

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
信託期間	2027年2月5日まで（2017年3月27日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質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せん。 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
主要運用対象	投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

運用報告書（全体版）

海外債券セクション
（ラップ向け）

第7期（決算日：2024年2月5日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「海外債券セクション（ラップ向け）」は、去る2月5日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況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。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
フリーダイヤル

0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			（参考指数） FTSE世界国債インデックス （除く日本、円換算ベース）		債券 組入比率	債券 先物比率	投資信託 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
3期(2020年2月5日)	11,178	0	7.4	120,270.89	6.4	64.3	—	32.8	6,384
4期(2021年2月5日)	11,579	0	3.6	124,867.08	3.8	63.4	—	33.2	8,265
5期(2022年2月7日)	11,855	0	2.4	127,308.73	2.0	63.0	—	32.8	14,001
6期(2023年2月6日)	11,861	0	0.1	127,806.02	0.4	64.2	—	32.5	20,928
7期(2024年2月5日)	13,623	0	14.9	145,368.05	13.7	65.4	—	31.0	25,881

- (注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
- (注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「債券先物比率」は買建比率－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		(参 考 指 数) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2023年 2月 6日	円 11,861	% —	127,806.02	% —	% 64.2	% —	% 32.5
2月末	11,879	0.2	126,903.56	△ 0.7	63.6	—	32.8
3月末	11,935	0.6	128,532.24	0.6	63.8	—	32.4
4月末	12,095	2.0	129,370.99	1.2	63.2	—	33.0
5月末	12,396	4.5	132,828.99	3.9	65.4	—	31.1
6月末	12,919	8.9	138,284.08	8.2	65.6	—	31.1
7月末	12,617	6.4	135,227.94	5.8	66.1	—	30.8
8月末	12,988	9.5	138,880.03	8.7	65.4	—	31.1
9月末	12,839	8.2	136,810.50	7.0	65.2	—	31.1
10月末	12,801	7.9	136,724.14	7.0	65.5	—	30.8
11月末	13,231	11.6	141,488.31	10.7	65.1	—	31.2
12月末	13,292	12.1	141,801.08	11.0	65.1	—	31.4
2024年 1月末	13,547	14.2	144,118.59	12.8	65.3	—	31.1
(期 末) 2024年 2月 5日	13,623	14.9	145,368.05	13.7	65.4	—	31.0

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第7期：2023年2月7日～2024年2月5日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第7期首	11,861円
第7期末	13,623円
既払分配金	0円
騰落率	14.9%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ14.9%の上昇となりました。

▶ 基準価額の変動要因

上昇要因

組み入れを行った投資信託証券のうち、主に、海外債券市況の上昇を背景に「外国債券インデックスマザーファンド」が上昇したことや米ドルとユーロが対円で上昇したこと等が基準価額のプラス要因となりました。

第7期：2023年2月7日～2024年2月5日

投資環境について

▶ 海外債券市況

海外債券市況は上昇しました。

米国と欧州主要国の長期金利は、米連邦準備制度理事会（F R B）や欧州中央銀行（E C B）による金融引き締め長期化観測の広がり等を背景に上昇しました。米国と欧州主要国の長期金利は上昇したものの、債券利子収入を獲得したことがプラスとなり、海外債券市況は上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルとユーロは円に対して上昇しました。

米ドルとユーロは、米欧の金融引き締め長期化観測が広がった局面で日本との金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から、対円で上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行いました。

投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定し、期間の初めから「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券イ

ンデックスマザーファンド」、「グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）」に投資を行いました。また、2023年5月中旬以降、「海外債券マザーファンド」を組み入れました。

（ご参考）

■ 投資信託証券別組入比率表

投資信託証券	（%）	
	期首	期末
外国債券インデックスマザーファンド	61.4	58.2
海外債券マザーファンド	—	4.8
新興国債券インデックスマザーファンド	3.7	3.6
グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）（※）	32.5	31.0

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する各投資信託証券の評価額の割合です。

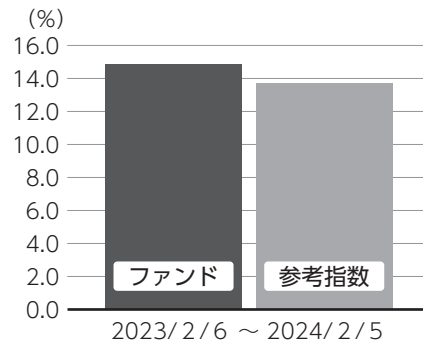
（※）グローバル社債マザーファンドへの投資を行います。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。

参考指数はF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第7期
	2023年2月7日～2024年2月5日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,623

（注）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）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。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

海外債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用方針を継続します。

引き続き、投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

2023年2月7日～2024年2月5日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	53	0.417	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(42)	(0.329)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(6)	(0.044)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(6)	(0.044)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.014	(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）	(1)	(0.010)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(1)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	55	0.431	

期中の平均基準価額は、12,664円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してありません。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

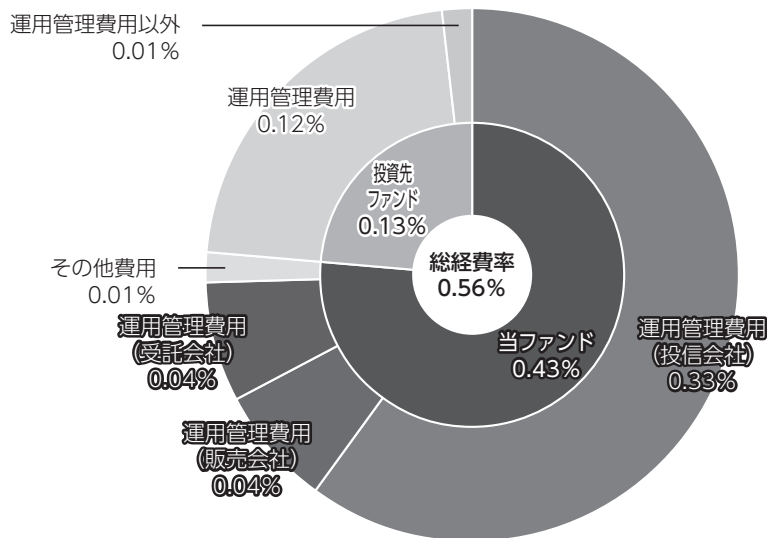
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

（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0.56%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	0.56
①当ファンドの費用の比率	(%)	0.43
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	0.12
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.01

(注) ①の費用は、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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

(注) 前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。

○売買及び取引の状況

(2023年2月7日～2024年2月5日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）	千口 375,170	千円 519,240	千口 421,617	千円 578,170

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	新興国債券インデックスマザーファンド	千口 22,032	千円 36,610	千口 20,576	千円 33,810
	海外債券マザーファンド	421,263	1,121,925	—	—
	外国債券インデックスマザーファンド	369,630	894,310	207,159	484,560

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月7日～2024年2月5日)

利害関係人との取引状況

<海外債券セクション（ラップ向け）>

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 519	百万円 519	% 100.0	百万円 578	百万円 578	% 100.0

<新興国債券インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 278	百万円 65	% 23.4	百万円 279	百万円 214	% 76.7
為替直物取引	22,979	8,283	36.0	14,903	4,352	29.2

平均保有割合 1.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

＜海外債券マザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 2,230	百万円 1,090	% 48.9	百万円 1,110	百万円 -	% -

平均保有割合 27.9%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 39,994	百万円 28,840	% 72.1	百万円 37,354	百万円 14,143	% 37.9
為替直物取引	127,100	48,725	38.3	54,948	38,319	69.7

平均保有割合 2.9%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年2月5日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
グローバル社債ファンドT (適格機関投資家専用)	千口 5,296,296	千口 5,249,850	千円 8,024,921	% 31.0
合 計	5,296,296	5,249,850	8,024,921	31.0

(注) 比率は海外債券セレクション（ラップ向け）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
新興国債券インデックスマザーファンド	千口 520,244	千口 521,700	千円 931,339
海外債券マザーファンド	-	421,263	1,237,251
外国債券インデックスマザーファンド	5,632,377	5,794,847	15,053,276

○投資信託財産の構成

（2024年2月5日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 8,024,921	% 30.9
新興国債券インデックスマザーファンド	931,339	3.6
海外債券マザーファンド	1,237,251	4.8
外国債券インデックスマザーファンド	15,053,276	57.9
コール・ローン等、その他	760,748	2.8
投資信託財産総額	26,007,535	100.0

(注) 新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（87,738,115千円）の投資信託財産総額（89,377,758千円）に対する比率は98.2%です。

(注) 海外債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（4,369,974千円）の投資信託財産総額（4,404,106千円）に対する比率は99.2%です。

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（538,281,793千円）の投資信託財産総額（551,013,125千円）に対する比率は97.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=148.76円	1 カナダドル=110.32円	1 アルゼンチンペソ=0.1798円	1 メキシコペソ=8.663円
1 ブラジルレアル=29.9263円	100チリペソ=15.6663円	100コロンビアペソ=3.7797円	1 ペルーヌエボソル=38.8175円
1 ウルグアイペソ=3.8051円	1 ドミニカペソ=2.528円	1 ユーロ=160.27円	1 イギリスポンド=187.56円
1 スイスフラン=171.44円	1 スウェーデンクローネ=14.13円	1 ノルウェークローネ=13.99円	1 セルビアディナール=1.368975円
1 デンマーククローネ=21.50円	1 トルコリラ=4.8867円	1 チェココルナ=6.4252円	100ハンガリーフォリント=41.7265円
1 ポーランドズロチ=37.0988円	1 ルーマニアレイ=32.2228円	1 オーストラリアドル=96.55円	1 ニュージーランドドル=90.03円
1 シンガポールドル=110.64円	1 マレーシアリンギット=31.2482円	1 タイバーツ=4.17円	100インドネシアルピア=0.95円
1 中国元=20.6714円	1 イスラエルシェケル=40.645円	1 エジプトポンド=4.8139円	1 南アフリカランド=7.85円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年2月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	26,007,535,626
コール・ローン等	760,746,309
投資信託受益証券(評価額)	8,024,921,607
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	931,339,925
海外債券マザーファンド(評価額)	1,237,251,689
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	15,053,276,096
(B) 負債	125,956,374
未払解約金	74,040,402
未払信託報酬	51,428,701
未払利息	110
その他未払費用	487,161
(C) 純資産総額(A - B)	25,881,579,252
元本	18,997,799,709
次期繰越損益金	6,883,779,543
(D) 受益権総口数	18,997,799,709口
1万口当たり基準価額(C / D)	13,623円

<注記事項>

- ①期首元本額 17,644,232,536円
 期中追加設定元本額 5,688,995,068円
 期中一部解約元本額 4,335,427,895円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,623円です。

②分配金の計算過程

項 目	2023年2月7日～ 2024年2月5日
費用控除後の配当等収益額	390,190,378円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	2,287,250,784円
収益調整金額	3,687,087,418円
分配準備積立金額	519,250,963円
当ファンドの分配対象収益額	6,883,779,543円
1万口当たり収益分配対象額	3,623円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

- ③「海外債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の45の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○損益の状況（2023年2月7日～2024年2月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 204,864
受取利息	4,711
支払利息	△ 209,575
(B) 有価証券売買損益	3,027,288,955
売買益	3,344,125,213
売買損	△ 316,836,258
(C) 信託報酬等	△ 97,930,497
(D) 当期損益金(A + B + C)	2,929,153,594
(E) 前期繰越損益金	267,538,531
(F) 追加信託差損益金	3,687,087,418
(配当等相当額)	(2,377,996,695)
(売買損益相当額)	(1,309,090,723)
(G) 計(D + E + F)	6,883,779,543
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G + H)	6,883,779,543
追加信託差損益金	3,687,087,418
(配当等相当額)	(2,382,262,724)
(売買損益相当額)	(1,304,824,694)
分配準備積立金	3,196,692,125

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①投資対象とする投資信託証券の入替えのため、投資対象とする投資信託証券を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年5月3日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)

外国債券インデックスマザーファンド

《第22期》決算日2023年5月12日

[計算期間：2022年5月13日～2023年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第22期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債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。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主 要 運 用 対 象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
18期(2019年5月13日)	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	—	137,361
19期(2020年5月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	—	149,310
20期(2021年5月12日)	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	—	197,147
21期(2022年5月12日)	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	—	302,225
22期(2023年5月12日)	23,421	1.2	130,897.72	1.2	98.5	—	438,949

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 5月12日	円	%	129,384.40	%	%	%
5月末	23,133	—	129,451.47	—	98.8	—
6月末	23,145	0.1	132,579.22	0.1	98.3	—
7月末	23,694	2.4	133,117.57	2.5	98.2	—
8月末	23,857	3.1	131,430.25	2.9	99.0	—
9月末	23,571	1.9	130,076.63	1.6	98.7	—
10月末	23,363	1.0	134,355.57	0.5	98.3	—
11月末	24,062	4.0	130,450.40	3.8	98.3	—
12月末	23,329	0.8	123,946.23	0.8	98.9	—
2023年 1月末	22,191	△4.1	125,559.33	△4.2	98.2	—
2月末	22,448	△3.0	126,903.56	△3.0	98.5	—
3月末	22,721	△1.8	128,532.24	△1.9	98.6	—
4月末	23,007	△0.5	129,370.99	△0.7	98.1	—
(期 末) 2023年 5月12日	23,176	0.2	130,897.72	△0.0	98.4	—
	23,421	1.2		1.2	98.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

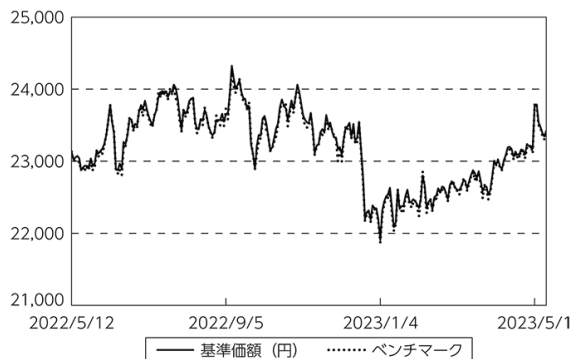
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.2%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

- ・ 先進国の債券市況は、欧米中銀による利上げペースの減速期待等を背景とした金利低下により上昇する局面もありましたが、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 期間の初めに比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.2%の上昇になったため、乖離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.011	(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 ）	(3)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.011	
期中の平均基準価額は、23,203円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月13日～2023年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	17,950	15,865	88.4	17,505	8,441	48.2
為替直物取引	196,034	146,825	74.9	65,531	51,698	78.9

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年5月12日現在)

外国公社債

(A)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		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 1,725,740	千アメリカドル 1,585,778	千円 213,493,402	% 48.6	% —	% 21.7	% 18.4	% 8.6
カナダ	千カナダドル 93,270	千カナダドル 87,764	8,758,059	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 545,340	千メキシコペソ 511,318	3,918,232	0.9	—	0.5	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	203,800	191,453	28,136,045	6.4	—	3.6	2.0	0.8
イタリア	242,400	225,270	33,105,693	7.5	—	4.1	2.4	1.0
フランス	274,010	251,800	37,004,556	8.4	—	5.1	2.5	0.7
オランダ	50,860	46,364	6,813,719	1.6	—	1.0	0.5	0.1
スペイン	158,430	147,621	21,694,488	4.9	—	2.9	1.4	0.7
ベルギー	60,410	55,255	8,120,366	1.8	—	1.2	0.5	0.1
オーストリア	40,920	36,636	5,384,081	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フィンランド	17,290	14,893	2,188,808	0.5	—	0.3	0.1	0.0
アイルランド	20,230	17,963	2,639,842	0.6	—	0.5	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 146,500	千イギリスポンド 123,149	20,750,700	4.7	—	3.5	1.0	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 67,170	千スウェーデンクローネ 64,325	838,161	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 56,330	千ノルウェークローネ 52,631	664,205	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 72,140	千デンマーククローネ 66,811	1,318,191	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 69,250	千ポーランドズロチ 60,864	1,970,642	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 80,430	千オーストラリアドル 74,871	6,755,640	1.5	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 13,330	千ニュージーランドドル 11,834	1,003,059	0.2	—	0.2	0.0	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 18,890	千シンガポールドル 18,858	1,906,986	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 78,500	千マレーシアリンギット 80,507	2,420,296	0.6	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 1,120,000	千中国元 1,144,058	22,153,430	5.0	—	2.4	1.8	0.8
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,870	千イスラエルシェケル 30,468	1,125,216	0.3	—	0.2	0.0	0.1
合 計	—	—	432,163,832	98.5	—	51.2	32.9	14.4

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 240615	0.25	7,100	6,774	912,093	2024/6/15
		0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,000	4,644	625,319	2025/5/31
		0.25 T-NOTE 250630	0.25	6,650	6,172	831,027	2025/6/30
		0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,800	5,365	722,305	2025/7/31
		0.25 T-NOTE 250831	0.25	4,200	3,876	521,922	2025/8/31
		0.25 T-NOTE 250930	0.25	7,600	7,009	943,711	2025/9/30
		0.25 T-NOTE 251031	0.25	10,300	9,465	1,274,372	2025/10/31
		0.375 T-NOTE 240715	0.375	6,200	5,910	795,725	2024/7/15
		0.375 T-NOTE 240815	0.375	7,200	6,845	921,645	2024/8/15
		0.375 T-NOTE 240915	0.375	12,000	11,387	1,533,046	2024/9/15
		0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,670	4,359	586,909	2025/4/30
		0.375 T-NOTE 251130	0.375	10,150	9,339	1,257,335	2025/11/30
		0.375 T-NOTE 251231	0.375	8,500	7,816	1,052,381	2025/12/31
		0.375 T-NOTE 260131	0.375	7,700	7,054	949,730	2026/1/31
		0.375 T-NOTE 270731	0.375	7,150	6,298	848,013	2027/7/31
		0.375 T-NOTE 270930	0.375	7,300	6,401	861,849	2027/9/30
		0.5 T-NOTE 250331	0.5	6,500	6,097	820,931	2025/3/31
		0.5 T-NOTE 260228	0.5	7,900	7,249	975,935	2026/2/28
		0.5 T-NOTE 270430	0.5	5,280	4,707	633,777	2027/4/30
		0.5 T-NOTE 270531	0.5	4,280	3,807	512,596	2027/5/31
		0.5 T-NOTE 270630	0.5	4,700	4,172	561,711	2027/6/30
		0.5 T-NOTE 270831	0.5	4,950	4,375	589,012	2027/8/31
		0.5 T-NOTE 271031	0.5	7,900	6,951	935,926	2027/10/31
		0.625 T-NOTE 241015	0.625	7,400	7,029	946,371	2024/10/15
		0.625 T-NOTE 260731	0.625	7,930	7,233	973,886	2026/7/31
		0.625 T-NOTE 270331	0.625	1,800	1,617	217,698	2027/3/31
		0.625 T-NOTE 271130	0.625	7,550	6,672	898,253	2027/11/30
		0.625 T-NOTE 271231	0.625	7,630	6,729	905,925	2027/12/31
		0.625 T-NOTE 300515	0.625	12,090	10,048	1,352,815	2030/5/15
		0.625 T-NOTE 300815	0.625	15,160	12,532	1,687,245	2030/8/15
		0.75 T-NOTE 241115	0.75	6,700	6,362	856,638	2024/11/15
		0.75 T-NOTE 260331	0.75	8,100	7,483	1,007,565	2026/3/31
		0.75 T-NOTE 260430	0.75	7,000	6,446	867,955	2026/4/30
		0.75 T-NOTE 260531	0.75	8,200	7,536	1,014,613	2026/5/31
		0.75 T-NOTE 260831	0.75	7,600	6,945	935,097	2026/8/31
		0.75 T-NOTE 280131	0.75	8,850	7,838	1,055,247	2028/1/31
		0.875 T-NOTE 260630	0.875	8,300	7,652	1,030,217	2026/6/30
		0.875 T-NOTE 260930	0.875	10,000	9,167	1,234,283	2026/9/30
		0.875 T-NOTE 301115	0.875	17,730	14,903	2,006,423	2030/11/15
		1 T-NOTE 241215	1.0	8,000	7,613	1,025,060	2024/12/15
		1 T-NOTE 280731	1.0	9,150	8,109	1,091,788	2028/7/31
		1.125 T-BOND 400515	1.125	6,020	4,027	542,193	2040/5/15
		1.125 T-BOND 400815	1.125	7,350	4,873	656,182	2040/8/15
		1.125 T-NOTE 250115	1.125	6,000	5,711	768,905	2025/1/15
		1.125 T-NOTE 250228	1.125	4,150	3,943	530,866	2025/2/28
		1.125 T-NOTE 261031	1.125	7,600	7,013	944,230	2026/10/31

銘柄		利 率	当 期 末			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		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 270228	1.125	2,950	2,708	364,664	2027/2/28
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	8,660	7,798	1,049,966	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	8,500	7,570	1,019,191	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	14,760	12,616	1,698,537	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	8,900	5,104	687,284	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 240831	1.25	9,500	9,126	1,228,724	2024/8/31
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	10,200	9,440	1,271,011	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 261231	1.25	8,200	7,578	1,020,306	2026/12/31
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	9,950	8,997	1,211,315	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280430	1.25	8,150	7,357	990,597	2028/4/30
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	11,250	10,140	1,365,258	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	8,480	7,630	1,027,228	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	12,200	10,916	1,469,704	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	17,720	15,073	2,029,381	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	8,100	5,593	753,022	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	10,130	5,994	807,093	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	5,320	5,083	684,364	2025/1/31
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	2,000	1,866	251,237	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	8,250	7,420	999,063	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 281231	1.375	8,700	7,809	1,051,407	2028/12/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	16,700	14,275	1,921,875	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 240930	1.5	6,000	5,776	777,693	2024/9/30
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	4,100	3,940	530,539	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	6,430	6,174	831,297	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 250215	1.5	6,300	6,027	811,442	2025/2/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	9,740	9,132	1,229,493	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	11,540	10,750	1,447,303	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	7,650	6,918	931,473	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	8,740	7,769	1,046,037	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	10,140	6,413	863,402	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	9,760	9,247	1,245,055	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	7,670	7,245	975,455	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	2,100	1,974	265,853	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	3,350	3,146	423,659	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,190	429,472	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	6,050	5,466	735,955	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	15,460	13,633	1,835,516	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	11,370	8,254	1,111,313	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	3,500	3,392	456,746	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,150	4,984	671,054	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 241231	1.75	3,350	3,224	434,150	2024/12/31
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	9,030	8,670	1,167,365	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	4,300	4,047	544,909	2026/12/31
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	7,300	6,677	899,049	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	5,150	4,684	630,726	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	10,800	8,096	1,089,991	2041/2/15
	1.875 T-BOND 510215	1.875	11,310	7,627	1,026,906	2051/2/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.875 T-BOND 511115	1.875	10,450	7,011	943,985	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 260630	1.875	3,500	3,327	448,022	2026/6/30
	1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,500	2,374	319,634	2026/7/31
	1.875 T-NOTE 270228	1.875	7,700	7,265	978,177	2027/2/28
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	8,800	8,102	1,090,797	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	17,060	15,149	2,039,610	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	9,250	6,998	942,143	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	8,090	5,669	763,260	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	11,240	7,795	1,049,456	2051/8/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	11,730	11,411	1,536,353	2024/5/31
	2 T-NOTE 240630	2.0	7,000	6,803	915,978	2024/6/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	8,110	7,829	1,054,103	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	11,490	11,046	1,487,198	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	9,550	9,079	1,222,435	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	3,450	3,354	451,609	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	6,800	6,603	889,092	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	1,841	247,958	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	6,970	6,730	906,187	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	5,000	4,792	645,264	2026/5/31
	2.25 T-BOND 410515	2.25	8,940	7,112	957,537	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	5,490	4,126	555,493	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	6,330	4,713	634,595	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	9,580	7,048	948,877	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,380	2,312	311,370	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	6,450	6,264	843,448	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	6,900	6,695	901,405	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	10,290	9,930	1,336,909	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	4,500	4,336	583,826	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	6,810	6,520	877,829	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,190	5,906	795,174	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	7,290	6,940	934,335	2027/11/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	7,780	6,261	843,051	2042/2/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	6,100	4,663	627,898	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	11,720	8,893	1,197,265	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	7,590	7,401	996,435	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 260430	2.375	4,500	4,348	585,470	2026/4/30
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	7,070	6,790	914,206	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	6,200	5,862	789,302	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	7,480	7,066	951,429	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	4,029	542,524	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	4,030	3,192	429,787	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,830	3,031	408,155	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	11,950	11,695	1,574,529	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 240531	2.5	6,000	5,867	789,992	2024/5/31
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	3,350	3,263	439,303	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,347	450,630	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	9,200	8,883	1,195,922	2027/3/31

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			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		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,960	1,913	257,556	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 250415	2.625	4,000	3,902	525,362	2025/4/15
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	3,200	3,116	419,557	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	3,900	3,797	511,233	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 270531	2.625	7,900	7,656	1,030,734	2027/5/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	10,420	9,999	1,346,182	2029/2/15
	2.625 T-NOTE 290731	2.625	5,600	5,360	721,621	2029/7/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,120	1,809	243,662	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	3,100	2,638	355,190	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	5,160	4,263	573,988	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	5,110	4,223	568,560	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	3,440	3,365	453,032	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250515	2.75	6,400	6,257	842,497	2025/5/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	2,370	2,316	311,856	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	8,250	8,065	1,085,836	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	9,700	9,448	1,272,038	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 270731	2.75	7,650	7,447	1,002,662	2027/7/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	9,990	9,710	1,307,389	2028/2/15
	2.75 T-NOTE 290531	2.75	5,500	5,306	714,375	2029/5/31
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	15,810	15,016	2,021,701	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,880	4,224	568,787	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	3,500	2,977	400,809	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	2,340	1,984	267,126	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	7,270	6,171	830,837	2049/5/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	8,920	7,536	1,014,666	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	6,000	5,879	791,561	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250531	2.875	4,230	4,145	558,139	2025/5/31
	2.875 T-NOTE 250615	2.875	7,800	7,647	1,029,542	2025/6/15
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	6,100	5,979	805,074	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	3,723	501,322	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	8,990	8,777	1,181,720	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	9,110	8,885	1,196,296	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 290430	2.875	7,000	6,801	915,739	2029/4/30
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	14,680	14,107	1,899,359	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,920	1,710	230,277	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,560	3,107	418,324	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	2,190	1,906	256,671	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	2,300	1,998	269,092	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	4,210	3,645	490,850	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	3,390	2,934	395,049	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,800	5,022	676,140	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	6,770	5,865	789,646	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	7,090	6,158	829,077	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	8,670	7,518	1,012,217	2052/8/15
	3 T-NOTE 240630	3.0	4,100	4,029	542,549	2024/6/30
	3 T-NOTE 240731	3.0	6,000	5,895	793,691	2024/7/31
	3 T-NOTE 250715	3.0	6,700	6,584	886,411	2025/7/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-NOTE 250930	3.0	5,400	5,306	714,393	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,300	3,242	436,590	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,990	1,816	244,612	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	2,200	2,003	269,749	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,850	2,571	346,180	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	4,130	3,688	496,618	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	6,010	5,325	716,930	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	5,000	4,927	663,420	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	7,300	7,214	971,281	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	8,280	8,164	1,099,234	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	5,900	5,809	782,122	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	6,580	6,082	818,941	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 240831	3.25	7,400	7,293	981,960	2024/8/31
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	6,300	6,254	842,023	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	6,700	6,643	894,445	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	6,300	5,923	797,477	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,160	2,943	396,232	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,620	6,146	827,540	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	760	755	101,665	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	5,100	5,070	682,697	2025/9/15
	3.5 T-NOTE 280131	3.5	8,300	8,343	1,123,278	2028/1/31
	3.5 T-NOTE 300131	3.5	5,100	5,135	691,413	2030/1/31
	3.5 T-NOTE 330215	3.5	15,100	15,233	2,050,859	2033/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	3,500	3,405	458,486	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,770	3,652	491,713	2044/2/15
	3.625 T-BOND 530215	3.625	8,690	8,512	1,145,987	2053/2/15
	3.625 T-NOTE 280331	3.625	4,500	4,552	612,887	2028/3/31
	3.625 T-NOTE 300331	3.625	6,500	6,603	889,041	2030/3/31
	3.75 T-BOND 410815	3.75	2,060	2,059	277,218	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,450	3,415	459,883	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 260415	3.75	7,000	7,030	946,533	2026/4/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,870	1,922	258,819	2040/8/15
	3.875 T-BOND 430215	3.875	4,290	4,325	582,390	2043/2/15
	3.875 T-NOTE 250331	3.875	5,000	4,990	671,900	2025/3/31
	3.875 T-NOTE 260115	3.875	6,700	6,735	906,760	2026/1/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	6,900	7,042	948,088	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 271231	3.875	7,000	7,144	961,920	2027/12/31
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	5,100	5,238	705,226	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	5,100	5,243	705,950	2029/11/30
	3.875 T-NOTE 291231	3.875	5,700	5,864	789,573	2029/12/31
	4 T-BOND 421115	4.0	6,370	6,548	881,578	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	8,950	9,387	1,263,867	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	5,700	5,745	773,521	2025/12/15
	4 T-NOTE 260215	4.0	8,000	8,075	1,087,179	2026/2/15
	4 T-NOTE 280229	4.0	6,000	6,170	830,688	2028/2/29
	4 T-NOTE 291031	4.0	5,500	5,692	766,323	2029/10/31
	4 T-NOTE 300228	4.0	5,000	5,187	698,340	2030/2/28

銘柄	当 期 末					
	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		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	4.125 T-NOTE 250131	4.125	5,000	5,002	673,504	2025/1/31
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	5,900	6,068	816,967	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	6,500	6,690	900,681	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	14,300	15,142	2,038,615	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,770	1,917	258,187	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	2,180	2,346	315,975	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 240930	4.25	2,200	2,197	295,896	2024/9/30
	4.25 T-NOTE 241231	4.25	5,200	5,207	701,060	2024/12/31
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	6,000	6,069	817,104	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	1,000	1,100	148,190	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,930	2,115	284,794	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,080	2,278	306,709	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,760	1,918	258,329	2041/5/15
	4.375 T-NOTE 241031	4.375	4,000	4,006	539,371	2024/10/31
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,160	1,298	174,755	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,530	1,704	229,527	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,880	2,095	282,161	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 241130	4.5	9,000	9,038	1,216,876	2024/11/30
	4.5 T-NOTE 251115	4.5	8,700	8,861	1,192,967	2025/11/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,100	2,371	319,289	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 250228	4.625	8,000	8,083	1,088,252	2025/2/28
	4.625 T-NOTE 260315	4.625	6,000	6,166	830,214	2026/3/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,010	2,297	309,262	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,020	1,195	160,997	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	2,690	2,937	395,427	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	2,300	2,619	352,721	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,200	1,274	171,621	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,160	1,292	173,953	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,150	1,356	182,574	2030/5/15
小 計					213,493,402	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	0.25	2,200	2,020	201,580	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,900	2,707	270,149	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	5,800	4,897	488,756	2030/12/1
	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	3,500	3,351	334,488	2024/10/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,930	1,789	178,535	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	2,100	2,012	200,792	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	2,500	2,337	233,295	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	3,510	3,165	315,839	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	1,937	193,369	2024/9/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	960	95,846	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	4,070	3,872	386,410	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	5,900	5,347	533,639	2031/6/1
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	4,270	3,849	384,146	2031/12/1
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	4,500	3,395	338,870	2053/12/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	670	644	64,310	2028/6/1
	2 CAN GOVT 320601	2.0	3,750	3,506	349,954	2032/6/1

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円			
カナダ								
	国債証券	2 CAN GOVT 511201	2.0	6,060	4,902	489,251	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	4,360	4,248	423,931	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,210	2,147	214,267	2029/6/1	
		2.25 CAN GOVT 291201	2.25	1,000	969	96,771	2029/12/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	4,000	3,933	392,482	2024/6/1	
		2.5 CAN GOVT 321201	2.5	2,800	2,723	271,818	2032/12/1	
		2.75 CAN GOVT 270901	2.75	2,000	1,979	197,540	2027/9/1	
		2.75 CAN GOVT 330601	2.75	2,300	2,283	227,860	2033/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,680	1,603	160,009	2048/12/1	
		2.75 CAN GOVT 551201	2.75	450	425	42,423	2055/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	1,250	1,177	117,481	2064/12/1	
		3 CAN GOVT 251001	3.0	3,000	2,965	295,929	2025/10/1	
		3.5 CAN GOVT 280301	3.5	2,000	2,049	204,552	2028/3/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,650	1,775	177,197	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 250501	3.75	3,500	3,507	349,965	2025/5/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,200	1,359	135,700	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	830	1,020	101,876	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,105	110,284	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,430	1,791	178,728	2033/6/1	
	小 計					8,758,059		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	58,650	58,093	445,168	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	12,350	13,566	103,959	2036/11/20	
		5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	49,000	44,787	343,210	2025/3/6	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	34,000	30,188	231,335	2027/3/4	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	65,500	59,562	456,428	2026/3/5	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	48,750	46,332	355,042	2027/6/3	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	10,000	9,167	70,250	2033/5/26	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	68,050	64,052	490,830	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	13,400	12,423	95,198	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	35,190	31,065	238,056	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	12,000	11,592	88,836	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	39,100	35,273	270,299	2047/11/7	
		8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	20,500	18,355	140,655	2053/7/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	39,150	38,674	296,361	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	39,700	38,183	292,599	2038/11/18	
	小 計					3,918,232		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	5,930	5,513	810,320	2026/8/15
			0 BUND 271115	—	3,100	2,816	413,874	2027/11/15
			0 BUND 281115	—	4,400	3,916	575,623	2028/11/15
			0 BUND 290815	—	4,550	3,989	586,325	2029/8/15
			0 BUND 300215	—	4,120	3,575	525,454	2030/2/15
			0 BUND 300815	—	4,960	4,260	626,140	2030/8/15
			0 BUND 300815	—	650	559	82,209	2030/8/15
			0 BUND 310215	—	3,700	3,143	461,944	2031/2/15
			0 BUND 310815	—	5,400	4,537	666,758	2031/8/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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	
ドイツ	国債証券	0 BUND 310815	—	1,900	1,598	234,907	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	4,690	3,892	572,113	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	3,630	2,757	405,247	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	3,800	2,804	412,216	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	5,350	2,863	420,788	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	1,560	838	123,160	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	3,690	1,878	276,115	2052/8/15
		0 OBL 241018	—	4,400	4,235	622,388	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	2,800	2,669	392,349	2025/4/11
		0 OBL 251010	—	4,000	3,775	554,809	2025/10/10
		0 OBL 251010	—	1,000	945	138,897	2025/10/10
		0 OBL 260410	—	3,700	3,460	508,607	2026/4/10
		0 OBL 261009	—	2,900	2,687	394,928	2026/10/9
		0 OBL 270416	—	3,050	2,800	411,502	2027/4/16
		0.2 SCHATS 240614	0.2	3,800	3,693	542,814	2024/6/14
		0.25 BUND 270215	0.25	4,490	4,177	613,965	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	4,170	3,782	555,841	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	4,050	3,641	535,193	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	7,110	6,862	1,008,450	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	6,660	6,336	931,189	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	5,120	4,777	702,174	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	4,280	3,965	582,802	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	3,600	3,523	517,829	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	5,580	5,403	794,025	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	2,260	1,860	273,467	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	5,740	4,558	669,913	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	4,050	3,901	573,399	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	2,500	2,415	354,992	2027/10/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,460	2,428	356,835	2024/5/15
		1.7 BUND 320815	1.7	3,750	3,601	529,228	2032/8/15
		1.8 BUND 530815	1.8	1,850	1,609	236,586	2053/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	3,800	3,786	556,438	2029/11/15
		2.2 OBL 280413	2.2	2,250	2,253	331,167	2028/4/13
		2.3 BUND 330215	2.3	3,450	3,472	510,388	2033/2/15
2.5 BUND 440704	2.5	4,730	4,803	705,952	2044/7/4		
2.5 BUND 460815	2.5	4,600	4,706	691,708	2046/8/15		
2.5 SCHATS 250313	2.5	1,000	998	146,750	2025/3/13		
3.25 BUND 420704	3.25	2,880	3,238	475,874	2042/7/4		
4 BUND 370104	4.0	4,040	4,798	705,173	2037/1/4		
4.25 BUND 390704	4.25	2,710	3,366	494,684	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	2,340	2,636	387,422	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	3,550	4,411	648,331	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	3,430	4,539	667,152	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	4,280	5,279	775,918	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	2,540	2,926	430,052	2028/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	1,700	2,130	313,061	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,750	2,045	300,575	2027/7/4		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240815	—	2,500	2,400	352,760	2024/8/15
		0 ITALY GOVT 241215	—	2,000	1,901	279,446	2024/12/15
		0 ITALY GOVT 260401	—	3,300	3,002	441,221	2026/4/1
		0 ITALY GOVT 260801	—	2,500	2,248	330,497	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	2,700	2,314	340,204	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	3,060	2,914	428,360	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	2,300	1,922	282,584	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,450	2,273	334,101	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	2,400	2,059	302,672	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	3,100	2,388	350,941	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	3,060	2,798	411,291	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,830	2,263	332,581	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	4,000	3,606	530,025	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	2,500	2,052	301,635	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,730	2,143	314,963	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,600	2,008	295,116	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	2,560	1,683	247,418	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	3,300	3,028	445,099	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	2,100	2,007	295,021	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,680	2,495	366,790	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	3,610	3,085	453,375	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,400	2,337	343,564	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	2,300	2,222	326,691	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	2,140	1,547	227,364	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	3,300	3,188	468,581	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	2,010	1,196	175,806	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,620	2,490	366,022	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	3,870	3,315	487,285	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	4,450	3,698	543,507	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	2,390	1,366	200,873	2051/9/1
1.75 ITALY GOVT 240530	1.75	2,500	2,458	361,230	2024/5/30		
1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	3,000	2,947	433,111	2024/7/1		
1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	2,240	1,522	223,777	2041/3/1		
1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,870	1,843	270,863	2024/5/15		
1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	2,400	2,335	343,276	2025/7/1		
2 ITALY GOVT 251201	2.0	3,530	3,422	502,929	2025/12/1		
2 ITALY GOVT 280201	2.0	4,580	4,291	630,619	2028/2/1		
2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,650	3,458	508,225	2027/8/1		
2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	2,350	2,264	332,791	2026/7/15		
2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	2,150	1,346	197,876	2052/9/1		
2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	850	476	70,093	2072/3/1		
2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,000	1,911	280,938	2027/6/1		
2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	2,720	2,156	316,973	2036/9/1		
2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,870	2,468	362,739	2033/9/1		
2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	2,490	1,704	250,512	2050/9/1		
2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,360	3,322	488,346	2024/12/1		
2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,330	2,289	336,478	2025/11/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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	
イタリア	国債証券	2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	2,850	2,507	368,527	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	2,800	2,707	397,836	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,630	1,966	289,046	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	4,680	4,500	661,365	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	3,200	3,046	447,649	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,620	1,104	162,319	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,380	2,000	293,972	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	3,400	3,275	481,354	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,890	1,590	233,765	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	1,340	1,171	172,155	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,740	2,263	332,685	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	3,110	2,842	417,757	2035/3/1
		3.4 ITALY GOVT 250328	3.4	2,300	2,303	338,489	2025/3/28
		3.4 ITALY GOVT 280401	3.4	1,500	1,491	219,225	2028/4/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	2,820	2,388	350,949	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	2,500	2,511	369,089	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,670	3,621	532,223	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	4,230	4,255	625,351	2024/9/1
		3.8 ITALY GOVT 260415	3.8	1,500	1,518	223,112	2026/4/15
		3.85 ITALY GOVT 291215	3.85	2,600	2,613	384,104	2029/12/15
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,950	1,750	257,243	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 311030	4.0	2,400	2,415	354,970	2031/10/30
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	1,150	1,119	164,528	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	4,300	4,152	610,221	2037/2/1
		4.4 ITALY GOVT 330501	4.4	2,900	2,975	437,283	2033/5/1
		4.45 ITALY GOVT 430901	4.45	1,200	1,182	173,847	2043/9/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	3,740	3,858	567,090	2026/3/1
		4.5 ITALY GOVT 531001	4.5	700	688	101,135	2053/10/1
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,930	4,156	610,819	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,650	2,726	400,624	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	4,280	4,409	647,995	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	3,850	4,108	603,720	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	3,980	4,230	621,784	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,600	3,828	562,656	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,110	4,486	659,368	2029/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	3,820	4,326	635,802	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	5,230	5,998	881,505	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,900	4,398	646,453	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,300	2,592	381,064	2026/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 250225	—	2,900	2,764	406,245	2025/2/25
		0 O. A. T 250325	—	7,380	7,023	1,032,170	2025/3/25
		0 O. A. T 260225	—	6,600	6,149	903,723	2026/2/25
		0 O. A. T 270225	—	6,130	5,581	820,236	2027/2/25
		0 O. A. T 291125	—	6,380	5,408	794,835	2029/11/25
		0 O. A. T 301125	—	8,390	6,904	1,014,661	2030/11/25
		0 O. A. T 311125	—	9,100	7,263	1,067,495	2031/11/25
		0 O. A. T 320525	—	5,430	4,265	626,864	2032/5/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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	国債証券	0.25 O.A.T 261125	0.25	5,680	5,246	771,017	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	6,490	6,214	913,327	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	7,530	7,084	1,041,145	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	9,570	8,488	1,247,470	2029/5/25
		0.5 O.A.T 400525	0.5	4,390	2,869	421,699	2040/5/25
		0.5 O.A.T 440625	0.5	2,730	1,625	238,845	2044/6/25
		0.5 O.A.T 720525	0.5	1,500	588	86,455	2072/5/25
		0.75 O.A.T 280225	0.75	7,400	6,812	1,001,195	2028/2/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	8,850	8,115	1,192,646	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	8,360	7,600	1,116,993	2028/11/25
		0.75 O.A.T 520525	0.75	4,710	2,546	374,274	2052/5/25
		0.75 O.A.T 530525	0.75	5,540	2,915	428,486	2053/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	6,580	6,327	929,825	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	6,260	5,899	866,919	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	6,390	5,413	795,576	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	7,070	5,745	844,380	2036/5/25
		1.25 O.A.T 380525	1.25	2,000	1,558	229,087	2038/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	8,560	7,883	1,158,504	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	5,230	3,618	531,767	2050/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	6,520	6,420	943,547	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	4,550	3,790	557,053	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	2,590	1,762	258,964	2066/5/25
		2 O.A.T 321125	2.0	6,650	6,242	917,410	2032/11/25
		2 O.A.T 480525	2.0	4,650	3,680	540,944	2048/5/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	6,190	6,141	902,573	2024/5/25
		2.5 O.A.T 260924	2.5	1,800	1,794	263,688	2026/9/24
		2.5 O.A.T 300525	2.5	9,590	9,548	1,403,274	2030/5/25
		2.5 O.A.T 430525	2.5	1,330	1,188	174,734	2043/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	8,490	8,572	1,259,758	2027/10/25
		2.75 O.A.T 290225	2.75	1,500	1,513	222,404	2029/2/25
3 O.A.T 330525	3.0	1,000	1,017	149,510	2033/5/25		
3 O.A.T 540525	3.0	700	656	96,524	2054/5/25		
3.25 O.A.T 450525	3.25	4,710	4,733	695,630	2045/5/25		
3.5 O.A.T 260425	3.5	6,690	6,867	1,009,211	2026/4/25		
4 O.A.T 381025	4.0	4,020	4,455	654,728	2038/10/25		
4 O.A.T 550425	4.0	3,090	3,521	517,504	2055/4/25		
4 O.A.T 600425	4.0	2,740	3,158	464,215	2060/4/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	5,580	6,593	968,928	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	4,800	5,669	833,178	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	5,820	6,747	991,656	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	5,090	6,356	934,224	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	8,760	9,451	1,389,037	2025/10/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	2,200	2,059	302,633	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	1,950	1,785	262,400	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,300	1,134	166,795	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	2,650	2,227	327,325	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	1,620	1,325	194,824	2031/7/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 380115	—	1,540	1,036	152,279	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	2,830	1,367	200,946	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,930	1,838	270,232	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	2,950	2,587	380,322	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	3,970	3,737	549,212	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	2,300	1,921	282,399	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	2,630	1,852	272,268	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,670	2,497	366,962	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	3,020	2,780	408,591	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,900	2,875	422,604	2024/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	960	825	121,366	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	2,250	2,241	329,426	2033/1/15
		2.5 NETH GOVT 330715	2.5	650	647	95,165	2033/7/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	3,270	3,319	487,794	2047/1/15
3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,690	3,078	452,480	2042/1/15		
4 NETH GOVT 370115	4.0	3,100	3,546	521,142	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,480	1,677	246,543	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	5,600	5,421	796,703	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	3,630	3,459	508,362	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,359	346,704	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	3,000	2,781	408,757	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	2,800	2,522	370,686	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	3,800	3,325	488,764	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	4,360	3,451	507,263	2031/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 240730	0.25	2,700	2,610	383,663	2024/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	3,580	3,023	444,297	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	2,490	2,007	295,039	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	3,680	3,173	466,450	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	3,800	3,073	451,612	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	4,850	4,460	655,496	2027/7/30
		0.8 SPAIN GOVT 290730	0.8	2,530	2,218	325,996	2029/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,850	1,284	188,762	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	1,350	843	124,033	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	3,100	1,627	239,236	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,730	1,846	271,387	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,230	2,844	417,960	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	3,650	3,472	510,295	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	3,740	3,487	512,537	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	4,240	3,935	578,430	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	3,330	3,135	460,789	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,300	3,036	446,210	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	950	450	66,268	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,290	3,128	459,734	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	3,510	3,429	503,970	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	4,200	3,532	519,193	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,700	1,104	162,248	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,520	3,435	504,946	2026/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	3,790	3,525	518,084	2030/7/30
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	3,110	2,857	419,880	2033/7/30
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	4,190	3,955	581,285	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	2,610	2,126	312,526	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	5,400	5,386	791,668	2024/10/31
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	1,500	1,496	219,943	2026/5/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,990	2,576	378,622	2046/10/31
		3.15 SPAIN GOVT 330430	3.15	3,000	2,960	435,128	2033/4/30
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	1,820	1,718	252,544	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	2,230	2,001	294,088	2066/7/30
		3.9 SPAIN GOVT 390730	3.9	1,050	1,071	157,489	2039/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	3,460	3,696	543,292	2037/1/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,890	3,001	441,166	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	3,200	3,593	528,043	2041/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,930	3,367	494,927	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,500	2,774	407,795	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,390	2,851	419,084	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	3,480	4,188	615,520	2032/7/30
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	4,650	5,080	746,640	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	4,230	4,905	720,949	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	1,800	1,610	236,683	2027/10/22
		0 BEL GOVT 311022	—	1,700	1,347	197,974	2031/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	2,520	2,108	309,935	2030/6/22
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	2,450	1,964	288,704	2032/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	1,300	816	119,980	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	2,190	2,121	311,709	2024/10/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	910	376	55,383	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,970	2,861	420,502	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	2,880	2,686	394,872	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,250	2,067	303,868	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	3,090	2,804	412,121	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	2,760	2,634	387,142	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	2,850	2,494	366,574	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,770	1,530	224,967	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	2,120	1,338	196,754	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	1,220	986	144,957	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,570	1,122	164,917	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,540	1,092	160,501	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,360	1,150	169,144	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	1,090	813	119,527	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	1,020	798	117,295	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,180	2,171	319,076	2024/6/22
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	950	893	131,235	2039/4/22
		3 BEL GOVT 330622	3.0	1,300	1,308	192,269	2033/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,230	1,231	180,935	2034/6/22
		3.3 BEL GOVT 540622	3.3	800	778	114,341	2054/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,620	1,727	253,854	2045/6/22

銘柄			当 期 末				償還年月日
			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	
ベルギー	国債証券	4 BEL GOVT 320328	4.0	1,250	1,364	200,496	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,780	3,142	461,824	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,610	1,695	249,137	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,950	3,513	516,385	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,380	2,703	397,291	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	—	800	760	111,721	2025/4/20
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	900	781	114,883	2028/10/20
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	2,150	1,794	263,772	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	2,130	1,722	253,204	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	810	475	69,882	2040/10/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	1,050	731	107,449	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	2,300	2,125	312,375	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	2,050	1,819	267,432	2029/2/20
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	680	306	45,076	2071/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	2,480	2,336	343,368	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,690	1,553	228,284	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	1,180	676	99,392	2051/3/20
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	650	275	40,550	2120/6/30
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	2,120	1,805	265,399	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	2,710	2,623	385,589	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	1,430	1,052	154,681	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	460	275	40,543	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	2,510	2,472	363,345	2024/10/21
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	870	676	99,487	2049/5/23
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	1,000	984	144,649	2026/7/15
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	810	595	87,574	2117/9/20
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,300	1,236	181,643	2034/5/23		
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	2.9	700	709	104,204	2029/5/23		
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2.9	1,000	1,000	147,045	2033/2/20		
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	1,250	1,258	184,992	2044/6/20		
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	700	811	119,190	2062/1/26		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	2,190	2,454	360,749	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,370	1,457	214,153	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,630	1,860	273,437	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	850	820	120,527	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	750	616	90,586	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	1,070	862	126,796	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	510	353	51,993	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	750	347	51,028	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	540	337	49,626	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	1,670	1,578	231,987	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	700	642	94,474	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	1,480	1,329	195,396	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	720	631	92,787	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	480	297	43,709	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	1,050	902	132,608	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	630	606	89,141	2025/9/15

銘柄	銘柄		当 期 末				償還年月日
			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	
フィンランド	国債証券	1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	730	608	89,490	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	800	766	112,693	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	840	615	90,449	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	750	670	98,513	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	940	884	129,929	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	1,110	1,121	164,825	2028/7/4
		2.75 FINNISH GOV 380415	2.75	680	652	95,928	2038/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	240	247	36,313	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	1,350	1,083	159,185	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	500	456	67,119	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	620	522	76,794	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	400	323	47,514	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	700	527	77,497	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	1,000	650	95,664	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,640	1,521	223,550	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,850	1,771	260,284	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,610	1,488	218,729	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	860	753	110,667	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,070	978	143,839	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	1,160	809	118,954	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,190	1,015	149,305	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,640	1,338	196,708	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	2,090	2,078	305,454	2030/5/15
		3 IRISH GOVT 431018	3.0	450	440	64,761	2043/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	2,100	2,203	323,811	2025/3/13
小 計						145,087,603	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
イギリス	国債証券	0.125 GILT 260130	0.125	2,600	2,366	398,679	2026/1/30
		0.125 GILT 280131	0.125	2,300	1,956	329,750	2028/1/31
		0.25 GILT 250131	0.25	4,100	3,838	646,753	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	4,460	3,402	573,244	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	3,750	3,345	563,632	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	2,390	1,895	319,335	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	4,900	4,104	691,613	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	2,550	844	142,341	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,880	2,703	455,463	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	4,030	2,772	467,225	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,590	689	116,212	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	2,320	1,967	331,506	2029/10/22
		0.875 GILT 330731	0.875	2,350	1,785	300,798	2033/7/31
		0.875 GILT 460131	0.875	2,420	1,267	213,520	2046/1/31
		1 GILT 320131	1.0	5,100	4,099	690,831	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	3,550	2,356	396,991	2039/1/31
		1.125 GILT 731022	1.125	1,500	613	103,397	2073/10/22
		1.25 GILT 270722	1.25	2,100	1,910	321,925	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	3,750	2,386	402,145	2041/10/22
		1.25 GILT 510731	1.25	3,480	1,835	309,202	2051/7/31

銘柄		利率	当期末			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		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券					
	1.5 GILT 260722	1.5	2,490	2,328	392,305	2026/7/22
	1.5 GILT 470722	1.5	3,160	1,893	319,060	2047/7/22
	1.5 GILT 530731	1.5	1,250	691	116,585	2053/7/31
	1.625 GILT 281022	1.625	1,790	1,621	273,188	2028/10/22
	1.625 GILT 541022	1.625	2,060	1,171	197,352	2054/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	2,530	1,307	220,382	2071/10/22
	1.75 GILT 370907	1.75	3,340	2,540	428,101	2037/9/7
	1.75 GILT 490122	1.75	1,780	1,115	187,970	2049/1/22
	1.75 GILT 570722	1.75	2,830	1,647	277,624	2057/7/22
	2 GILT 250907	2.0	2,100	2,015	339,566	2025/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	2,480	1,747	294,379	2065/7/22
	3.25 GILT 330131	3.25	2,100	2,023	340,899	2033/1/31
	3.25 GILT 440122	3.25	3,060	2,684	452,369	2044/1/22
	3.5 GILT 251022	3.5	2,500	2,464	415,251	2025/10/22
	3.5 GILT 450122	3.5	3,190	2,893	487,551	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	2,250	2,038	343,431	2068/7/22
	3.75 GILT 380129	3.75	1,250	1,215	204,851	2038/1/29
	3.75 GILT 520722	3.75	1,810	1,698	286,193	2052/7/22
	3.75 GILT 531022	3.75	2,150	2,009	338,545	2025/10/22
	4 GILT 600122	4.0	1,980	1,975	332,850	2060/1/22
	4.125 GILT 270129	4.125	3,300	3,325	560,376	2027/1/29
	4.25 GILT 271207	4.25	2,450	2,514	423,735	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	2,770	2,907	489,928	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	2,410	2,509	422,854	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	2,320	2,376	400,446	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	2,120	2,169	365,526	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	2,680	2,718	458,112	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	2,340	2,380	401,086	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	2,770	2,853	480,896	2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,990	2,123	357,739	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	2,790	2,945	496,343	2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	3,650	3,934	662,997	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	2,310	2,516	423,992	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	2,490	2,532	426,705	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	1,890	2,118	356,919	2028/12/7
小	計				20,750,700	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券					
	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	9,450	8,034	104,695	2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	8,000	7,421	96,704	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	12,200	11,123	144,935	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	11,960	11,371	148,169	2026/11/12
	1.75 SWD GOVT 331111	1.75	3,500	3,362	43,818	2033/11/11
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	6,750	6,764	88,141	2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,840	8,785	114,480	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,470	7,460	97,215	2039/3/30
小	計				838,161	

銘柄	当期末					
	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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	4,700	4,049	51,098	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	8,770	7,773	98,095	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	6,040	5,760	72,695	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	10,200	9,894	124,872	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	5,120	4,868	61,439	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	4,600	4,245	53,578	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	6,900	6,541	82,551	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	5,500	5,057	63,825	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 330815	3.0	4,500	4,441	56,048	2033/8/15
小計					664,205	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	4,800	4,603	90,825	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	14,550	11,873	234,255	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	8,900	4,713	92,990	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,200	9,388	185,229	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,550	9,360	184,683	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,490	7,336	144,753	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,650	19,536	385,453	2039/11/15
小計					1,318,191	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	3,000	2,500	80,953	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	3,500	3,190	103,303	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	5,890	4,346	140,724	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	7,600	5,552	179,790	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,816	123,582	2024/10/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	7,840	7,119	230,504	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	6,110	5,394	174,671	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	5,760	5,047	163,425	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	7,900	6,684	216,435	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	8,700	8,268	267,705	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,721	120,496	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,450	1,457	47,186	2029/4/25
	7.5 POLAND 280725	7.5	3,500	3,763	121,861	2028/7/25
小計					1,970,642	
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		
国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	5,450	5,079	458,317	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	4,100	3,766	339,857	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	3,010	2,548	229,976	2030/12/21
	1 AUST GOVT 311121	1.0	4,250	3,515	317,160	2031/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	4,530	3,788	341,791	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	4,740	4,130	372,739	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	3,980	3,453	311,640	2032/11/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	3,070	1,929	174,142	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,900	1,824	164,609	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,940	3,756	338,940	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,490	2,454	221,424	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,940	1,902	171,650	2028/11/21

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	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	
	国債証券	2.75 AUST GOVT 291121	2,980	2,900	261,674	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520	1,405	126,822	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	1,370	1,173	105,872	2041/5/21
		3 AUST GOVT 331121	4,100	3,951	356,526	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	2,020	1,728	155,997	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	5,460	5,465	493,174	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	2,660	2,671	241,078	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130	1,997	180,215	2039/6/21
		3.5 AUST GOVT 341221	2,300	2,306	208,102	2034/12/21
		3.75 AUST GOVT 340521	1,700	1,749	157,852	2034/5/21
		3.75 AUST GOVT 370421	2,150	2,172	196,026	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490	2,572	232,101	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	3,100	3,389	305,807	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	3,050	3,237	292,133	2027/4/21
小	計				6,755,640	
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		
	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	2,000	1,659	140,617	2028/5/15
		1.75 NZ GOVT 410515	600	400	33,951	2041/5/15
		2 NZ GOVT 320515	2,300	1,939	164,363	2032/5/15
		2.75 NZ GOVT 250415	2,000	1,931	163,696	2025/4/15
		2.75 NZ GOVT 370415	1,450	1,210	102,582	2037/4/15
		2.75 NZ GOVT 510515	680	503	42,636	2051/5/15
		3 NZ GOVT 290420	1,700	1,604	136,033	2029/4/20
		3.5 NZ GOVT 330414	800	760	64,437	2033/4/14
		4.5 NZ GOVT 270415	1,800	1,825	154,739	2027/4/15
小	計				1,003,059	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700	662	66,997	2026/11/1
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050	967	97,788	2031/7/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700	642	65,015	2050/3/1
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950	884	89,449	2051/10/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530	1,494	151,077	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300	1,245	125,961	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560	1,537	155,500	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	380	370	37,477	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800	797	80,671	2028/5/1
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700	693	70,137	2032/8/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980	1,026	103,838	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,140	1,208	122,193	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000	1,006	101,726	2027/9/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	920	930	94,100	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,340	1,354	136,991	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500	1,492	150,967	2024/9/1
		3 SINGAPORGOVT 720801	560	690	69,849	2072/8/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	780	825	83,503	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,000	1,025	103,739	2027/3/1
小	計				1,906,986	

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末				償還年月日
			額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
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	千円		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2,800	2,587	77,786	2031/4/15	
		3.478 MALAYSIAGOV 240614	1,300	1,305	39,258	2024/6/14	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3,000	2,995	90,044	2027/5/31	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,100	2,080	62,554	2032/7/15	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800	2,827	85,014	2028/6/15	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,630	3,540	106,423	2040/5/22	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	2,300	2,302	69,228	2034/7/5	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	2,400	2,408	72,404	2033/4/15	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	2,410	2,439	73,347	2025/3/14	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,600	3,641	109,476	2029/8/15	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	5,100	5,170	155,435	2027/3/15	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	5,640	5,737	172,494	2027/11/16	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	1,100	1,116	33,571	2026/11/30	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,400	1,422	42,773	2026/7/15	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	4,270	4,334	130,321	2025/9/15	
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	2,000	2,022	60,815	2024/9/30	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	5,250	5,189	156,009	2050/6/15	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	2,500	2,527	75,998	2024/7/15	
		4.232MALAYSIAGOV 310630	2,550	2,637	79,280	2031/6/30	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	2,150	2,213	66,529	2035/5/31	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	900	925	27,836	2026/4/15	
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	600	631	18,996	2053/3/31	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	2,240	2,356	70,848	2030/4/15	
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	1,500	1,567	47,109	2029/4/30	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	1,200	1,292	38,858	2033/11/7	
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	1,900	2,097	63,065	2042/10/15	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,650	1,806	54,303	2046/3/15	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4,440	4,814	144,744	2037/4/7	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	2,750	3,065	92,162	2038/6/8	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,020	2,327	69,977	2048/7/6	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,000	1,118	33,623	2043/9/30	
小	計				2,420,296		
中国			千中国元	千中国元			
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 240915	14,000	13,950	270,129	2024/9/15	
		1.99 CHINA GOVT 250409	20,000	19,866	384,694	2025/4/9	
		2.18 CHINA GOVT 240625	26,000	25,992	503,324	2024/6/25	
		2.18 CHINA GOVT 250825	16,000	15,923	308,336	2025/8/25	
		2.24 CHINA GOVT 250525	9,000	8,979	173,883	2025/5/25	
		2.26 CHINA GOVT 250224	14,000	13,985	270,810	2025/2/24	
		2.28 CHINA GOVT 251125	22,000	21,946	424,963	2025/11/25	
		2.29 CHINA GOVT 241225	33,000	33,014	639,295	2024/12/25	
		2.35 CHINA GOVT 250315	12,000	12,010	232,564	2025/3/15	
		2.37 CHINA GOVT 270120	21,000	20,887	404,453	2027/1/20	
		2.44 CHINA GOVT 271015	15,000	14,924	289,005	2027/10/15	
		2.46 CHINA GOVT 260215	20,000	20,033	387,918	2026/2/15	
		2.47 CHINA GOVT 240902	16,000	16,047	310,733	2024/9/2	
		2.48 CHINA GOVT 270415	13,000	12,974	251,228	2027/4/15	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千中国元	千中国元	千円		
中国	国債証券	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	17,000	16,962	328,457	2027/7/25
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	17,000	16,753	324,415	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	8,000	8,016	155,240	2028/4/15
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	14,000	13,922	269,591	2029/9/25
		2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	19,000	19,052	368,929	2028/1/15
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	27,000	26,907	521,040	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	24,000	24,163	467,897	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	17,000	16,879	326,844	2032/8/15
		2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,042	97,648	2026/8/4
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	20,000	20,061	388,460	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	15,000	14,969	289,866	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	16,000	15,985	309,533	2032/5/15
		2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	19,000	19,077	369,423	2029/12/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	14,000	14,089	272,829	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 300325	2.8	15,000	15,077	291,955	2030/3/25
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	17,000	17,049	330,145	2032/11/15
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	22,000	22,267	431,194	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	13,000	13,168	254,993	2033/2/25
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	18,000	18,156	351,586	2031/11/18
		2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	17,000	17,243	333,895	2026/5/5
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	16,000	16,222	314,128	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	10,000	10,105	195,685	2024/10/17
		2.99 CHINA GOVT 251015	2.99	9,000	9,136	176,916	2025/10/15
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	21,000	21,428	414,948	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	22,000	22,353	432,844	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	30,000	30,625	593,029	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	28,000	28,504	551,950	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	17,000	17,369	336,334	2026/12/5
		3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	8,000	8,053	155,946	2052/10/25
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	21,000	21,599	418,252	2029/11/21
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	13,000	13,293	257,407	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	18,000	18,467	357,601	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	17,000	17,622	341,240	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	24,000	25,050	485,082	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	24,000	24,822	480,651	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	25,000	26,011	503,681	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	14,000	14,502	280,830	2052/4/15
		3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	20,000	20,896	404,645	2050/3/16
		3.52 CHINA GOVT 270504	3.52	19,000	19,851	384,406	2027/5/4
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	12,000	12,889	249,594	2051/10/18
3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	13,000	13,686	265,017	2028/8/16		
3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	10,000	10,175	197,033	2024/6/22		
3.59 CHINA GOVT 270803	3.59	7,000	7,345	142,241	2027/8/3		
3.6 CHINA GOVT 250906	3.6	8,000	8,262	159,984	2025/9/6		
3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	10,000	10,312	199,681	2025/6/7		
3.69 CHINA GOVT 240921	3.69	20,000	20,460	396,201	2024/9/21		
3.69 CHINA GOVT 280517	3.69	18,000	19,091	369,686	2028/5/17		

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	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		
	国債証券	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	14,000	15,511	300,367	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	11,000	11,343	219,660	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	23,000	25,823	500,035	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	17,000	19,191	371,627	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	16,000	18,664	361,420	2048/10/22
小	計					22,153,430	
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		
	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	6,500	6,082	224,609	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED B0 300331	1.0	3,370	2,859	105,599	2030/3/31
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,300	1,078	39,820	2032/4/30
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	4,900	3,771	139,264	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	3,080	2,943	108,705	2028/9/28
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	2.8	800	636	23,516	2052/11/29
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	3,790	3,672	135,618	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	3,130	3,850	142,216	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	5,000	5,574	205,865	2026/10/30
小	計					1,125,216	
合	計					432,163,832	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 432,163,832	% 97.5
コール・ローン等、その他	10,950,597	2.5
投資信託財産総額	443,114,429	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（437,240,656千円）の投資信託財産総額（443,114,429千円）に対する比率は98.7%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=134.63円	1 カナダドル=99.79円	1 メキシコペソ=7.663円	1 ユーロ=146.96円
1 イギリスポンド=168.50円	1 スウェーデンクローネ=13.03円	1 ノルウェークローネ=12.62円	1 デンマーククローネ=19.73円
1 ポーランドズロチ=32.3776円	1 オーストラリアドル=90.23円	1 ニュージーランドドル=84.76円	1 シンガポールドル=101.12円
1 マレーシアリンギット=30.0631円	1 中国元=19.3639円	1 イスラエルシェケル=36.9299円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	444,971,140,382
コール・ローン等	7,418,114,223
公社債(評価額)	432,163,832,554
未収入金	1,857,476,039
未収利息	3,073,913,333
前払費用	457,804,233
(B) 負債	6,022,036,026
未払金	4,937,106,508
未払解約金	1,084,926,207
未払利息	3,311
(C) 純資産総額(A-B)	438,949,104,356
元本	187,414,503,873
次期繰越損益金	251,534,600,483
(D) 受益権総口数	187,414,503,873口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,421円

<注記事項>

- ①期首元本額 130,645,783,749円
 期中追加設定元本額 89,496,876,451円
 期中一部解約元本額 32,728,156,327円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,3421円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	39,738,593,500円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	28,814,450,386円
三菱UFJ 外国債券オープン(毎月分配型)	18,226,597,326円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	14,892,577,798円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,187,407,813円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,108,692,888円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,748,942,871円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,530,356,826円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	5,020,170,893円
つみたて8資産均等バランス	4,881,952,480円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,442,752,400円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	3,023,028,851円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	2,780,155,532円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,330,308,055円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,245,206,953円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,895,240,582円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	1,875,465,345円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,794,102,985円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,689,603,690円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	1,685,566,185円
つみたて4資産均等バランス	1,657,706,534円
海外債券インデックスファンドS	1,589,361,392円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,446,793,569円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,336,382,083円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,249,524,589円

○損益の状況 (2022年5月13日~2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,994,718,131
受取利息	7,995,994,315
その他収益金	19,593
支払利息	△ 1,295,777
(B) 有価証券売買損益	△ 2,986,653,570
売買益	17,476,084,722
売買損	△ 20,462,738,292
(C) 保管費用等	△ 39,530,135
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,968,534,426
(E) 前期繰越損益金	171,579,946,706
(F) 追加信託差損益金	117,951,459,412
(G) 解約差損益金	△ 42,965,340,061
(H) 計(D+E+F+G)	251,534,600,483
次期繰越損益金(H)	251,534,600,483

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,176,683,452円
ワールド・インカムオープン	1,053,216,176円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,002,617,862円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	950,166,493円
三菱UFJ 外国債券オープン	943,508,323円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	729,262,532円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	688,643,497円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	672,493,265円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	670,216,424円
ファンド・マネジャー (海外債券)	625,951,232円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	625,677,891円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)	622,195,097円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	566,800,741円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	546,364,581円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	532,787,246円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	519,245,544円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	509,769,954円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	454,194,293円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	431,469,643円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	391,387,792円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	379,189,541円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)	288,855,047円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	287,539,625円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	252,402,895円
eMAXIS バランス (波乗り型)	227,901,520円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	206,007,507円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	201,413,304円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	199,391,427円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	178,017,661円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	157,298,781円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	150,296,670円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	129,612,489円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	127,703,170円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	114,207,191円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	96,488,467円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	67,394,969円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	64,756,271円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	61,692,086円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	58,006,403円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	54,006,522円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	45,046,948円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	29,012,753円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22,350,024円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	21,016,144円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	15,312,462円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	14,307,790円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	13,027,436円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	10,358,602円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	9,981,478円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	5,999,800円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	5,148,930円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,858,584円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,704,278円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,998,291円

eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,996,018円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,696,708円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	857,987円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	675,668円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	536,373円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	430,163円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	403,401円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	8,925円
合計	187,414,503,873円

【お 知 ら せ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

海外債券マザーファンド

《第25期》決算日2023年7月24日

[計算期間：2022年7月23日～2023年7月24日]

「海外債券マザーファンド」は、7月24日に第25期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第25期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く先進諸国の国債を中心とした各種投資適格債券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。運用にあたってはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとして、アクティブ運用によりベンチマークを上回る投資成果をめざします。ファンドのデュレーションはベンチマークのデュレーションの±1.5年以内とし、デュレーションの調整に債券先物取引等を利用することがあります。運用指図に関する権限は、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。
主要運用対象	日本を除く先進諸国の国債を中心とした各種投資適格債券を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
21期(2019年7月22日)	23,025	2.4	115,701.27	2.0	91.1	—	2,441
22期(2020年7月22日)	24,663	7.1	124,214.53	7.4	95.2	—	2,641
23期(2021年7月26日)	25,786	4.6	129,317.67	4.1	94.8	—	2,806
24期(2022年7月22日)	26,703	3.6	133,473.04	3.2	96.9	—	2,847
25期(2023年7月24日)	27,684	3.7	136,921.60	2.6	97.3	—	4,125

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－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		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 7月22日	円 26,703	% —	133,473.04	% —	96.9	—
7 月 末	26,689	△0.1	133,117.57	△0.3	97.0	—
8 月 末	26,439	△1.0	131,430.25	△1.5	96.5	—
9 月 末	26,153	△2.1	130,076.63	△2.5	95.2	—
10 月 末	26,997	1.1	134,355.57	0.7	96.4	—
11 月 末	26,276	△1.6	130,450.40	△2.3	97.7	—
12 月 末	25,031	△6.3	123,946.23	△7.1	97.0	—
2023年 1 月 末	25,358	△5.0	125,559.33	△5.9	96.8	—
2 月 末	25,667	△3.9	126,903.56	△4.9	96.5	—
3 月 末	25,962	△2.8	128,532.24	△3.7	94.4	—
4 月 末	26,176	△2.0	129,370.99	△3.1	95.5	—
5 月 末	26,832	0.5	132,828.99	△0.5	88.7	—
6 月 末	27,919	4.6	138,284.08	3.6	97.1	—
(期 末) 2023年 7月24日	27,684	3.7	136,921.60	2.6	97.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

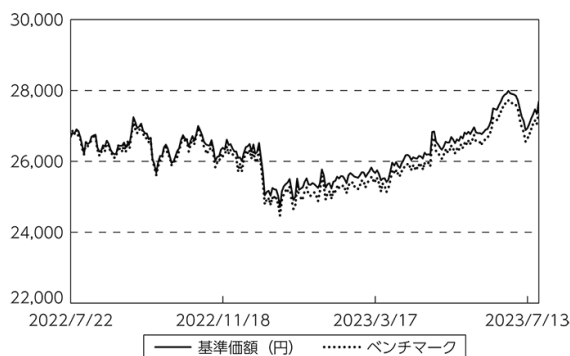
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ3.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(2.6%)を1.1%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

米ドルやユーロが対円で上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

先進国の債券市況が下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

- ・ 先進国の債券市況はローカルベースで下落しました。
- ・ 米国と欧州主要国の長期金利は、インフレ抑制に向けて米国や欧州の中央銀行が利上げを実施したこと等から上昇し、期間を通じてみると、先進国の債券市況は下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドルは、米国のインフレ率の伸びが鈍化し、米国の利上げペースの減速期待が高まった局面等においては対円で下落したものの、日銀による金融緩和策の継続期待が強まったこと等を背景に、期間を通じてみると対円で上昇しました。ユーロは、欧州中央銀行（ECB）による積極的な金融引き締め姿勢や中国のゼロコロナ政策撤廃等がプラス要因となり、期間を通じてみると対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 債券種別（セクター）配分については、国債と比べて相対的に利回りの高い社債へ投資をすることで金利妙味を享受できると判断し、社債への配分をベンチマーク対比多めとしました。
- ・ 通貨配分については、マーケット状況等を勘案し、機動的な調整を行いました。

- ・ 金利戦略については、主要な中央銀行による金融政策正常化への動き等が金利上昇につながる可能性を考慮し、デュレーション（金利感応度：金利の変化に対してポートフォリオ価値がどの程度変化するかを目安となります）をベンチマーク対比短めとしました。
- ・ 前記をふまえ、日本を除く先進諸国の国債を中心とした各種投資適格債券へ投資を行いました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・ ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.6%）を1.1%上回りました。
- ・ パフォーマンスに寄与した主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

◎ 債券種別（セクター）配分

- ・ 投資適格社債をベンチマーク対比多めとしていたことが、プラスに寄与しました。

◎ 国別配分

- ・ イタリアをベンチマーク対比多めとしていたことが、プラスに寄与しました。

◎ 今後の運用方針

- ・ 各国の景気動向に加え、各国中央銀行による財政政策・金融政策を含む各種政策や、物価や経済統計等が長期金利へ与える影響を考慮し、デュレーション等のコントロールを行います。
- ・ 債券種別（セクター）配分については、社債への配分はベンチマーク対比多めを維持する方針です。通貨配分、デュレーションについては、米国や欧州の中央銀行の金融政策の動向に注目し、マーケット状況等を勘案しながら状況に応じて機動的に対応する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年7月23日～2023年7月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 4	% 0.015	(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 ）	(4)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	4	0.015	
期中の平均基準価額は、26,282円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2022年7月23日～2023年7月24日)

公社債

		買付額	売付額	
アメリカ	国債証券	千アメリカドル 7,194	千アメリカドル 500 (615)	
	社債券	130	421	
カナダ	国債証券	千カナダドル 133	千カナダドル -	
メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 8,421	千メキシコペソ -	
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
外	ドイツ	国債証券	691	305
		特殊債券	94	-
	イタリア	国債証券	1,527	1,548 (38)
	フランス	国債証券	182	154
		特殊債券	275	-
		社債券	299	-
	オランダ	社債券	-	100
	スペイン	国債証券	369	312
	ベルギー	国債証券	153	66
	オーストリア	国債証券	42	-
	ルクセンブルク	国債証券	113	24
	フィンランド	国債証券	189	-
	エストニア	国債証券	27	27
	アメリカ	社債券	-	186
ポーランド	国債証券	24	-	
国	リトアニア	国債証券	72	-
	国際機関	特殊債券	127	16
	アイスランド	国債証券	-	96
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 664	千イギリスポンド 172
		社債券	-	87
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ -	千スウェーデンクローネ 223
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ -	千ノルウェークローネ 397
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 81	千オーストラリアドル 378
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 686	千ニュージーランドドル -

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年7月23日～2023年7月24日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 1,774	百万円 1,090	% 61.4	百万円 654	百万円 —	% —

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2023年7月24日現在)

外国公社債

(A)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
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,814	15,618	2,215,164	53.7	—	17.8	17.6	18.3
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	695	635	68,151	1.7	—	0.6	1.1	—
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	12,316	11,627	97,101	2.4	—	2.1	0.3	—
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	1,452	1,280	202,132	4.9	—	4.9	—	—
イタリア	1,987	1,856	292,987	7.1	—	3.3	3.3	0.5
フランス	1,695	1,484	234,242	5.7	—	4.9	0.8	—
オランダ	300	304	48,140	1.2	—	0.8	0.4	—
スペイン	1,159	964	152,245	3.7	—	2.1	0.9	0.7
ベルギー	355	330	52,188	1.3	—	1.3	—	—
オーストリア	100	73	11,544	0.3	—	0.3	—	—
ルクセンブルク	135	131	20,702	0.5	—	0.5	—	—
フィンランド	315	314	49,573	1.2	—	0.7	0.5	—
アイルランド	100	92	14,602	0.4	—	—	0.4	—
スロベニア	80	67	10,724	0.3	—	0.3	—	—
ラトビア	100	75	11,920	0.3	—	0.3	—	—
アメリカ	300	269	42,531	1.0	—	0.3	0.3	0.4
国際機関	300	240	37,925	0.9	—	0.9	—	—
イギリス	100	99	15,736	0.4	—	—	—	0.4
インドネシア	100	92	14,565	0.4	—	—	0.4	—
ポーランド	25	24	3,864	0.1	—	0.1	—	—
中国	100	78	12,449	0.3	—	0.3	—	—
アイスランド	100	83	13,229	0.3	—	—	0.3	—
リトアニア	73	73	11,591	0.3	—	0.3	—	—
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	1,562	1,195	218,159	5.3	—	4.5	0.4	0.4
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	850	745	15,793	0.4	—	0.4	—	—
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	1,047	921	87,975	2.1	—	1.4	0.7	—
	千ニューージーランドドル	千ニューージーランドドル						
ニューージーランド	675	663	58,109	1.4	—	1.4	—	—
合 計	—	—	4,013,356	97.3	—	49.3	27.2	20.7

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当期末			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		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.5 T-NOTE 270430	0.5	1,970	1,713	243,033	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,235	1,068	151,612	2027/6/30
	1.125 T-BOND 400515	1.125	875	563	79,975	2040/5/15
	1.125 T-NOTE 261031	1.125	2,050	1,849	262,261	2026/10/31
	1.25 T-BOND 500515	1.25	530	294	41,801	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	120	105	14,945	2028/3/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	1,465	1,208	171,386	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	240	205	29,212	2030/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	700	680	96,488	2024/5/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,200	2,093	296,900	2025/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	1,085	832	118,113	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	99	75	10,723	2046/5/15
	3 T-BOND 520815	3.0	110	92	13,134	2052/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	380	324	46,024	2048/5/15
	3.375 T-BOND 420815	3.375	750	676	95,945	2042/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	75	77	11,008	2040/11/15
	4.5 MEXICO 290422	4.5	200	195	27,679	2029/4/22
	5.375 HUNGARY 240325	5.375	20	19	2,829	2024/3/25
	T-BILL 231102	—	2,180	2,147	304,643	2023/11/2
	特殊債券	2.375 EXIM BK KO 240625	2.375	200	194	27,562
3.5 SAUDI ARABIAN 290416		3.5	200	185	26,342	2029/4/16
3.875 EX-IM BK IN 280201		3.875	200	188	26,757	2028/2/1
普通社債券	1.75 CVS HEALTH C 300821	1.75	50	40	5,677	2030/8/21
	1.95 COMCAST CORP 310115	1.95	50	40	5,801	2031/1/15
	2.4 AMERICAN TOWE 250315	2.4	75	70	10,065	2025/3/15
	2.5 ENBRIDGE INC 250115	2.5	75	71	10,164	2025/1/15
	2.9 ENERGY TRANSF 250515	2.9	50	47	6,749	2025/5/15
	2.95 SINOPEC GRP 291112	2.95	200	181	25,759	2029/11/12
	3.5 HCA INC 510715	3.5	80	55	7,847	2051/7/15
	4.2 CHARTER COMM 280315	4.2	100	93	13,278	2028/3/15
	6.875 PETRO MEX 251016	6.875	100	95	13,475	2025/10/16
	FRN BANK OF AM 310723	1.898	100	79	11,307	2031/7/23
	FRN CITIGROUP 310331	4.412	50	46	6,652	2031/3/31
	小計					2,215,164
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	120	103	11,109	2030/6/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	450	417	44,766	2028/6/1
	2.5 CAN GOVT 321201	2.5	60	55	5,962	2032/12/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	65	58	6,313	2048/12/1
小計					68,151	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	1,500	1,419	11,856	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	10,250	9,648	80,580	2031/5/29

銘	柄	当 期 末					
		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		
	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	566	558	4,665	2029/5/31
小	計					97,101	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0.25 BUND 290215	0.25	897	795	125,530	2029/2/15
		1 BUND 380515	1.0	120	97	15,345	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	70	54	8,627	2048/8/15
		1.7 BUND 320815	1.7	80	75	11,920	2032/8/15
	地方債証券	1.65 LAND NORDRHE 380222	1.65	85	69	10,947	2038/2/22
	特殊債券	2 KFW 291115	2.0	200	188	29,761	2029/11/15
イタリア	国債証券	0.65 ITALY GO I/L 271028	0.65	80	76	12,053	2027/10/28
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	540	447	70,560	2030/8/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	832	791	124,994	2025/8/15
		1.4 ITALY GOV I/L 250526	1.4	130	128	20,258	2025/5/26
		2.4 ITALY GOV I/L 390515	2.4	160	169	26,791	2039/5/15
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	100	96	15,154	2028/12/1
		4.45 ITALY GOVT 430901	4.45	145	146	23,174	2043/9/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 301125	—	130	105	16,690	2030/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	200	160	25,365	2036/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	415	324	51,287	2048/5/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	150	148	23,517	2045/5/25
	特殊債券	0.125 AGENCE FRAN 310929	0.125	200	155	24,472	2031/9/29
		2.875 CAISSE D'AM 270525	2.875	200	197	31,138	2027/5/25
	普通社債券	3.875 CREDIT AGR 310420	3.875	100	99	15,744	2031/4/20
		4 BANQUE FED 291121	4.0	100	100	15,859	2029/11/21
FRN BNP PARIBAS 290113		4.375	100	100	15,886	2029/1/13	
		STEP AXA SA 490528	3.25	100	90	14,281	2049/5/28
オランダ	国債証券	3.75 NETH GOVT 420115	3.75	100	113	17,923	2042/1/15
	普通社債券	1.875 VOLKSWAGEN 270330	1.875	100	92	14,610	2027/3/30
		FRN ASR NEDERLAND 450929	5.125	100	98	15,606	2045/9/29
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 280131	—	75	65	10,268	2028/1/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	78	62	9,891	2032/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	70	64	10,194	2028/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	255	122	19,406	2071/10/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	200	193	30,598	2025/4/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	75	61	9,700	2048/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	89	84	13,273	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	50	45	7,138	2066/7/30
		3.55 SPAIN GOVT 331031	3.55	167	168	26,572	2033/10/31
	普通社債券	3.125 BANCO SANTA 270119	3.125	100	96	15,201	2027/1/19
ベルギー	国債証券	1.7 BEL GOVT 500622	1.7	65	45	7,202	2050/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	130	128	20,227	2034/6/22
		3.3 BEL GOVT 540622	3.3	100	96	15,252	2054/6/22
		3.45 BEL GOVT 430622	3.45	60	60	9,505	2043/6/22
オーストリア	国債証券	1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	100	73	11,544	2047/2/20
ルクセンブルク	国債証券	0 GRAND DUCHY OF 320914	—	20	15	2,408	2032/9/14

銘柄			当 期 末				
			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	
ルクセンブルク	国債証券	3 GRAND DUCHY OF 330302	3.0	30	30	4,737	2033/3/2
		3.25 GRAND DUCHY 430302	3.25	85	85	13,556	2043/3/2
フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	125	124	19,611	2028/7/4
		3 FINNISH GOVT 330915	3.0	190	189	29,961	2033/9/15
アイルランド	普通社債券	1.375 GAS NETWORK 261205	1.375	100	92	14,602	2026/12/5
スロベニア	国債証券	0.875 REPUBLIKA S 300715	0.875	80	67	10,724	2030/7/15
ラトビア	国債証券	0 LATOVIA 310317	—	100	75	11,920	2031/3/17
アメリカ	普通社債券	0.875 CHUBB INA H 270615	0.875	100	89	14,103	2027/6/15
		0.875 THERMO FISH 311001	0.875	100	81	12,796	2031/10/1
		1.125 STRYKER COR 231130	1.125	100	99	15,631	2023/11/30
国際機関	特殊債券	0 EIB 310114	—	190	151	23,908	2031/1/14
		0 EUROPEAN U 301004	—	110	88	14,017	2030/10/4
イギリス	普通社債券	VAR LLOYDS BANKIN 280907	1.75	100	99	15,736	2023/9/7
インドネシア	国債証券	1.45 INDONESIA 260918	1.45	100	92	14,565	2026/9/18
ポーランド	国債証券	4.25 POLAND 430214	4.25	25	24	3,864	2043/2/14
中国	国債証券	0.25 CHINA GOVT I 301125	0.25	100	78	12,449	2030/11/25
アイスランド	国債証券	0 ICELAND 280415	—	100	83	13,229	2028/4/15
リトアニア	国債証券	3.875 LITHUANIA 330614	3.875	73	73	11,591	2033/6/14
小 計						1,252,900	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.375 GILT 301022	0.375	385	293	53,527	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	220	178	32,510	2029/1/31
		0.625 GILT 501022	0.625	235	96	17,525	2050/10/22
		1.5 GILT 470722	1.5	50	28	5,197	2047/7/22
		1.75 GILT 490122	1.75	12	7	1,357	2049/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	360	311	56,814	2045/1/22
	普通社債券	2.25 LLOYDS BANKI 241016	2.25	100	95	17,432	2024/10/16
		2.9 AT&T INC 261204	2.9	100	89	16,359	2026/12/4
		FRN NGG FINANCE P 730618	5.625	100	95	17,434	2073/6/18
小 計						218,159	
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		
	国債証券	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	850	745	15,793	2029/11/15
小 計						15,793	
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		
	国債証券	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	350	314	30,010	2026/9/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	320	255	24,348	2032/5/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	377	352	33,616	2029/11/21
小 計						87,975	
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		
	国債証券	4.25 NZ GOVT 340515	4.25	175	168	14,782	2034/5/15
		4.5 NZ GOVT 300515	4.5	500	494	43,327	2030/5/15
小 計						58,109	
合 計						4,013,356	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2023年7月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,013,356	97.2
コール・ローン等、その他	113,646	2.8
投資信託財産総額	4,127,002	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(4,108,196千円)の投資信託財産総額(4,127,002千円)に対する比率は99.5%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=141.83円	1 カナダドル=107.27円	1 メキシコペソ=8.3512円	1 ユーロ=157.84円
1 イギリスポンド=182.44円	1 スイスフラン=163.72円	1 スウェーデンクローネ=13.64円	1 ノルウェークローネ=14.07円
1 デンマーククローネ=21.19円	1 ポーランドズロチ=35.3637円	1 オーストラリアドル=95.42円	1 ニューージーランドドル=87.57円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月24日現在)

○損益の状況 (2022年7月23日～2023年7月24日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,000,960,703
コール・ローン等	81,752,399
公社債(評価額)	4,013,356,857
未収入金	881,615,249
未収利息	20,758,898
前払費用	3,477,300
(B) 負債	874,962,280
未払金	874,962,253
未払利息	27
(C) 純資産総額(A-B)	4,125,998,423
元本	1,490,413,823
次期繰越損益金	2,635,584,600
(D) 受益権総口数	1,490,413,823口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,684円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	69,536,709
受取利息	69,549,227
その他収益金	186
支払利息	△ 12,704
(B) 有価証券売買損益	82,609,675
売買益	353,447,988
売買損	△ 270,838,313
(C) 保管費用等	△ 470,525
(D) 当期損益金(A+B+C)	151,675,859
(E) 前期繰越損益金	1,781,132,298
(F) 追加信託差損益金	722,218,596
(G) 解約差損益金	△ 19,442,153
(H) 計(D+E+F+G)	2,635,584,600
次期繰越損益金(H)	2,635,584,600

<注記事項>

- ①期首元本額 1,066,345,266円
 期中追加設定元本額 435,626,404円
 期中一部解約元本額 11,557,847円
 また、1口当たり純資産額は、期末27,684円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ <DC>海外債券オープン	1,066,494,737円
海外債券セレクション(ラップ向け)	409,944,562円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	8,879,174円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	5,095,350円
合計	1,490,413,823円

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

新興国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2024年1月26日

[計算期間：2023年1月27日～2024年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して公社債の投資比率が100%を超える場合があります。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せん。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	新興国の現地通貨建での公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8%	34,193.00	9.4%	97.4%	—	百万円 30,520
11期(2021年1月26日)	13,819	△4.2%	32,923.96	△3.7%	97.6%	—	37,779
12期(2022年1月26日)	14,025	1.5%	33,419.11	1.5%	97.5%	—	51,888
13期(2023年1月26日)	14,770	5.3%	35,262.54	5.5%	97.1%	—	64,755
14期(2024年1月26日)	17,722	20.0%	42,305.98	20.0%	96.1%	—	87,744

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建でのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建でのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－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		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 1 月 26 日	円	%		%	%	%
	14,770	—	35,262.54	—	97.1	—
1 月 末	14,795	0.2	35,423.91	0.5	96.7	—
2 月 末	14,985	1.5	35,809.02	1.5	96.8	—
3 月 末	15,215	3.0	36,370.53	3.1	97.1	—
4 月 末	15,417	4.4	36,860.17	4.5	96.7	—
5 月 末	15,895	7.6	38,041.49	7.9	97.0	—
6 月 末	16,898	14.4	40,502.35	14.9	93.9	—
7 月 末	16,934	14.7	40,572.98	15.1	97.0	—
8 月 末	17,169	16.2	41,220.48	16.9	96.8	—
9 月 末	16,760	13.5	40,162.19	13.9	96.7	—
10 月 末	16,781	13.6	40,317.54	14.3	96.8	—
11 月 末	17,504	18.5	42,103.88	19.4	96.5	—
12 月 末	17,329	17.3	41,592.54	18.0	96.3	—
(期 末) 2024年 1 月 26 日	17,722	20.0	42,305.98	20.0	96.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

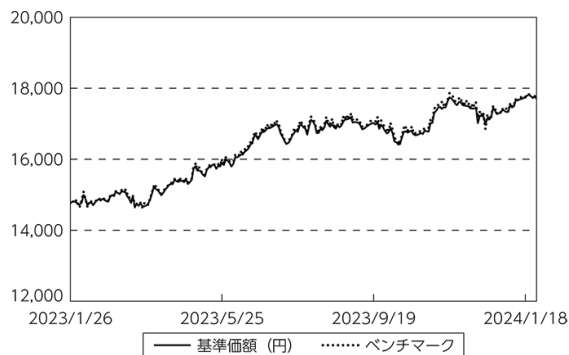
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ20.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.0%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、欧米中央銀行による利上げの打ち止め観測などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことや利金が相応に積みあがったことで上昇しました。

◎ 為替市況

期間の初めに比べてトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは20.0%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 14	% 0.084	(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 ）	(13)	(0.078)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	14	0.084	
期中の平均基準価額は、16,378円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
為替先物取引	百万円 291	百万円 77	26.5	百万円 311	百万円 214	68.8
為替直物取引	23,449	8,731	37.2	14,195	4,723	33.3

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月26日現在)

外国公社債

(A)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
メキシコ	千メキシコペソ 1,061,500	千メキシコペソ 980,804	千円 8,422,655	% 9.6	% —	% 5.2	% 3.0	% 1.4
ブラジル	千ブラジルレアル 323,770	千ブラジルレアル 289,872	8,699,932	9.9	9.9	1.1	5.2	3.6
チリ	千チリペソ 9,825,000	千チリペソ 9,905,170	1,607,361	1.8	—	1.1	0.4	0.3
コロンビア	千コロンビアペソ 113,110,000	千コロンビアペソ 102,382,885	3,833,624	4.4	—	2.9	1.2	0.3
ペルー	千ペルーヌエボソル 50,050	千ペルーヌエボソル 50,215	1,968,325	2.2	—	1.9	0.4	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 41,000	千ウルグアイペソ 40,464	153,223	0.2	—	0.1	0.0	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 48,000	千ドミニカペソ 54,100	135,651	0.2	0.2	0.2	—	—
セルビア	千セルビアディナール 185,000	千セルビアディナール 178,354	243,553	0.3	0.3	0.1	0.1	0.1
トルコ	千トルコリラ 195,300	千トルコリラ 138,622	676,104	0.8	0.8	0.2	0.5	0.1
チェコ	千チェココルナ 856,200	千チェココルナ 817,172	5,291,270	6.0	—	3.2	2.9	—
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 7,233,000	千ハンガリーフォリント 6,424,910	2,672,062	3.0	—	1.2	1.3	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 189,850	千ポーランドズロチ 176,460	6,459,822	7.4	—	2.1	3.4	1.8
ルーマニア	千ルーマニアレイ 103,160	千ルーマニアレイ 100,749	3,242,116	3.7	—	1.9	1.2	0.6
マレーシア	千マレーシアリンギット 269,680	千マレーシアリンギット 272,624	8,496,010	9.7	—	5.5	2.9	1.2
タイ	千タイバーツ 2,006,100	千タイバーツ 2,008,804	8,316,449	9.5	—	5.4	2.5	1.6
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 18,790	49,074	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 862,080,000	千インドネシアルピア 898,291,052	8,443,935	9.6	—	7.0	2.2	0.4
中国	千中国元 411,200	千中国元 422,176	8,687,035	9.9	—	4.7	3.8	1.4

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
南アフリカ	千南アフリカランド 1,068,100	千南アフリカランド 884,243	千円 6,914,787	% 7.9	% 7.9	% 6.9	% 1.0	% —
合 計	—	—	84,312,998	96.1	19.0	50.7	32.0	13.3

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当 期 額面金額	期 末 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	
	国債証券					
	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	68,700	68,301	586,542	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	15,700	16,601	142,568	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	56,000	53,299	457,711	2025/3/6
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	86,200	77,147	662,502	2027/3/4
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	120,200	111,021	953,400	2026/3/5
	7 MEXICAN BONOS 260903	7.0	27,000	25,332	217,540	2026/9/3
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	98,200	93,032	798,918	2027/6/3
	7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	68,800	61,343	526,786	2033/5/26
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	108,500	100,118	859,766	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	24,400	21,874	187,846	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	81,600	69,936	600,583	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	24,000	23,535	202,109	2024/9/5
	8 MEXICAN BONOS 350524	8.0	10,000	9,122	78,338	2035/5/24
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	66,400	57,789	496,265	2047/11/7
	8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	51,200	44,066	378,419	2053/7/31
	8.5 MEXICAN BONOS 290301	8.5	22,000	21,359	183,421	2029/3/1
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	75,100	73,193	628,546	2029/5/31
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	57,500	53,728	461,389	2038/11/18
小計					8,422,655	
ブラジル			千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券					
	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	40,270	40,609	1,218,807	2027/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	30,900	31,069	932,498	2025/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 310101	10.0	12,600	12,378	371,512	2031/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 330101	10.0	20,700	20,191	606,009	2033/1/1
	10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	42,300	42,164	1,265,473	2029/1/1
	BRAZIL-LTN 250701	—	33,300	29,156	875,087	2025/7/1
	BRAZIL-LTN 260101	—	52,700	44,027	1,321,382	2026/1/1
	BRAZIL-LTN 260701	—	61,800	49,247	1,478,071	2026/7/1
	BRAZIL-LTN 270701	—	29,200	21,027	631,088	2027/7/1
小計					8,699,932	
チリ			千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券					
	2.3 BONOS TESORER 281001	2.3	480,000	426,360	69,187	2028/10/1
	2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,860,000	1,817,127	294,874	2025/3/1
	4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,420,000	1,427,455	231,640	2026/3/1
	4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,570,000	1,544,016	250,555	2030/9/1
	5 BONOS TESORERIA 281001	5.0	410,000	411,156	66,720	2028/10/1
	5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,470,000	1,445,018	234,490	2035/3/1
	6 BONOS TESORERIA 330401	6.0	950,000	1,010,712	164,013	2033/4/1
	6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	1,315,000	1,424,342	231,135	2043/1/1
	7 BONOS TESORERIA 340501	7.0	350,000	398,982	64,744	2034/5/1
小計					1,607,361	
コロンビア			千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券					
	13.25 TITULOS DE 330209	13.25	7,900,000	9,535,673	357,053	2033/2/9
	5.75 TITULOS DE T 271103	5.75	6,900,000	6,203,379	232,279	2027/11/3

銘柄	当期末					
	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		
コロンビア		%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
国債証券	6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	11,980,000	10,729,133	401,741	2028/4/28
	6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	6,690,000	6,428,670	240,715	2025/11/26
	6.25 TITULOS DE T 360709	6.25	4,900,000	3,669,331	137,394	2036/7/9
	7 TITULOS DE TESO 310326	7.0	12,080,000	10,662,043	399,229	2031/3/26
	7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	11,700,000	10,020,114	375,193	2032/6/30
	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	10,000,000	8,419,269	315,251	2034/10/18
	7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	9,400,000	7,008,575	262,429	2050/10/26
	7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	11,120,000	10,751,066	402,562	2026/8/26
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	8,340,000	7,754,790	290,370	2030/9/18
	9.25 TITULOS DE T 420528	9.25	12,100,000	11,200,835	419,404	2042/5/28
小計					3,833,624	
ペルー			千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
国債証券	5.35 PERU 400812	5.35	3,250	2,784	109,158	2040/8/12
	5.4 PERU 340812	5.4	5,200	4,716	184,884	2034/8/12
	5.94 PERU 290212	5.94	6,600	6,728	263,761	2029/2/12
	6.15 PERU 320812	6.15	6,900	6,783	265,888	2032/8/12
	6.35 PERU 280812	6.35	4,900	5,105	200,141	2028/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	7,000	7,039	275,933	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	6,800	7,098	278,264	2031/8/12
	7.3 PERU 330812	7.3	6,400	6,740	264,220	2033/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	3,000	3,216	126,073	2026/8/12
小計					1,968,325	
ウルグアイ			千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
国債証券	8.25 URUGUAY 310521	8.25	17,000	16,150	61,156	2031/5/21
	8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,761	25,602	2028/3/15
	9.75 URUGUAY 330720	9.75	17,000	17,552	66,464	2033/7/20
小計					153,223	
ドミニカ			千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
国債証券	11.25 DOMINICAN 350915	11.25	32,000	34,604	86,767	2035/9/15
	13.625 DOMINICAN 330203	13.625	16,000	19,495	48,883	2033/2/3
小計					135,651	
セルビア			千セルビアディナール	千セルビアディナール		
国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	4.5	61,000	60,351	82,413	2026/1/11
	4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	74,000	66,877	91,325	2032/8/20
	5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	50,000	51,125	69,814	2028/2/8
小計					243,553	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	23,900	15,570	75,943	2027/8/11
	10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	6,412	31,277	2026/2/11
	11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	2,866	13,980	2027/2/24
	11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	14,100	9,038	44,081	2030/11/13
	12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	29,100	19,409	94,666	2028/3/8
	12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	14,600	10,077	49,151	2025/10/1
	16.9 TURKEY GOVT 260902	16.9	17,200	12,805	62,455	2026/9/2
	17.3 TURKEY GOVT 280719	17.3	48,000	36,816	179,562	2028/7/19

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
トルコ		%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券	17.8	28,000	20,888	101,877	2033/7/13	
		8.0	6,300	4,737	23,106	2025/3/12	
小	計				676,104		
チェコ			千チェココルナ	千チェココルナ			
	国債証券	0.05	83,000	66,888	433,111	2029/11/29	
		0.25	143,500	128,822	834,140	2027/2/10	
		1.5	20,500	14,391	93,183	2040/4/24	
		1.75	119,200	101,267	655,717	2032/6/23	
		1.95	24,300	19,183	124,217	2037/7/30	
		3.5	81,500	78,158	506,084	2035/5/30	
		4.5	21,000	21,897	141,790	2032/11/11	
		4.9	32,000	34,561	223,789	2034/4/14	
		5.0	79,700	84,992	550,337	2030/9/30	
		5.5	108,000	116,316	753,157	2028/12/12	
		6.0	138,500	144,923	938,393	2026/2/26	
		6.2	5,000	5,768	37,348	2031/6/16	
小	計				5,291,270		
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
	国債証券	1.0	427,000	392,248	163,132	2025/11/26	
		1.5	560,000	511,196	212,601	2026/4/22	
		1.5	270,000	241,683	100,514	2026/8/26	
		2.0	330,000	274,543	114,180	2029/5/23	
		2.25	505,000	376,277	156,490	2033/4/20	
		2.25	150,000	108,870	45,278	2034/6/22	
		2.5	290,000	281,453	117,054	2024/10/24	
		2.75	373,000	341,340	141,960	2026/12/22	
		3.0	541,000	491,868	204,563	2027/10/27	
		3.0	518,000	440,245	183,094	2030/8/21	
		3.0	392,000	271,885	113,074	2038/10/27	
		3.0	205,000	136,058	56,585	2041/4/25	
		3.25	618,000	520,870	216,625	2031/10/22	
		4.5	360,000	343,131	142,705	2028/3/23	
		4.75	440,000	405,064	168,462	2032/11/24	
		5.5	492,000	489,581	203,612	2025/6/24	
		6.75	582,000	603,613	251,037	2028/10/22	
		9.5	180,000	194,978	81,089	2026/10/21	
小	計				2,672,062		
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券	—	10,700	9,849	360,586	2025/10/25	
		0.25	12,200	10,750	393,553	2026/10/25	
		0.75	12,500	11,876	434,786	2025/4/25	
		1.25	15,100	11,808	432,299	2030/10/25	
		1.75	14,100	10,853	397,309	2032/4/25	
		2.25	8,500	8,332	305,045	2024/10/25	
		2.5	17,000	16,027	586,749	2026/7/25	

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				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		
	国債証券	2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	10,044	367,689	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	14,750	13,467	493,021	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	17,200	15,233	557,661	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	14,500	14,135	517,471	2025/7/25
		3.75 POLAND 270525	3.75	12,900	12,413	454,444	2027/5/25
		6 POLAND 331025	6.0	12,500	13,087	479,116	2033/10/25
		7.5 POLAND 280725	7.5	17,000	18,577	680,087	2028/7/25
小	計					6,459,822	
ルーマニア				千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
	国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 271025	2.5	4,000	3,535	113,763	2027/10/25
		3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	3,020	97,214	2026/6/24
		3.5 ROMANIA GOVER 251125	3.5	4,500	4,326	139,237	2025/11/25
		3.65 ROMANIA GOVE 250728	3.65	4,000	3,887	125,095	2025/7/28
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	5,500	4,634	149,143	2031/9/24
		3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	1,000	984	31,671	2024/11/25
		4.15 ROMANIA GOVE 280126	4.15	5,200	4,848	156,019	2028/1/26
		4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	5,000	4,437	142,812	2030/10/24
		4.25 ROMANIA GOVE 360428	4.25	3,800	3,122	100,484	2036/4/28
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,816	219,356	2025/2/24
		4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	5,200	4,548	146,356	2034/10/11
		4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,787	154,071	2026/4/22
		4.85 ROMANIA GOVE 290725	4.85	4,800	4,498	144,761	2029/7/25
		5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	6,260	5,936	191,037	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	5,800	5,746	184,928	2027/7/26
		6.7 ROMANIA GOVER 320225	6.7	5,900	6,039	194,364	2032/2/25
		7.2 ROMANIA GOVER 261028	7.2	3,200	3,299	106,167	2026/10/28
		7.2 ROMANIA GOVER 270531	7.2	1,500	1,551	49,935	2027/5/31
		7.2 ROMANIA GOVER 331030	7.2	2,200	2,321	74,713	2033/10/30
		7.35 ROMANIA GOVE 310428	7.35	2,800	2,954	95,063	2031/4/28
		7.9 ROMANIA GOVER 380224	7.9	3,900	4,425	142,400	2038/2/24
		8 ROMANIA GOVERN 300429	8.0	2,900	3,145	101,227	2030/4/29
		8.25 ROMANIA GOVE 320929	8.25	5,200	5,825	187,479	2032/9/29
		8.75 ROMANIA GOVE 281030	8.75	5,500	6,053	194,811	2028/10/30
小	計					3,242,116	
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		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	21,700	20,180	628,900	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	14,600	14,599	454,984	2027/5/31
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	14,700	14,398	448,704	2032/7/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	11,450	11,500	358,402	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	13,700	13,185	410,906	2040/5/22
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	11,570	11,540	359,647	2034/7/5
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	8,400	8,456	263,523	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	25,550	25,830	804,975	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	13,200	13,357	416,267	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	10,720	10,847	338,038	2026/11/30

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
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	千円		
国債証券	3.906 MALAYSIA GOV 260715	3.906	19,100	19,320	602,089	2026/7/15	
	3.955 MALAYSIA GOV 250915	3.955	25,600	25,819	804,633	2025/9/15	
	4.065 MALAYSIA GOV 500615	4.065	9,400	9,149	285,132	2050/6/15	
	4.254 MALAYSIA GOV 350531	4.254	9,550	9,803	305,517	2035/5/31	
	4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	12,800	13,210	411,693	2028/10/31	
	4.457 MALAYSIA GOV 530331	4.457	3,400	3,528	109,960	2053/3/31	
	4.504 MALAYSIA GOV 290430	4.504	2,800	2,913	90,790	2029/4/30	
	4.696 MALAYSIA GOV 421015	4.696	14,740	15,889	495,175	2042/10/15	
	4.762 MALAYSIA GOV 370407	4.762	12,400	13,346	415,914	2037/4/7	
	4.893 MALAYSIA GOV 380608	4.893	8,200	9,003	280,578	2038/6/8	
	4.921 MALAYSIA GOV 480706	4.921	6,100	6,744	210,172	2048/7/6	
小計					8,496,010		
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ			
国債証券	0.75 THAILAND 240917	0.75	51,300	50,787	210,261	2024/9/17	
	0.95 THAILAND 250617	0.95	89,000	87,371	361,717	2025/6/17	
	1 THAILAND 270617	1.0	114,200	109,229	452,210	2027/6/17	
	1.45 THAILAND 241217	1.45	120,600	119,656	495,376	2024/12/17	
	1.585 THAILAND 351217	1.585	78,900	69,521	287,820	2035/12/17	
	1.6 THAILAND 291217	1.6	90,700	86,364	357,550	2029/12/17	
	1.6 THAILAND 350617	1.6	38,200	33,966	140,621	2035/6/17	
	2 THAILAND 311217	2.0	127,900	122,346	506,513	2031/12/17	
	2 THAILAND 420617	2.0	57,500	49,027	202,975	2042/6/17	
	2.125 THAILAND 261217	2.125	96,300	95,754	396,421	2026/12/17	
	2.25 THAILAND 270317	2.25	45,800	45,680	189,117	2027/3/17	
	2.35 THAILAND 260617	2.35	95,300	95,380	394,877	2026/6/17	
	2.4 THAILAND 290317	2.4	38,000	37,936	157,057	2029/3/17	
	2.65 THAILAND 280617	2.65	98,600	99,633	412,481	2028/6/17	
	2.875 THAILAND 281217	2.875	84,900	86,703	358,954	2028/12/17	
	2.875 THAILAND 460617	2.875	67,200	62,004	256,700	2046/6/17	
	3.3 THAILAND 380617	3.3	97,000	101,761	421,293	2038/6/17	
	3.35 THAILAND 330617	3.35	88,800	93,473	386,978	2033/6/17	
	3.39 THAILAND 370617	3.39	72,900	77,231	319,737	2037/6/17	
	3.4 THAILAND 360617	3.4	74,000	78,150	323,545	2036/6/17	
	3.45 THAILAND 430617	3.45	61,300	64,329	266,325	2043/6/17	
	3.65 THAILAND 310620	3.65	78,100	83,903	347,359	2031/6/20	
	3.775 THAILAND 320625	3.775	88,600	96,191	398,231	2032/6/25	
	3.85 THAILAND 251212	3.85	74,700	76,778	317,861	2025/12/12	
	4.875 THAILAND 290622	4.875	76,300	85,618	354,458	2029/6/22	
小計					8,316,449		
フィリピン			千フィリピンペソ	千フィリピンペソ			
国債証券	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	6.25	20,000	18,790	49,074	2036/1/14	
小計					49,074		
インドネシア			千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	8,520,344	80,091	2030/8/15	
	11 INDONESIA 250915	11.0	8,250,000	8,842,395	83,118	2025/9/15	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア		%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
	国債証券	5.125	31,300,000	30,244,003	284,293	2027/4/15
		5.5	44,700,000	44,110,236	414,636	2026/4/15
		6.125	29,000,000	28,733,610	270,095	2028/5/15
		6.25	12,000,000	11,613,626	109,168	2036/6/15
		6.375	25,000,000	24,911,999	234,172	2028/8/15
		6.375	48,200,000	47,564,546	447,106	2032/4/15
		6.375	4,000,000	3,922,448	36,871	2037/7/15
		6.5	29,900,000	29,962,790	281,650	2025/6/15
		6.5	47,600,000	47,072,019	442,476	2031/2/15
		6.625	24,400,000	24,278,000	228,213	2033/5/15
		6.625	11,500,000	11,500,460	108,104	2034/2/15
		6.875	9,000,000	9,144,180	85,955	2029/4/15
		7.0	32,450,000	33,119,242	311,320	2027/5/15
		7.0	44,700,000	45,797,358	430,495	2030/9/15
		7.0	41,100,000	42,214,722	396,818	2033/2/15
		7.125	13,700,000	14,175,253	133,247	2038/6/15
		7.125	30,600,000	31,303,800	294,255	2042/6/15
		7.125	13,500,000	13,828,252	129,985	2043/6/15
		7.5	8,400,000	8,823,564	82,941	2032/8/15
		7.5	44,800,000	47,663,280	448,034	2035/6/15
		7.5	23,200,000	24,687,952	232,066	2038/5/15
		7.5	29,400,000	31,202,937	293,307	2040/4/15
		8.25	35,200,000	37,993,996	357,143	2029/5/15
		8.25	19,000,000	20,845,281	195,945	2032/6/15
		8.25	26,600,000	29,966,855	281,688	2036/5/15
		8.375	38,930,000	40,895,237	384,415	2026/9/15
		8.375	46,700,000	52,586,007	494,308	2034/3/15
		8.375	23,200,000	26,529,220	249,374	2039/4/15
		8.75	18,400,000	20,638,838	194,005	2031/5/15
		9.0	24,600,000	27,261,970	256,262	2029/3/15
		9.5	15,700,000	18,336,621	172,364	2031/7/15
小 計					8,443,935	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99	14,000	13,975	287,567	2025/4/9
		2.18	3,000	2,999	61,718	2025/8/25
		2.18	8,000	7,990	164,421	2026/8/15
		2.24	3,000	3,002	61,789	2025/5/25
		2.26	6,000	6,010	123,684	2025/2/24
		2.28	4,000	4,006	82,451	2025/11/25
		2.3	5,000	5,005	102,997	2026/5/15
		2.37	8,000	8,025	165,142	2027/1/20
		2.4	5,000	5,002	102,932	2028/7/15
		2.44	5,000	5,018	103,267	2027/10/15
		2.46	8,000	8,041	165,458	2026/2/15
		2.48	5,000	5,020	103,313	2027/4/15

銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
%	千中国元	千中国元	千円				
中国	国債証券	2.48 CHINA GOVT 280925	2.48	3,000	3,014	62,033	2028/9/25
		2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	7,000	7,039	144,845	2027/7/25
		2.52 CHINA GOVT 330825	2.52	9,000	8,985	184,885	2033/8/25
		2.55 CHINA GOVT 281015	2.55	6,000	6,055	124,612	2028/10/15
		2.6 CHINA GOVT 300915	2.6	7,000	7,051	145,105	2030/9/15
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	6,000	6,016	123,795	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	7,000	7,084	145,778	2028/4/15
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	6,000	6,062	124,751	2029/9/25
		2.62 CHINA GOVT 300625	2.62	5,000	5,040	103,713	2030/6/25
		2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	7,000	7,080	145,701	2028/1/15
		2.67 CHINA GOVT 330525	2.67	8,000	8,077	166,213	2033/5/25
		2.67 CHINA GOVT 331125	2.67	7,000	7,090	145,905	2033/11/25
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	16,000	16,194	333,226	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	10,000	10,112	208,073	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	7,000	7,074	145,572	2032/8/15
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	3,000	3,053	62,829	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	7,000	7,117	146,449	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	5,000	5,082	104,590	2032/5/15
		2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	4,000	4,076	83,881	2029/12/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	2,000	2,040	41,977	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 300325	2.8	4,000	4,074	83,841	2030/3/25
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	6,000	6,112	125,770	2032/11/15
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	12,000	12,214	251,331	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	7,000	7,195	148,067	2033/2/25
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	5,136	105,688	2031/11/18
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	4,000	4,100	84,367	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	4,000	4,026	82,848	2024/10/17
		3 CHINA GOVT 531015	3.0	1,000	1,057	21,767	2053/10/15
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	12,000	12,348	254,095	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	15,000	15,238	313,556	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	10,000	10,349	212,965	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	7,000	7,131	146,752	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	7,000	7,180	147,745	2026/12/5
		3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	4,000	4,246	87,385	2052/10/25
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	14,000	14,557	299,539	2029/11/21
		3.19 CHINA GOVT 530415	3.19	4,000	4,356	89,643	2053/4/15
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,188	189,075	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	12,200	12,517	257,578	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,448	215,005	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	10,000	10,530	216,689	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,438	235,370	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	15,000	15,712	323,303	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	5,000	5,546	114,137	2052/4/15
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	4,000	4,566	93,956	2051/10/18
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	5,000	5,929	122,001	2051/4/12

銘柄	当 期 末					
	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		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	8,000	9,518	195,861	2050/9/14
小 計					8,687,035	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	105,600	110,388	863,241	2026/12/21
	11.625 SOUTH AFRI 530331	11.625	12,200	11,615	90,837	2053/3/31
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	39,800	26,238	205,182	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	35,300	21,326	166,773	2041/2/28
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	71,000	59,629	466,301	2031/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	135,300	125,003	977,528	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	120,700	105,389	824,143	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	103,400	80,838	632,154	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	97,200	71,947	562,628	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	146,200	107,530	840,885	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRI 350228	8.875	112,500	94,950	742,509	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	88,900	69,386	542,602	2040/1/31
小 計					6,914,787	
合 計					84,312,998	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 84,312,998	% 96.0
コール・ローン等、その他	3,501,028	4.0
投資信託財産総額	87,814,026	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(87,774,883千円)の投資信託財産総額(87,814,026千円)に対する比率は100.0%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=147.70円	1 アルゼンチンペソ=0.1793円	1 メキシコペソ=8.5875円	1 ブラジルリアル=30.013円
100チリペソ=16.2275円	100コロンビアペソ=3.7444円	1ペルーヌエボソル=39.1979円	1ウルグアイペソ=3.7866円
1ドミニカペソ=2.5074円	1ユーロ=160.17円	1セルビアディナール=1.365564円	1トルコリラ=4.8773円
1チェココルナ=6.4751円	100ハンガリーフォリント=41.5891円	1ポーランドズロチ=36.6078円	1ルーマニアレイ=32.1801円
1マレーシアリンギット=31.1638円	1タイバーツ=4.14円	1フィリピンペソ=2.6116円	100インドネシアルピア=0.94円
1中国元=20.5768円	1エジプトポンド=4.7772円	1南アフリカランド=7.82円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	88,052,622,459
コール・ローン等	1,951,476,741
公社債(評価額)	84,312,998,200
未収入金	433,928,679
未収利息	1,238,196,857
前払費用	116,021,982
(B) 負債	308,428,946
前受収益	188,001
未払金	242,940,331
未払解約金	65,300,606
未払利息	8
(C) 純資産総額(A-B)	87,744,193,513
元本	49,510,869,131
次期繰越損益金	38,233,324,382
(D) 受益権総口数	49,510,869,131口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,722円

○損益の状況 (2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,640,990,668
受取利息	4,640,123,564
その他収益金	909,215
支払利息	△ 42,111
(B) 有価証券売買損益	9,156,655,910
売買益	10,394,871,164
売買損	△ 1,238,215,254
(C) 保管費用等	△ 64,590,944
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,733,055,634
(E) 前期繰越損益金	20,913,429,981
(F) 追加信託差損益金	4,767,238,004
(G) 解約差損益金	△ 1,180,399,237
(H) 計(D+E+F+G)	38,233,324,382
次期繰越損益金(H)	38,233,324,382

<注記事項>

- ①期首元本額 43,842,059,667円
 期中追加設定元本額 7,525,241,433円
 期中一部解約元本額 1,856,431,969円
 また、1口当たり純資産額は、期末17,722円です。

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	17,019,451,149円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	12,067,881,762円
つみたて8資産均等バランス	8,379,537,851円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,418,521,516円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,108,700,752円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	2,179,237,577円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,185,760,687円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	540,095,515円
海外債券セレクション(ラップ向け)	521,700,608円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	429,232,924円
eMAXIS バランス(波乗り型)	305,210,639円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	204,942,771円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	90,816,773円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	36,342,096円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10,364,781円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	6,099,084円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,834,032円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,617,811円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,520,803円
合計	49,510,869,131円

[お知らせ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)

グローバル社債ファンドT (適格機関投資家専用)

損益の状況、組入資産の明細は「グローバル社債ファンドT (適格機関投資家専用)」の第7期(2022年9月6日～2023年9月5日)の決算資料から抜粋したものです。

■ 損益及び剰余金計算書

項目	第6期	第7期
	自 2021年9月7日 至 2022年9月5日	自 2022年9月6日 至 2023年9月5日
	金額(円)	金額(円)
I 営業収益		
有価証券売買等損益	1,174,442,634	2,827,581,016
営業収益合計	1,174,442,634	2,827,581,016
II 営業費用		
受託者報酬	14,290,746	14,496,585
委託者報酬	100,200,885	101,548,277
その他費用	936,436	872,642
営業費用合計	115,428,067	116,917,504
営業利益金額または損失金額(△)	1,059,014,567	2,710,663,512
経常利益金額または損失金額(△)	1,059,014,567	2,710,663,512
当期純利益金額または純損失金額(△)	1,059,014,567	2,710,663,512
III 一部解約に伴う当期純利益金額 または純損失金額(△)分配額	28,578,303	135,458,011
IV 期首剰余金または欠損金(△)	7,413,002,736	8,266,344,253
V 剰余金増加額	621,995,275	737,703,240
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(621,995,275)	(737,703,240)
VI 剰余金減少額	799,090,022	1,593,393,400
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(799,090,022)	(1,593,393,400)
VII 期末剰余金または欠損金(△)	8,266,344,253	9,985,859,594

■ 組入資産の明細

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	グローバル社債マザーファンド	22,523,311,600	33,039,445,786	
	合計	22,523,311,600	33,039,445,786	

下記は、グローバル社債マザーファンドの内容です。

有価証券明細表 (債券)

(2023年9月5日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	米ドル	ELECTRICITE DE FRANCE SA	700,000.00	716,353.35	
		MDC-GMTN B. V.	500,000.00	488,685.00	
	計	銘柄数: 2	1,200,000.00	1,205,038.35	
				(176,610,420)	
		組入時価比率: 0.5%		0.5%	
	ユーロ	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	750,000.00	724,183.50	
		PETROLEOS MEXICANOS	1,200,000.00	1,076,240.40	
	計	銘柄数: 2	1,950,000.00	1,800,423.90	
				(284,773,048)	
		組入時価比率: 0.9%		0.9%	
	小計			461,383,468	
				(461,383,468)	
社債券	米ドル	ADVENT HEALTH SYSTEM	925,000.00	915,683.17	
		AIR LEASE CORP	225,000.00	188,425.40	
		ALIBABA GROUP HOLDING	900,000.00	718,364.57	
		AMAZON.COM INC	250,000.00	175,464.42	
		AMAZON.COM INC	300,000.00	244,828.02	
		AMERICAN INTL GROUP	552,000.00	530,156.07	
		AMGEN INC	375,000.00	364,677.13	
		ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV	225,000.00	206,645.25	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	425,000.00	386,125.98	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	545,000.00	484,756.46	
		ANTHEM INC	875,000.00	727,475.41	
		APPLE INC	625,000.00	442,035.11	
		APPLE INC	1,525,000.00	1,072,189.38	
		AT&T INC	1,895,000.00	1,216,916.97	
		AT&T INC	570,000.00	385,966.50	
		ATHENE GLOBAL FUNDING	250,000.00	217,377.77	
		AUST & NZ BANKING GROUP	1,075,000.00	814,785.82	
		AVIATION CAPITAL GROUP	700,000.00	695,120.21	
		AVIATION CAPITAL GROUP	625,000.00	616,891.70	
		BAIDU INC	675,000.00	612,416.39	
		BANC CREDITO INVERSIONES	300,000.00	244,228.30	
		BANCO DE CREDITO DEL PER	620,000.00	593,450.11	
		BANCO SANTANDER SA	200,000.00	195,700.29	
		BANCO SANTANDER SA	200,000.00	198,773.74	
		BANK HAPOLIM	700,000.00	601,527.50	
		BANK OF AMERICA CORP	525,000.00	503,432.54	
		BANK OF AMERICA CORP	4,975,000.00	4,050,351.57	
		BANK OF AMERICA CORP	2,075,000.00	1,911,703.40	
		BANK OF IRELAND GROUP	1,675,000.00	1,477,451.32	
		BAT CAPITAL CORP	606,000.00	561,481.08	
BAT CAPITAL CORP	75,000.00	51,846.78			
BBVA BANCOMER SA TEXAS	400,000.00	402,296.80			
BELROSE FUNDING TRUST	350,000.00	266,578.81			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	1,000,000.00	611,099.16	
		BERRY GLOBAL INC	373,000.00	366,039.65	
		BMW US CAPITAL LLC	400,000.00	333,343.72	
		BOEING CO	550,000.00	473,848.83	
		BOEING CO	875,000.00	698,257.47	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	625,000.00	567,885.37	
		BPCE SA	2,225,000.00	2,191,845.20	
		BPCE SA	575,000.00	442,619.42	
		BPCE SA	1,000,000.00	787,212.22	
		BROOKFIELD CAPITAL FIN	400,000.00	398,719.72	
		BROOKFIELD FINANCE LLC	75,000.00	48,109.96	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	700,000.00	672,198.81	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	100,000.00	99,765.92	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	25,000.00	23,626.35	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	300,000.00	294,722.53	
		CELANESE US HOLDINGS LLC	800,000.00	800,231.45	
		CELANESE US HOLDINGS LLC	754,000.00	754,299.97	
		CENTENE CORP	2,475,000.00	1,963,265.43	
		CHARLES SCHWAB CORP	1,205,000.00	1,198,472.30	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	425,000.00	340,375.16	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	550,000.00	355,485.38	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	250,000.00	189,481.90	
		CHINA CINDA 2020 I MNGMN	900,000.00	773,541.00	
		CITIGROUP INC	1,525,000.00	1,316,798.17	
		CLEVELAND ELECTRIC ILLUM	675,000.00	628,886.09	
		CNO FINANCIAL GROUP INC	490,000.00	465,926.46	
		CNO GLOBAL FUNDING	350,000.00	310,576.92	
		COINBASE GLOBAL INC	500,000.00	368,256.65	
		COLUMBIA PIPELINE HOLDCO	125,000.00	126,203.22	
		COLUMBIA PIPELINE HOLDCO	525,000.00	529,149.52	
		COMCAST CORP	1,625,000.00	995,261.15	
		COMMERZBANK AG	650,000.00	649,985.64	
		COMMONSPIRIT HEALTH	1,000,000.00	1,020,640.81	
		CONCENTRIX CORP	1,100,000.00	1,100,802.09	
		CONTINENTAL RESOURCES	525,000.00	468,356.68	
		COREBRIDGE FINANCIAL INC	1,000,000.00	938,599.08	
		CVS HEALTH CORP	825,000.00	650,734.44	
		CVS HEALTH CORP	325,000.00	313,585.57	
		DEUTSCHE BANK NY	875,000.00	859,866.76	
		DEUTSCHE BANK NY	925,000.00	923,515.70	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	375,000.00	385,195.18	
		DICK'S SPORTING GOODS	1,090,000.00	699,663.06	
		DTE ELECTRIC CO	700,000.00	458,728.51	
		ENBRIDGE INC	975,000.00	969,394.17	
		ENBRIDGE INC	325,000.00	250,681.05	
		ENEL FINANCE AMERICA LLC	875,000.00	544,977.46	
		ENEL FINANCE INTL NV	675,000.00	613,797.57	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	ENEL SPA	1,675,000.00	1,667,350.71	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	425,000.00	425,059.20	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	325,000.00	235,648.11	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	375,000.00	252,802.38	
		EQUITABLE FINANCIAL LIFE	1,325,000.00	1,028,921.09	
		ESTEE LAUDER CO INC	975,000.00	938,186.32	
		EVERSOURCE ENERGY	475,000.00	456,805.60	
		F&G ANNUITIES & LIFE INC	950,000.00	965,458.41	
		FELLS POINT FUNDING TR	1,200,000.00	1,096,398.26	
		FIFTH THIRD BANCORP	225,000.00	227,279.24	
		FIVE CORNERS FND TR II	550,000.00	468,883.62	
		FORD MOTOR CREDIT CO LLC	575,000.00	544,639.94	
		FORTUNE BRANDS INNOVATIO	950,000.00	941,578.55	
		FOUNDRY JV HOLDCO LLC	550,000.00	538,693.62	
		GENERAL MOTORS CO	475,000.00	474,573.00	
		GENERAL MOTORS CO	300,000.00	293,565.39	
		GENERAL MOTORS FINL CO	2,250,000.00	2,224,977.65	
		GEORGIA-PACIFIC LLC	675,000.00	563,967.45	
		GLENCORE FUNDING LLC	600,000.00	562,351.20	
		GLENCORE FUNDING LLC	500,000.00	404,430.49	
		GLOBAL ATLANTIC	680,000.00	491,890.78	
		GLOBAL PAYMENTS INC	475,000.00	399,561.51	
		GLOBAL PAYMENTS INC	200,000.00	162,928.52	
		GLOBAL PAYMENTS INC	550,000.00	536,175.93	
		HARBORWALK FUNDING	225,000.00	198,658.26	
		HCA INC	850,000.00	675,191.53	
		HSBC HOLDINGS PLC	275,000.00	276,319.03	
		HYATT HOTELS CORP	700,000.00	670,086.95	
		INDIANA MICHIGAN POWER	475,000.00	379,276.79	
		INDOFOOD CBP SUKSES MAKM	300,000.00	248,700.00	
		INTEL CORP	925,000.00	905,107.99	
		INTERSTATE POWER & LIGHT	375,000.00	261,610.33	
		INTESA SANPAOLO SPA	1,650,000.00	1,644,124.25	
		JBS USA/FOOD/FINANCE	975,000.00	877,358.62	
		JERSEY CENTRAL PWR & LT	650,000.00	526,300.72	
		JETBLUE 2019-1 CLASS AA	904,604.82	771,266.52	
		JPMORGAN CHASE & CO	575,000.00	547,993.87	
		JPMORGAN CHASE & CO	750,000.00	610,016.94	
		JPMORGAN CHASE & CO	2,475,000.00	2,431,480.46	
		KEY BANK NA	725,000.00	698,460.71	
		KEYCORP	250,000.00	214,502.30	
		KYNDRYL HOLDINGS INC	775,000.00	646,826.56	
		LEASEPLAN CORPORATION NV	1,400,000.00	1,345,154.14	
		LOWE'S COS INC	275,000.00	172,187.97	
		LOWE'S COS INC	100,000.00	96,472.46	
		LYB INT FINANCE III	275,000.00	202,131.77	
		MACQUARIE GROUP LTD	900,000.00	701,657.27	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	MARRIOTT INTERNATIONAL	550,000.00	454,478.65	
		MET LIFE GLOB FUNDING I	575,000.00	495,993.24	
		MICRON TECHNOLOGY INC	525,000.00	411,285.24	
		MICRON TECHNOLOGY INC	400,000.00	389,185.15	
		MICROSOFT CORP	700,000.00	454,930.94	
		MIDWEST CONNECTOR CAPIT	1,050,000.00	970,732.49	
		NATIONAL BANK OF CANADA	1,888,000.00	1,867,384.38	
		NATIONWIDE BUILDING SOCI	1,425,000.00	1,319,416.52	
		NBN CO LTD	1,200,000.00	956,927.20	
		NEWCASTLE COAL INFRASTRU	1,475,000.00	1,336,444.63	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	2,400,000.00	2,355,615.33	
		NISSAN MOTOR CO	975,000.00	974,240.75	
		NORDEA BANK ABP	1,000,000.00	989,570.32	
		NOVA CHEMICALS CORP	575,000.00	566,453.02	
		OCCIDENTAL PETROLEUM COR	1,125,000.00	1,213,964.68	
		ONEOK INC	125,000.00	110,120.48	
		ONEOK INC	725,000.00	726,976.69	
		OOREDOO INTL FINANCE	580,000.00	493,447.18	
		ORACLE CORP	475,000.00	323,985.63	
		ORACLE CORP	400,000.00	303,432.79	
		PELOTON INTERACTIVE INC	615,000.00	462,759.50	
		PHILIP MORRIS INTL INC	575,000.00	564,291.95	
		POWER FINANCE CORP LTD	925,000.00	770,081.00	
		PROMIGAS/GASES PACIFICO	215,000.00	183,031.43	
		PSA TREASURY PTE LTD	500,000.00	423,237.44	
		PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	675,000.00	540,649.63	
		QNB FINANCE LTD	350,000.00	322,181.65	
		RESORTS WORLD/RWLV CAP	700,000.00	570,412.71	
		ROCKIES EXPRESS PIPELINE	375,000.00	354,197.58	
		ROGERS COMMUNICATIONS IN	1,300,000.00	993,487.43	
		RTX CORP	425,000.00	340,154.71	
		S&P GLOBAL INC	150,000.00	115,823.77	
		S&P GLOBAL INC	150,000.00	115,129.88	
		SABINE PASS LIQUEFACTION	600,000.00	561,747.59	
		SANTOS FINANCE LTD	1,350,000.00	1,248,925.50	
		SGSP AUSTRALIA ASSETS	900,000.00	844,600.50	
		SIGMA ALIMENTOS SA	650,000.00	618,943.78	
		SMITHFIELD FOODS INC	900,000.00	660,546.67	
		SOCIETE GENERALE	1,250,000.00	1,190,322.20	
		SOUTHERN CO	750,000.00	739,941.35	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	426,562.50	422,208.04	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	427,500.00	423,323.17	
		SWEDBANK AB	525,000.00	506,191.24	
		SYNGENTA FINANCE NV	700,000.00	681,520.32	
		SYNOVUS BANK GA	1,550,000.00	1,432,679.75	
		T-MOBILE USA INC	250,000.00	197,482.31	
		TORONTO-DOMINION BANK	1,150,000.00	1,167,250.00	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	TRANSPRTDRA DE GAS INTL	340,000.00	324,416.50	
		TRUIST FINANCIAL CORP	1,225,000.00	1,205,886.57	
		UBS AG	925,000.00	913,737.20	
		UBS GROUP AG	350,000.00	339,011.72	
		UBS GROUP AG	1,375,000.00	1,262,016.44	
		UBS GROUP AG	300,000.00	309,575.13	
		UNION ELECTRIC CO	550,000.00	426,777.67	
		UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,425,000.00	1,325,663.66	
		UNITEDHEALTH GROUP INC	350,000.00	330,771.30	
		US BANCORP	1,025,000.00	1,016,556.08	
		VAR ENERGI ASA	600,000.00	624,336.00	
		VERIZON COMMUNICATIONS	240,000.00	141,134.98	
		VICI PROPERTIES / NOTE	650,000.00	637,635.05	
		VICI PROPERTIES / NOTE	475,000.00	417,797.82	
		VIRGINIA ELEC & POWER CO	225,000.00	141,951.98	
		VIRGINIA ELEC & POWER CO	575,000.00	327,355.54	
		WALMART INC	600,000.00	419,965.08	
		WARNERMEDIA HOLDINGS INC	315,000.00	244,641.56	
		WARNERMEDIA HOLDINGS INC	735,000.00	571,096.12	
		WELLS FARGO & COMPANY	700,000.00	694,763.60	
		WELLS FARGO & COMPANY	1,150,000.00	981,904.82	
		WESTPAC BANKING CORP	1,075,000.00	822,516.81	
		WILLIAMS COMPANIES INC	1,025,000.00	1,017,185.79	
		WILLIAMS COMPANIES INC	200,000.00	177,792.97	
		XCEL ENERGY INC	600,000.00	512,449.45	
		ZURICH FINANCE IRELAND	1,050,000.00	819,170.10	
	計	銘柄数: 200	149,591,667.32	132,223,981.60	
				(19,378,746,742)	
		組入時価比率: 58.7%		60.3%	
	ユーロ	2I RETE GAS SPA	575,000.00	526,026.24	
		AEROPORTS DE PARIS	400,000.00	331,356.93	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	100,000.00	81,538.30	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	400,000.00	314,725.92	
		ALLIANZ SE	1,400,000.00	1,370,775.00	
		ASR NEDERLAND NV	2,000,000.00	1,975,890.00	
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,000,000.00	1,014,437.69	
		ASTM SPA	700,000.00	570,139.50	
		AUSGRID FINANCE PTY LTD	300,000.00	231,843.90	
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	1,200,000.00	1,046,118.00	
		AUST & NZ BANKING GROUP	500,000.00	495,770.49	
		AXA SA	1,400,000.00	1,270,076.65	
		AXA SA	525,000.00	515,088.00	
		BANCO SANTANDER SA	900,000.00	897,143.20	
		BANCO SANTANDER SA(REGS)	1,000,000.00	963,512.54	
		BANQUE FED CRED MUTUEL	1,000,000.00	997,432.00	
		BANQUE FED CRED MUTUEL	400,000.00	392,016.80	
		BASF SE	1,000,000.00	985,730.00	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	BASF SE	400,000.00	406,994.80	
		BAYER AG	700,000.00	554,458.51	
		BAYER AG	330,000.00	332,201.10	
		BHP BILLITON FINANCE LTD	1,000,000.00	1,008,225.00	
		BLACKSTONE PP EUR HOLD	800,000.00	664,068.00	
		BNP PARIBAS	1,400,000.00	1,397,608.35	
		BPCE SA	500,000.00	491,586.24	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO	650,000.00	517,562.50	
		CAIXABANK SA	1,800,000.00	1,698,103.80	
		CELLNEX TELECOM SA	400,000.00	340,794.40	
		CK HUTCHISON EUROPE	1,050,000.00	847,389.11	
		COMMONWEALTH BANK AUSTRA	1,600,000.00	1,539,017.60	
		CREDIT AGRICOLE ASSRNCES	1,500,000.00	1,458,153.00	
		CREDIT AGRICOLE SA	600,000.00	588,202.26	
		CREDIT AGRICOLE SA	500,000.00	494,284.50	
		CREDIT AGRICOLE SA	500,000.00	485,286.31	
		CREDIT AGRICOLE SA	600,000.00	523,795.20	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	525,000.00	466,536.70	
		DANSKE BANK A/S	200,000.00	188,567.00	
		DEUTSCHE BANK AG	400,000.00	374,472.80	
		DUKE ENERGY CORP	650,000.00	616,415.42	
		DUKE ENERGY CORP	575,000.00	522,887.95	
		ELI LILLY & CO	600,000.00	398,949.60	
		ENERGIAS DE PORTUGAL SA	400,000.00	369,884.00	
		EUROCLEAR INVESTMENTS SA	600,000.00	545,683.80	
		FIDELITY NATL INFO SERV	600,000.00	481,816.80	
		FRESENIUS SE & CO KGAA	450,000.00	407,592.45	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	500,000.00	452,411.66	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,100,000.00	1,571,239.95	
		GRIFOLS SA	550,000.00	497,040.50	
		HOWOGE WOHNUNGS	400,000.00	332,522.23	
		IBERDROLA FINANZAS SAU	400,000.00	388,184.00	
		IBERDROLA INTL BV	800,000.00	624,800.00	
		IMPERIAL BRANDS FIN NETH	575,000.00	568,646.82	
		IMPERIAL BRANDS FIN PLC	1,750,000.00	1,636,929.00	
		ING GROEP NV	2,300,000.00	2,079,478.30	
ING GROEP NV	1,000,000.00	849,356.00			
INTESA SANPAOLO SPA	500,000.00	501,256.50			
INTRUM AB	52,111.11	50,050.58			
JAB HOLDINGS BV	500,000.00	503,515.00			
JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	616,197.57			
JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	526,846.60			
LLOYDS BANKING GROUP	550,000.00	513,895.80			
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,000,000.00	1,998,700.00			
LOGICOR FINANCING SARL	400,000.00	354,563.63			
MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS	250,000.00	154,247.50			
NORTEGAS ENERGIA DISTRI	114,000.00	104,103.56			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	NORTEGAS ENERGIA DISTRI	400,000.00	306,244.40	
		OPTUS FINANCE PTY LTD	500,000.00	415,289.50	
		PROLOGIS EURO FINANCE	475,000.00	397,561.22	
		PROLOGIS EURO FINANCE	650,000.00	630,542.25	
		Q-PARK HOLDING BV	450,000.00	436,648.05	
		RWE AG	800,000.00	736,980.80	
		SAMPO OYJ	500,000.00	389,864.61	
		SCENTRE MGMT LTD	550,000.00	459,815.10	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA	500,000.00	435,230.00	
		SOCIETE GENERALE	2,600,000.00	2,348,028.80	
		STANDARD INDUSTRIES INC	475,000.00	421,353.02	
		STATE GRID OVERSEAS INV	750,000.00	684,662.25	
		TECHEM VERWALTUNGSGESELL	275,000.00	265,082.67	
		TELEFONICA EUROPE BV	600,000.00	589,221.00	
		TENNET HOLDING BV	950,000.00	1,019,109.65	
		TERNA RETE ELETTRICA	500,000.00	431,627.50	
		THERMO FISHER SC FNCE I	750,000.00	469,981.50	
		THERMO FISHER SCIENTIFIC	1,050,000.00	646,467.15	
		TOTALENERGIES SE	550,000.00	482,686.60	
		UBS GROUP AG	500,000.00	455,083.00	
		UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	350,000.00	345,906.75	
		VERIZON COMMUNICATIONS	600,000.00	415,144.80	
		VOLKSWAGEN INTL FIN NV	1,500,000.00	1,427,992.50	
		VONOVIA SE	1,000,000.00	790,785.00	
		VONOVIA SE	800,000.00	610,048.80	
		WESTPAC BANKING CORP	1,500,000.00	1,331,923.50	
		WINTERSHALL DEA FIN 2BV	700,000.00	561,239.00	
		WINTERSHALL DEA FINANCE	1,300,000.00	1,106,712.10	
	計	銘柄数 :	93	71,846,111.11	64,635,375.08
					(10,223,377,276)
		組入時価比率 :	30.9%		31.8%
	英ポンド	ANNINGTON FUNDING PLC	275,000.00	189,036.30	
		APT PIPELINES LTD	675,000.00	566,280.45	
		AT&T INC	1,150,000.00	1,041,615.95	
		BANQUE FED CRED MUTUEL	700,000.00	628,912.20	
		BNP PARIBAS	800,000.00	558,957.85	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	450,000.00	370,290.42	
		HSBC HOLDINGS PLC	2,300,000.00	2,102,730.28	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,125,000.00	1,078,141.23	
		MCKESSON CORP	475,000.00	413,301.61	
		NATIONAL GRID GAS PLC	550,000.00	355,271.47	
		NGG FINANCE PLC	425,000.00	406,151.25	
		ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,000,000.00	924,793.13	
		SANTANDER UK GROUP HLDGS	1,100,000.00	1,027,916.91	
		SEGRO PLC	705,000.00	581,383.89	
		VIRGIN MEDIA SECURED FIN	350,000.00	280,354.90	
		WESTERN POWER DIST WEST	600,000.00	589,321.57	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	計	銘柄数： 16	12,680,000.00	11,114,459.41	
				(2,057,397,581)	
		組入時価比率： 6.2%		6.4%	
	小計			31,659,521,599	
				(31,659,521,599)	
	合計			32,120,905,067	
				(32,120,905,067)	

(注1) 通貨種類毎の計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 種類毎の小計欄および合計金額欄の()は、外貨建有価証券に関わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各計欄の合計金額に対する比率であります。

デリバティブ取引等関係

①ヘッジ会計が適用されていないもの

(1) 通貨関連

区分	種類	(2023年9月5日現在)			
		契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	2,040,146,810	—	2,070,214,350	△30,067,540
	カナダドル	82,285,763	—	82,241,325	44,438
	ユーロ	3,517,218,782	—	3,631,374,246	△114,155,464
	英ポンド	709,704,480	—	730,992,962	△21,288,482
	買建				
	米ドル	4,093,247,625	—	4,202,326,583	109,078,958
	カナダドル	1,194,273,373	—	1,229,427,180	35,153,807
	ユーロ	564,883,822	—	570,067,013	5,183,191
	英ポンド	52,524,360	—	52,475,713	△48,647
	スイスフラン	140,065,700	—	144,475,650	4,409,950
オーストラリアドル	151,938,182	—	153,312,250	1,374,068	
合計		12,546,288,897	—	12,866,907,272	△10,315,721

(注) 1. 時価の算定方法

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日(以下、「当該日」とする。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該仲値で評価しております。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(2) 債券関連

区分	種類	(2023年9月5日現在)			
		契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	4,944,917,593	—	4,941,972,918	2,944,675
	買建	8,950,414,167	—	9,021,516,465	71,102,298
合計		13,895,331,760	—	13,963,489,383	74,046,973

(注) 1. 時価の算定方法

1) 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

主たる取引所の発表清算値段または最終相場で評価しております。

2) 債券先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3) 契約額等および時価の邦貨換算は対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

②ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。