰 越 損 益 金	60,501,152,432
(D) 受 益 権 総 口 数	39,505,032,684口
1万口当たり基準価額 (C / D × 10,000)	25,315円

- (注1) 期首元本額 44,829,220,968円
 期中追加設定元本額 6,861,120,999円
 期中一部解約元本額 12,185,309,283円
 (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,573,053,611円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	5,805,670,470円
バランスファンドVA50B <適格機関投資家限定>	5,649,737,183円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き (年金) <適格機関投資家限定>	3,522,109,524円
4資産バランス40VA <適格機関投資家限定>	3,057,943,620円
バランスファンドVA35A <適格機関投資家限定>	2,036,207,903円
バランスファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,770,620,355円
世界分散タムスブレッド・プレミア戦略ファンド/為替ヘッジ付 <適格機関投資家限定>	1,746,137,311円
世界分散ファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,261,385,716円
バランスファンドVA37.5A <適格機関投資家限定>	999,215,937円
AMC/ステート・ストリート・リスカブリッジ型(バランス・オープン) (ステイブル)	858,207,630円
グローバル(バランス40VA2 <適格機関投資家限定>	834,530,442円
4資産インデックス(バランスVA20 <適格機関投資家限定>	762,368,435円
外国債券バッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	731,180,349円
4資産バランス30VA <適格機関投資家限定>	657,500,727円
4資産バランス20VA <適格機関投資家限定>	547,267,577円
外国債券インデックス・ファンドVA3 <適格機関投資家限定>	505,687,107円
バランスファンドVA25B <適格機関投資家限定>	483,144,559円
外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き <適格機関投資家限定>	410,575,814円
フレックス資産配分戦略ファンド <適格機関投資家限定>	214,783,410円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	200,353,653円
TaDRiskジェット型マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) 年金 <適格機関投資家限定>	188,469,837円

◎損益の状況

当期 (自 '22年2月22日 至 '23年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	2,517,751,849
受 取 利 息	2,518,411,535
そ の 他 収 益 金	31,310
支 払 利 息	△ 690,996
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,587,251,414
売 買 益	14,400,014,711
売 買 損	△ 15,987,266,125
(C) そ の 他 費 用	△ 37,925,334
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	892,575,101
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	68,428,900,404
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,868,054,657
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 19,688,377,730
(H) 計 (D + E + F + G)	60,501,152,432
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	60,501,152,432

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
 (注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

TaDRiskジェット型マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) <適格機関投資家限定>	126,400,166円
バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	77,880,401円
グローバル4資産30VA <適格機関投資家限定>	74,087,159円
外国債券インデックス・ファンドVA1 <適格機関投資家限定>	73,245,212円
バランスファンドVA40C <適格機関投資家限定>	66,481,698円
グローバル4資産45VA <適格機関投資家限定>	53,201,916円
グローバル(バランス40VA3 <適格機関投資家限定>	52,778,605円
4資産バランス30VA2 <適格機関投資家限定>	30,342,970円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	27,914,213円
4資産インデックス(バランスVA50 <適格機関投資家限定>	27,738,807円
バランスファンドVA75A <適格機関投資家限定>	25,180,532円
世界バランス60VA <適格機関投資家限定>	13,639,600円
世界バランス40VA <適格機関投資家限定>	13,481,149円
グローバル(バランス50VA <適格機関投資家限定>	10,008,603円
バランスファンドVA40B <適格機関投資家限定>	4,841,917円
バランスファンドVA30A <適格機関投資家限定>	3,965,865円
バランスファンドVA50A <適格機関投資家限定>	1,950,052円
バランスファンドVA35B <適格機関投資家限定>	1,825,877円
バランスファンドVA20A <適格機関投資家限定>	1,653,371円
バランスファンドVA50C <適格機関投資家限定>	1,234,781円
グローバル(バランス40VA <適格機関投資家限定>	949,115円
バランスファンドVA40A <適格機関投資家限定>	79,545円