

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	信託期間は2015年5月12日から2025年4月28日までです。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 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 世界債券総合インデックスマザーファンド ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用) フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用) PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class マネーボールマザーファンド
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	原則として4月26日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

外国債券SMTBセレクション (SMA専用)

運用報告書(全体版)

第8期(決算日 2023年4月26日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

「外国債券SMTBセクション(SMA専用)」の主要投資対象である「世界債券総合インデックスマザーファンド」は第1期決算日(2024年4月26日)を迎えていないため、記載すべき運用報告書はございません。

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	債券先物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
第4期(2019年4月26日)	9,162	0	1.3	72.8	0.5	24.7	98,107
第5期(2020年4月27日)	9,283	0	1.3	71.9	1.0	24.9	83,337
第6期(2021年4月26日)	9,815	0	5.7	72.6	0.6	24.4	92,153
第7期(2022年4月26日)	10,090	0	2.8	61.9	0.7	35.6	106,834
第8期(2023年4月26日)	10,113	0	0.2	44.5	0.1	52.2	77,299

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物率	投資信託証券組入比率
		騰落率			
(当期首) 2022年 4月26日	円 10,090	% —	% 61.9	% 0.7	% 35.6
4月末	10,080	△0.1	62.1	0.5	35.3
5月末	10,016	△0.7	48.1	0.8	49.1
6月末	10,247	1.6	48.3	0.6	49.4
7月末	10,361	2.7	48.4	0.4	49.6
8月末	10,259	1.7	48.3	0.6	49.3
9月末	10,091	0.0	48.8	0.7	48.7
10月末	10,336	2.4	48.3	0.8	49.0
11月末	10,105	0.1	48.5	0.5	49.1
12月末	9,694	△3.9	48.1	0.7	49.5
2023年 1月末	9,820	△2.7	48.0	0.7	49.6
2月末	9,910	△1.8	48.5	0.6	49.2
3月末	9,978	△1.1	48.9	0.3	49.2
(当期末) 2023年 4月26日	10,113	0.2	44.5	0.1	52.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

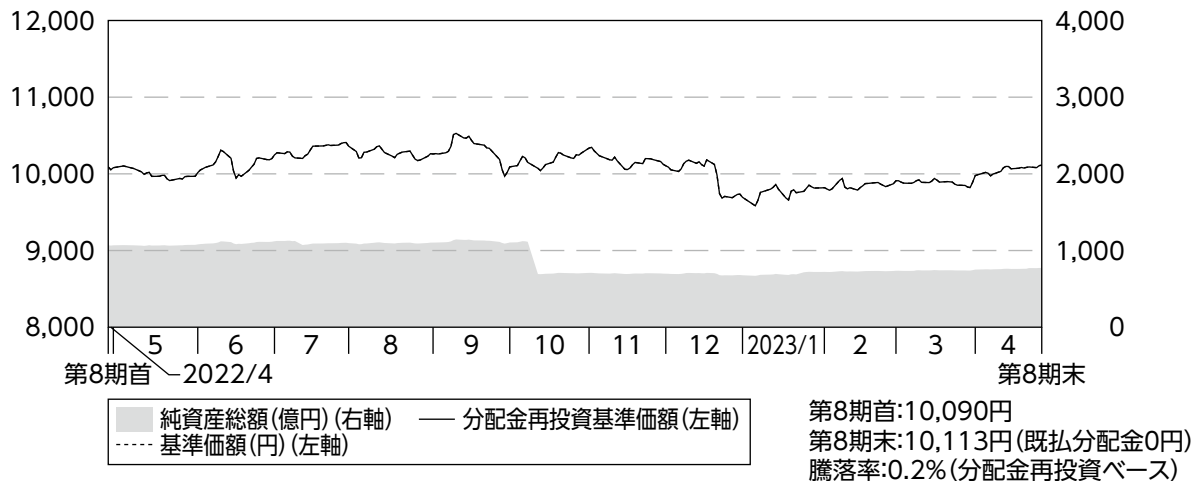
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2022年4月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの投資対象ファンドの騰落率は以下の通りです。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
外国債券インデックス マザーファンド	日本を除く世界の 主要国の公社債	23.4%	△0.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国の債券	4.8%	9.7%
世界債券総合インデックスマザーファンド	ベンチマークであるブルーム バーグ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (円換算ベース)を構成する 通貨建ての債券等	20.8%	0.4%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	日本を除く世界の公社債	19.8%	0.7%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド (適格機関投資家専用)	世界各国の投資適格 債券(除く日本円)	15.0%	1.3%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	日本を除く世界の債券等	14.8%	1.7%
マネープールマザーファンド	わが国の公社債等	0.0%	△0.0%

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 期中に組み入れたファンドの騰落率は当ファンドへの組入日からのものです。

○先進国債券市場

主要国の長期金利は、期初は商品価格の高騰やFRB(米連邦準備理事会)高官の利上げを示唆する発言を背景に上昇しました。6月下旬から7月下旬にかけて、米GDP(国内総生産)成長率の低下などから主要国の先行きの景気後退リスクが意識されて、主要国の長期金利上昇は一服したものの、8月上旬から10月下旬にかけて、FRB高官によるインフレへの警戒感を示す発言が相次いだことや英国のCPI(消費者物価指数)の上昇などを材料に再び上昇しました。その後は、主要国のインフレ指標の伸び率鈍化を背景としたインフレ率のピークアウト期待と、FRB高官からの早期利下げに対する否定的な発言により、主要国の長期金利は一進一退となりました。

○新興国債券市場

新興国の長期金利は、当期初から10月にかけては主要国の中央銀行の金融引き締めにより金利上昇圧力がかかり上昇傾向となりました。11月にかけては先進国の長期金利低下を受けて新興国の長期金利も低下しましたが、その後は、インフレ指標の伸び率鈍化や経済環境の悪化懸念などが入り乱れ、国によってまちまちの推移となりました。

○外国為替市場

当期初から10月にかけては、主要国と日本の間での金融政策の方向性の違いから日本円は主要国通貨に対して下落しました。11月は米国でのCPI伸び率鈍化や主要国での利上げペース鈍化観測から円は主要国通貨に対して上昇しましたが、12月以降は欧米で金融政策の方向性が分かれたことから対円での主要国通貨もまちまちの動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

主として世界の債券および債券代替資産*を実質的な投資対象とし運用を行いました。各投資対象ファンドの投資割合は各ファンドのリターン・リスク特性や相関係数などに基づき決定しますが、市場環境等に応じて投資対象ファンドならびに投資割合の見直しを実施しました。

*「債券代替資産」とは、委託会社が債券と一定程度の類似性があると判断する資産等をいいます。

・外国債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しに伴い売却を行い、当期末時点における組入比率は23.4%となりました。

・新興国債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しに伴い売却を行うこととし、当期末時点における組入比率は4.8%となりました。

・世界債券総合インデックスマザーファンド

投資割合の見直しに伴い新規に組み入れを行い、当期末時点における組入比率は20.8%となりました。

・ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は19.8%となりました。

・フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は15.0%となりました。

・PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は14.8%となりました。

組入ファンド	当期首(前期末)	当期末
外国債券インデックス マザーファンド	56.7%	23.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	6.7%	4.8%
世界債券総合インデックスマザーファンド	—	20.8%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	15.2%	19.8%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	10.2%	15.0%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	10.2%	14.8%
マネープールマザーファンド	0.0%	0.0%

(注)比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

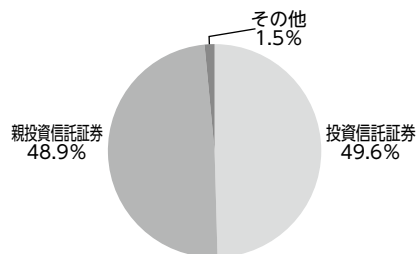
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

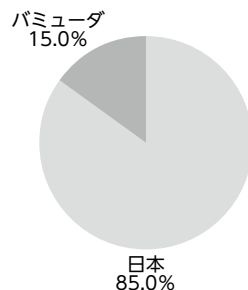
	当期末
	2023年4月26日
外国債券インデックス マザーファンド	23.4%
世界債券総合インデックスマザーファンド	20.8%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	19.8%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	15.0%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	14.8%
新興国債券インデックス マザーファンド	4.8%
マネープールマザーファンド	0.0%
その他	1.5%
組入ファンド数	7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

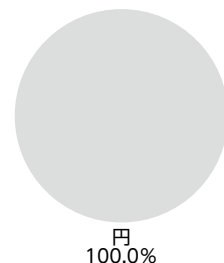
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第8期	
	2022年4月27日~2023年4月26日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	1,124	

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

主として、世界の債券及び債券代替資産を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。

各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年4月27日~2023年4月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	59円	0.583%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,074円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(32)	(0.319)	
(販売会社)	(22)	(0.220)	
(受託会社)	(4)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	2	0.020	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(2)	(0.017)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	61	0.604	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

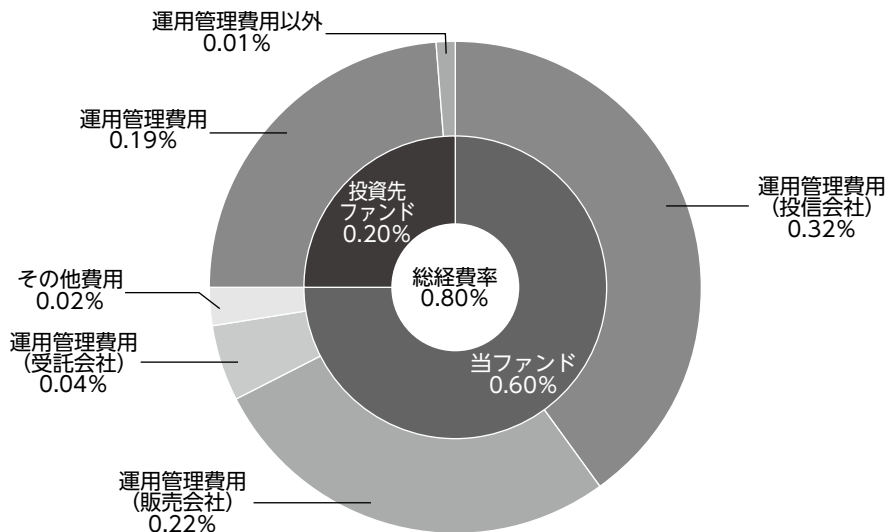
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<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0.80%です。



総経費率 (①+②+③)	0.80%
①当ファンドの費用の比率	0.60%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.19%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(注1)当ファンドの費用は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2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当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。)です。

(注5)当ファンドの費用は、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6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国 内	PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	千口 687	千円 6,943,660	千口 649	千円 6,683,020
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ ファンド(適格機関投資家専用)	8,005,276	8,193,660	7,534,487	7,797,800
	ウエスタン・グローバル債券 ファンド(適格機関投資家専用)	7,430,855	9,028,210	8,254,116	10,066,194

(注)金額は受渡代金です。

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 3,608,175	千円 11,240,990	千口 17,275,672	千円 53,649,070
新興国債券インデックス マザーファンド	259,560	454,550	2,432,726	4,261,010
世界債券総合インデックスマザーファンド	16,000,000	16,000,000	—	—

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投資信託受益証券	百万円 24,165	百万円 17,221	% 71.3	百万円 24,547	百万円 17,863	% 72.8
金 銭 信 託	0.066302	0.066302	100.0	0.066302	0.066302	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	442,006	43,989	10.0	442,133	43,849	9.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	44,001	95	0.2	75,562	455	0.6
金 銭 信 託	0.427490	0.427490	100.0	0.427490	0.427490	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	926,355	80,925	8.7	929,960	81,161	8.7

<平均保有割合 13.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.057391	0.057391	100.0	0.057391	0.057391	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	221,780	18,632	8.4	222,363	18,635	8.4

<平均保有割合 5.2%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<世界債券総合インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン	45,085	7,747	17.2	44,819	7,693	17.2

<平均保有割合 84.2%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<マネーパールマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	88,526,114	8,009,305	9.0	88,620,476	7,988,178	9.0

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
債券ファンド	千口	千円	%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	1,106	11,447,880	14.8
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	11,076,259	11,560,292	15.0
ウェスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	12,392,174	15,300,617	19.8
合 計	23,469,540	38,308,790	49.6

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当 期 首(前 期 末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	19,485,147	5,817,650	18,066,714
新興国債券インデックス マザーファンド	4,115,346	1,942,180	3,702,378
世界債券総合インデックスマザーファンド	—	16,000,000	16,057,600
マネープールマザーファンド	9	9	9

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

外国債券インデックス マザーファンド	91,033,209千口
新興国債券インデックス マザーファンド	54,143,353千口
世界債券総合インデックスマザーファンド	19,000,704千口
マネープールマザーファンド	286,508,901千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 38,308,790	% 49.4
外国債券インデックス マザーファンド	18,066,714	23.3
新興国債券インデックス マザーファンド	3,702,378	4.8
世界債券総合インデックスマザーファンド	16,057,600	20.7
マ ネ ー プ ール マ ザ ー フ ァ ン ド	9	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,443,891	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	77,579,382	100.0

(注1) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(281,732,737千円)の投資信託財産総額(282,773,748千円)に対する比率は99.6%です。

(注2) 新興国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(102,744,410千円)の投資信託財産総額(103,252,725千円)に対する比率は99.5%です。

(注3) 世界債券総合インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(18,803,093千円)の投資信託財産総額(34,379,469千円)に対する比率は54.7%です。

(注4) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=133.80円

1ブラジルリアル=26.4679円

1ペルー・ソル=35.6182円

1ユーロ=146.77円

1スウェーデンクローナ=12.98円

1チェココルナ=6.2437円

1ルーマニア・レイ=29.7396円

1シンガポールドル=100.01円

1フィリピンペソ=2.409円

1イスラエルシェケル=36.6929円

1カナダドル=98.19円

1チリペソ=0.164661円

1ウルグアイペソ=3.4496円

1イギリスポンド=165.98円

1ノルウェークローネ=12.52円

1ハンガリーフォリント=0.388425円

1オーストラリアドル=88.71円

1マレーシアリングギット=29.9686円

1インドネシアルピア=0.009円

1南アフリカランド=7.30円

1メキシコペソ=7.4113円

1コロンビアペソ=0.029652円

1ドミニカペソ=2.4519円

1スイスフラン=149.95円

1デンマーククローネ=19.69円

1ポーランドズロチ=31.9473円

1ニュージーランドドル=82.19円

1タイバーツ=3.90円

1オフショア人民元=19.2685円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年4月26日現在
(A) 資 産	77,579,382,636円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,443,888,646
投資信託受益証券(評価額)	38,308,790,929
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	18,066,714,528
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,702,378,572
世界債券総合インデックス マザーファンド(評価額)	16,057,600,000
マネーブルマザーファンド(評価額)	9,961
(B) 負 債	279,963,284
未 払 解 約 金	70,343,827
未 払 信 託 報 酬	208,680,494
未 払 利 息	1,756
そ の 他 未 払 費 用	937,207
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	77,299,419,352
元 本	76,433,560,415
次 期 繰 越 損 益 金	865,858,937
(D) 受 益 権 総 口 数	76,433,560,415口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,113円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
(A) 配 当 等 収 益	△541,653円
受 取 利 息	3,394
支 払 利 息	△545,047
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	796,691,166
売 買 益	1,335,997,846
売 買 損	△539,306,680
(C) 信 託 報 酬 等	△522,089,658
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	274,059,855
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,802,293,773
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,210,494,691
(配 当 等 相 当 額)	(5,412,445,416)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,622,940,107)
(G) 計 (D+E+F)	865,858,937
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	865,858,937
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,210,494,691
(配 当 等 相 当 額)	(5,419,756,206)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,630,250,897)
分 配 準 備 積 立 金	3,178,411,509
繰 越 損 益 金	△102,057,881

- (注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は105,879,766,572円、期中追加設定元本額は24,034,738,964円、期中一部解約元本額は53,480,945,121円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	376,117,736円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	5,419,756,206円
(D) 分配準備積立金額	2,802,293,773円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	8,598,167,715円
(F) 期末残存口数	76,433,560,415口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	1,124円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

投資対象ファンドの名称変更に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年7月12日)

投資対象とする投資信託証券を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年4月17日)

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	フランクリン・テンプレートン・ジャパン株式会社
運 用 方 針	ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。
主 要 運 用 対 象	「ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 〈マザーファンドの投資対象〉 主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

●損益の状況

項 目	第 4 期 自 2021年10月12日 至 2022年10月11日
(A)配 当 等 収 益	379,926円
そ の 他 収 益 金	379,926
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	15,177,991
売 買 益	121,136,409
売 買 損	△105,958,418
(C)信 託 報 酬 等	△77,250,757
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△61,692,840
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,550,273,095
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,537,189,132
(配 当 等 相 当 額)	(1,116,232,518)
(売 買 損 益 相 当 額)	(420,956,614)
(G)計 (D+E+F)	3,025,769,387
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	3,025,769,387
追 加 信 託 差 損 益 金	1,537,189,132
(配 当 等 相 当 額)	(1,136,683,866)
(売 買 損 益 相 当 額)	(400,505,266)
分 配 準 備 積 立 金	1,961,713,789
繰 越 損 益 金	△473,133,534

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 3 期 末		第 4 期 末	
	口	数	口	評 価 額
ウエスタン・グローバル債券マザーファンド	15,375,870	千口	14,367,949	千口 17,599,300 千円

下記は、ウエスタン・グローバル債券マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
国債証券					
ABU DHABI GOVT	2.7	680	404	58,927	2070/9/2
COLOMBIA GOVT	5.625	260	170	24,796	2044/2/26
FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	490	358	52,309	2045/1/27
REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	260	157	22,936	2045/6/15
REPUBLIC OF INDONESIA	4.2	640	494	72,122	2050/10/15
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	710	598	87,175	2028/10/12
UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,140	846	123,434	2046/1/23
US TREASURY BOND	4.75	870	948	138,253	2041/2/15
US TREASURY NOTE	0.25	1,890	1,693	246,857	2025/6/30
US TREASURY NOTE	0.375	4,500	3,969	578,684	2025/12/31
US TREASURY NOTE	0.375	11,250	9,885	1,441,073	2026/1/31
US TREASURY NOTE	0.75	4,400	3,886	566,576	2026/4/30
US TREASURY NOTE	2.5	1,040	968	141,119	2027/3/31
US TREASURY NOTE	1.125	1,020	630	91,906	2040/5/15
US TREASURY NOTE	2.0	270	190	27,839	2041/11/15
US TREASURY NOTE	2.875	180	145	21,146	2045/8/15
US TREASURY NOTE	1.375	200	113	16,590	2050/8/15
特殊債券(除く金融債)					
DELTA AIR LINES	4.5	60	58	8,539	2025/10/20
DELTA AIR LINES	4.75	60	55	8,146	2028/10/20
FHLMC #G67721	4.5	22	21	3,167	2049/4/1
FHLMC #Q59799	5.0	16	16	2,437	2048/11/1
FNMA #AL9546	3.5	44	40	5,870	2046/11/1
FNMA #AS9760	4.5	54	52	7,589	2047/6/1
FNMA #BK7700	4.5	82	79	11,594	2048/10/1
FNMA #BM4897	3.5	39	35	5,202	2046/12/1
FNMA #BP2319	3.0	56	48	7,123	2050/2/1
FNMA #BR0663	2.0	85	68	10,024	2051/2/1
FNMA #BR2664	2.0	75	60	8,876	2051/2/1
FNMA #BR4035	2.0	85	68	10,054	2051/2/1
FNMA #BR9104	2.5	74	62	9,096	2051/5/1
FNMA #BU1030	2.0	92	74	10,816	2051/11/1
FNMA #CA2047	4.5	49	48	7,034	2048/7/1
FNMA #CA2482	4.5	47	45	6,680	2048/10/1
FNMA #CA2652	5.0	59	58	8,543	2048/11/1
FNMA #CA9121	2.5	80	67	9,830	2051/2/1
FNMA #CB0414	2.5	84	70	10,293	2051/5/1
FNMA #CB1666	2.5	184	154	22,467	2051/9/1
FNMA #CB3044	2.5	98	81	11,930	2052/3/1
FNMA #FM1468	5.0	18	18	2,627	2049/8/1
FNMA #FM1727	5.0	26	26	3,823	2049/9/1
FNMA #FM2256	4.5	79	77	11,351	2044/10/1
FNMA #FM3347	3.5	161	146	21,425	2047/5/1
FNMA #FM3469	3.5	101	92	13,456	2048/8/1
FNMA #FM3773	3.5	491	445	64,958	2048/11/1
FNMA #FM4868	2.0	81	65	9,561	2050/11/1
FNMA #FM6117	3.0	174	153	22,361	2051/4/1
FNMA #FM6184	2.0	158	127	18,617	2051/3/1
FNMA #FM6448	2.0	88	71	10,353	2051/3/1
FNMA #FM6460	2.5	82	68	10,024	2051/3/1
FNMA #FM6555	2.0	86	69	10,135	2051/4/1
FNMA #FM7786	4.0	173	162	23,740	2049/1/1
FNMA #FM7900	2.5	86	72	10,543	2051/7/1

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
FNMA #FM7910	2.5	89	75	11,018	2051/7/1
FNMA #FM8576	3.0	1,250	1,097	160,053	2050/2/1
FNMA #FM8786	2.5	181	151	22,134	2051/10/1
FNMA #FM8864	2.5	89	75	10,935	2051/10/1
FNMA #FM9299	2.0	91	73	10,679	2051/10/1
FNMA #FS0028	2.5	93	78	11,404	2051/9/1
FNMA #FS0424	2.5	94	79	11,518	2052/1/1
FNMA #FS0439	2.5	94	78	11,450	2052/1/1
FNMA #FS0523	2.5	95	79	11,587	2052/2/1
FNMA #FS0965	2.0	95	76	11,184	2051/11/1
FNMA #FS1107	2.5	92	77	11,254	2051/12/1
FNMA #FS1289	3.0	95	83	12,161	2052/3/1
FNMA #FS1556	3.5	97	87	12,701	2052/5/1
FNMA #FS2740	3.5	97	88	12,835	2049/6/1
FNMA #FS2768	2.0	592	476	69,446	2052/1/1
FNMA 30YR DEC FWD	5.5	100	98	14,388	2051/12/1
G2SF 30YR DEC FWD	5.0	100	97	14,186	2051/12/1
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	200	195	28,452	2051/10/1
GNMA #783669	3.0	54	48	7,063	2042/9/15
GNMA #784571	3.5	68	63	9,244	2048/6/15
GNMA #AA5649	3.0	19	17	2,539	2042/9/15
GNMA #AB9109	3.0	15	13	2,039	2042/10/15
GNMA #AB9207	3.0	13	12	1,749	2042/11/15
GNMA #BBS439	3.5	44	41	6,006	2050/5/15
GNMA II 30YR OCT FWD	2.5	300	256	37,331	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.0	100	87	12,777	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.5	100	90	13,161	2051/10/1
GNMA2 #784825	3.5	12	11	1,681	2049/10/20
GNMA2 #784905	3.0	63	55	8,134	2050/1/20
GNMA2 #785218	2.0	81	66	9,757	2050/12/20
GNMA2 #785219	2.0	79	65	9,531	2050/12/20
GNMA2 #785220	2.0	84	69	10,159	2050/12/20
GNMA2 #785221	2.0	82	67	9,896	2050/12/20
GNMA2 #786095	3.0	98	84	12,389	2052/4/20
GNMA2 #786134	3.0	96	83	12,148	2052/4/20
GNMA2 #BS8420	4.0	37	35	5,237	2050/4/20
GNMA2 #BS8546	2.5	78	65	9,514	2050/12/20
GNMA2 #BZ4350	2.5	96	82	12,016	2051/3/20
GNMA2 #CD8312	2.5	81	68	10,107	2051/5/20
GNMA2 #CG3836	3.0	63	55	8,107	2047/9/20
GNMA2 #CN5161	3.5	293	262	38,313	2048/1/20
GNMA2 #MA1995	3.5	30	27	4,065	2044/6/20
GNMA2 #MA3875	4.0	195	183	26,766	2046/8/20
GNMA2 #MA4068	3.0	19	17	2,572	2046/11/20
GNMA2 #MA4836	3.0	6	5	782	2047/11/20
GNMA2 #MA4838	4.0	15	14	2,157	2047/11/20
GNMA2 #MA4901	4.0	15	14	2,121	2047/12/20
GNMA2 #MA5019	3.5	18	16	2,433	2048/2/20
GNMA2 #MA5137	4.0	11	11	1,604	2048/4/20
GNMA2 #MA5193	4.5	64	62	9,056	2048/5/20
GNMA2 #MA5265	4.5	113	109	15,932	2048/6/20
GNMA2 #MA5331	4.5	10	10	1,469	2048/7/20
GNMA2 #MA5398	4.0	95	89	13,033	2048/8/20
GNMA2 #MA5465	3.5	161	146	21,402	2048/9/20
GNMA2 #MA5467	4.5	21	21	3,084	2048/9/20

銘 柄	利 率 (%)	期 末			
		額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
GNMA2 #MA5711	4.5	20	19	2,896	2049/1/20
GNMA2 #MA5929	3.0	54	47	6,982	2049/5/20
GNMA2 #MA6477	4.5	18	17	2,603	2050/2/20
GNMA2 #MA6544	4.5	20	19	2,868	2050/3/20
GNMA2 #MA7194	3.0	345	305	44,499	2051/2/20
GNMA2 #MA7312	2.5	389	333	48,592	2051/4/20
GNMA2 #MA7649	2.5	182	156	22,784	2051/10/20
GNR 2020-H04 FP	2.85729	64	63	9,207	2069/6/20
GNR 2020-H13 FA	2.80729	67	65	9,484	2070/7/20
MILEAGE PLUS HOLDINGS LLC	6.5	66	66	9,624	2027/6/20
QB6998	2.0	79	64	9,387	2050/12/1
QB9057	2.0	82	65	9,613	2051/2/1
QB9290	2.0	87	70	10,261	2051/3/1
QC4446	2.5	88	73	10,740	2051/7/1
QC5830	2.5	91	76	11,127	2051/8/1
QC9511	2.0	92	74	10,856	2051/10/1
RA3913	2.5	391	328	47,912	2050/11/1
RA4175	2.5	78	65	9,618	2050/12/1
RA4414	2.5	78	65	9,612	2051/1/1
RA4703	2.0	84	68	9,948	2051/2/1
RA5276	2.5	85	71	10,454	2051/5/1
RA6332	2.0	188	150	22,001	2051/11/1
SD0573	2.0	77	62	9,121	2051/4/1
SD0958	3.5	96	86	12,563	2052/4/1
SD1143	4.5	185	177	25,943	2050/9/1
SD1218	4.0	564	528	77,102	2049/7/1
SD7525	2.5	151	127	18,582	2050/10/1
SD7548	2.5	371	311	45,376	2051/11/1
SD7552	2.5	94	79	11,556	2052/1/1
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	159	23,284	2051/11/1
ZS4720	4.5	86	83	12,205	2047/5/1
普通社債券 (含む投資法人債券)					
3M COMPANY	3.7	160	118	17,209	2050/4/15
ABBVIE INC	4.875	10	8	1,297	2048/11/14
ABBVIE INC	4.25	450	364	53,093	2049/11/21
AMERICAN INTL GROUP	2.5	40	37	5,433	2025/6/30
AMERICAN TRANSMISSION SY	2.65	40	31	4,604	2032/1/15
ANHEUSER-BUSCH	4.6	100	87	12,786	2046/2/1
ANHEUSER-BUSCH	4.6	10	8	1,226	2048/4/15
ANHEUSER-BUSCH	5.55	230	220	32,127	2049/1/23
AT&T INC	4.5	335	265	38,769	2048/3/9
AT&T INC	3.5	110	73	10,752	2053/9/15
BANK OF AMERICA CORP FRN	1.734	120	103	15,046	2027/7/22
BANK OF AMERICA CORP FRN	3.419	440	391	57,015	2028/12/20
BANK OF AMERICA CORP FRN	4.571	210	187	27,401	2033/4/27
BAUSCH HEALTH COS INC	6.25	50	19	2,862	2029/2/15
BAUSCH HEALTH COS INC	7.25	20	7	1,143	2029/5/30
BNP PARIBAS FRN	5.198	280	259	37,765	2030/1/10
BOEING CO	5.15	170	157	22,936	2030/5/1
BOEING CO	3.3	150	104	15,290	2035/3/1
BOEING CO	5.805	390	338	49,400	2050/5/1
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2.9	20	19	2,831	2024/7/26
BROADCOM INC-144A 351115	3.137	70	49	7,172	2035/11/15
COO HDLGS LLC/CAP CORP	4.5	210	169	24,719	2030/8/15
COO HDLGS LLC/CAP CORP	4.5	260	200	29,243	2032/5/1
COO HDLGS LLC/CAP CORP	4.5	200	149	21,861	2033/6/1
COO HDLGS LLC/CAP CORP	4.25	250	182	26,663	2034/1/15

銘 柄	利 率 (%)	期 末			
		額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.908	130	126	18,489	2025/7/23
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.2	170	152	22,264	2028/3/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	3.5	20	12	1,876	2041/6/1
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.25	210	161	23,544	2053/4/1
CHENERIE ENERGY INC	4.625	40	36	5,380	2028/10/15
CIGNA CORP	4.375	160	151	22,028	2028/10/15
CIGNA CORP	4.8	190	168	24,618	2038/8/15
CIGNA CORP	4.9	150	131	19,220	2048/12/15
CITIGROUP INC	8.125	320	378	55,139	2039/7/15
CITIGROUP INC	4.65	250	205	29,907	2045/7/30
COCA-COLA CO	2.5	20	14	2,058	2040/6/1
COCA-COLA CO	2.6	10	6	950	2050/6/1
COMCAST CORP	4.15	500	472	68,906	2028/10/15
COMCAST CORP	4.0	110	85	12,461	2048/3/1
COMCAST CORP	2.987	50	29	4,261	2063/11/1
CSC HOLDINGS LLC	4.125	890	683	99,585	2030/12/1
CVS HEALTH CORP	4.3	116	109	15,983	2028/3/25
CVS HEALTH CORP	3.75	160	142	20,744	2030/4/1
CVS HEALTH CORP	5.05	400	350	51,024	2048/3/25
DANSKE BANK A/S	5.375	200	198	28,930	2024/1/12
DELTA AIR LINES	7.0	610	615	89,696	2025/5/1
DEVON ENERGY CORPORATION	8.25	60	61	8,903	2023/8/1
DEVON ENERGY CORPORATION	5.85	500	504	73,508	2025/12/15
DEVON ENERGY CORPORATION	5.6	70	64	9,393	2041/7/15
DIAMONDBACK ENERGY INC	3.5	70	60	8,851	2029/12/1
DISH NETWORK CORP	2.375	340	306	44,735	2024/3/15
ECOPETROL SA	4.125	930	863	125,858	2025/1/16
ENERGY TRANSFER LP	5.95	130	113	16,500	2043/10/1
ENERGY TRANSFER OPERATING	3.75	330	280	40,874	2030/5/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	5.1	340	293	42,829	2045/2/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	3.7	30	21	3,092	2051/1/31
FORD MOTOR COMPANY	3.25	240	175	25,606	2032/2/12
FREEPORT-MCMORAN INC	4.625	70	61	9,029	2030/8/1
FREEPORT-MCMORAN INC	5.45	50	41	6,077	2043/3/15
GALAXY PIPELINE ASSETS	2.25	680	524	76,404	2036/3/31
GENERAL MOTORS	6.6	60	56	8,289	2036/4/1
GENERAL MOTORS	6.75	60	55	8,032	2046/4/1
GLENORE FUNDING LLC	4.0	470	435	63,523	2027/3/27
GOLDMAN SACHS GROUP	3.5	340	313	45,752	2026/11/16
GOLDMAN SACHS GROUP	6.75	320	321	46,849	2037/10/1
GOLDMAN SACHS GROUP FRN	2.615	80	62	9,059	2032/4/22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.5	70	66	9,742	2025/4/1
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.15	290	243	35,475	2045/5/22
GSK CONSUMER HEALTHCARE	3.625	260	221	32,313	2032/3/24
HCA INC	5.375	10	9	1,441	2025/2/1
HCA INC	5.25	390	379	55,298	2026/6/15
HCA INC	5.625	10	9	1,397	2028/9/1
HCA INC	5.875	70	68	9,963	2029/2/1
HCA INC	3.5	100	82	12,092	2030/9/1
HOME DEPOT INC	2.7	70	60	8,768	2030/4/15
HOME DEPOT INC	3.625	140	106	15,470	2052/4/15
HSBC HOLDINGS PLC	4.25	640	607	88,485	2025/8/18
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.803	200	192	28,066	2025/3/11
HUMANA INC	2.15	20	15	2,223	2032/2/3
JPMORGAN CHASE & CO	4.25	280	263	38,436	2027/10/1
JPMORGAN CHASE & CO FRN	0.969	150	139	20,269	2025/6/23
JPMORGAN CHASE & CO FRN	4.452	500	459	67,003	2029/12/5
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.25	10	9	1,321	2031/3/1

銘柄	利率 (%)	4 期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.0	30	26	3,792	2042/6/4
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.2	60	52	7,657	2045/7/15
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.875	30	25	3,676	2049/10/1
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.5	40	36	5,305	2050/6/1
MAGALLANES INC	5.141	210	152	22,298	2052/3/15
MAGALLANES INC	5.391	140	101	14,832	2062/3/15
MCDONALD'S CORP	4.2	30	24	3,532	2050/4/1
MORGAN STANLEY	3.95	130	121	17,663	2027/4/23
MORGAN STANLEY FRN	3.622	310	268	39,067	2031/4/1
NGPL PIPECO LLC	4.875	170	158	23,108	2027/8/15
NORTHROP GRUMMAN CORP	5.25	50	47	6,962	2050/5/1
OCCIDENTAL PETROLEUM	3.5	310	285	41,659	2029/8/15
OCCIDENTAL PETROLEUM	6.6	70	71	10,426	2046/3/15
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	300	251	36,685	2046/4/15
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	280	233	34,085	2049/8/15
PETROBRAS GLOBAL FINANCE	6.25	970	979	142,817	2024/3/17
RAYTHEON TECH CORP	2.25	50	40	5,917	2030/7/1
SANDS CHINA LTD	3.35	460	354	51,642	2029/3/8
SCANDINAVISKA ENSKIL FRN	6.875	200	186	27,211	-
SOUTHERN COPPER CORP	5.25	760	671	97,931	2042/11/8
SOUTHWESTERN ENERGY CO	4.75	10	8	1,245	2032/2/1
SPIRIT LOYALTY LT LTD/IP	8.0	47	48	7,007	2025/9/20
SINOCO LOGISTICS PARTNER	5.35	90	72	10,616	2045/5/15
T-MOBILE USA INC	2.25	20	18	2,628	2026/2/15
T-MOBILE USA INC	2.625	50	41	6,045	2029/2/15
T-MOBILE USA INC	2.875	380	306	44,671	2031/2/15
T-MOBILE USA INC	3.5	50	42	6,171	2031/4/15
T-MOBILE USA INC	2.7	220	173	25,309	2032/3/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.5	20	19	2,894	2027/7/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	30	29	4,364	2029/1/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	4.0	10	8	1,202	2032/1/15
TEVA PHARMACEUTICALS NE	2.8	10	9	1,414	2023/7/21
TEVA PHARMACEUTICALS NE	3.15	610	507	73,918	2026/10/1
TEVA PHARMACEUTICALS NE	5.125	200	168	24,569	2029/5/9
TIME WARNER ENT	8.375	260	278	40,537	2033/7/15
UNITED AIRLINES INC	4.625	600	504	73,551	2029/4/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	3.75	30	29	4,258	2025/7/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	3.5	100	78	11,456	2039/8/15
VERIZON COMMUNICATIONS	4.329	590	556	81,190	2028/9/21
VERIZON COMMUNICATIONS	3.4	90	66	9,626	2041/3/22
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	5.5	230	199	29,140	2029/5/15
VISA INC	2.7	120	87	12,687	2040/4/15
VOC ESCROW LTD	5.0	230	189	27,609	2028/2/15
VODAFONE GROUP PLC	4.375	310	292	42,599	2028/5/30
WELLS FARGO & COMPANY FRN	0.805	160	148	21,657	2025/5/19
WELLS FARGO & COMPANY FRN	2.879	390	321	46,884	2030/10/30
WELLS FARGO & COMPANY FRN	5.013	370	323	47,187	2051/4/4
WELLS FARGO & COMPANY	4.3	410	385	56,247	2027/7/22
WELLS FARGO & COMPANY	3.9	20	14	2,176	2045/5/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.3	680	585	85,380	2030/2/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	5.5	240	190	27,771	2050/2/1
WYNN MACAU LTD	5.625	200	144	21,048	2028/8/26
小 計				9,185,607	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CANADIAN GOVT	1.25	990	846	89,588	2030/6/1
地方債証券					
ONTARIO (PROVINCE OF)	3.45	610	528	55,920	2045/6/2
PROVINCE OF QUEBEC	3.5	520	455	48,191	2045/12/1
小 計				193,700	

銘柄	利率 (%)	4 期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(メキシコ)		千メキシカンペソ	千メキシカンペソ		
国債証券					
MEXICAN BONOS DESARR FIX	7.75	67,770	55,772	407,606	2042/11/13
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BUNDES REPUBLIC DE	-	460	382	54,249	2031/2/15
普通社債券 (含む投資法人債券)					
MUNICH RE FRN	3.25	300	260	36,868	2049/5/26
VOLKSWAGEN FIN SERV	1.5	890	853	120,959	2024/10/1
(イタリア)					
国債証券					
BUONI POLIENNALI	3.25	1,110	908	128,766	2046/9/1
普通社債券 (含む投資法人債券)					
INTESA SANPAOLO SPA	1.0	560	533	75,544	2024/7/4
UNICREDIT SPA FRN	4.875	500	485	68,744	2029/2/20
(フランス)					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	-	1,080	872	123,674	2030/11/25
FRANCE O. A. T.	1.5	360	250	35,530	2050/5/25
FRANCE O. A. T.	4.0	90	105	14,901	2060/4/25
普通社債券 (含む投資法人債券)					
BNP PARIBAS FRN	0.5	300	248	35,258	2028/5/30
CREDIT AGRICOLE FRN	1.875	1,200	1,106	156,771	2027/4/22
(オランダ)					
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABN AMRO BANK NV	1.0	660	630	89,330	2025/4/16
ALLIANZ FINANCE II B.V.	1.5	300	259	36,826	2030/1/15
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	4.875	440	458	65,026	2025/4/22
ING GROEP NV FRN	2.5	500	480	68,126	2029/2/15
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2.0	100	85	12,046	2030/3/30
VOLKSWAGEN FIN SERV	3.75	300	292	41,483	2027/9/28
(スペイン)					
国債証券					
SPAIN GOVT	5.15	540	654	92,773	2044/10/31
SPANISH GOVT 2.7 10/31/4	2.7	1,470	1,210	171,576	2048/10/31
普通社債券 (含む投資法人債券)					
BANCO SANTANDER SA	3.25	500	470	66,699	2026/4/4
(ベルギー)					
国債証券					
BELGIUM GOVT	3.75	710	758	107,534	2045/6/22
(ルクセンブルク)					
普通社債券 (含む投資法人債券)					
HOLCIM FINANCE LUX SA	1.75	530	443	62,870	2029/8/29
(その他)					
国債証券					
REPUBLIC OF INDONESIA	1.4	400	295	41,913	2031/10/30
UNITED MEXICAN STATES	2.875	590	402	57,100	2039/4/8
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABBVIE INC	1.5	100	98	14,004	2023/11/15
ANGLO AMERICAN CAPITAL	1.625	500	468	66,372	2025/9/18
BANK OF AMERICA CORP FRN	1.776	660	605	85,811	2027/5/4
BARCLAYS PLC FRN	2.0	1,140	1,121	159,008	2028/2/7
CREDIT SUISSE GROUP FRN	3.25	460	418	59,319	2026/4/2
CREDIT SUISSE GROUP FRN	2.125	600	522	74,012	2026/10/13
CREDIT SUISSE GROUP FRN	1.0	140	113	16,072	2027/6/24
DANSKE BANK A/S FRN	1.375	790	707	100,224	2030/2/12

第 4 期 末		評 価 額			
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外貨建金額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
GENERAL ELECTRIC CO	4.125	610	572	81,083	2035/9/19
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.019	320	300	42,538	2027/6/15
LLoyds BANKING GROUP FRN	3.5	840	822	116,561	2026/4/1
MCDONALD'S CORP	1.875	900	837	118,748	2027/5/26
NETFLIX INC	3.625	550	474	67,273	2030/6/15
ROYAL BK SCOTLAND	2.5	530	530	75,148	2023/3/22
STANDARD CHARTERED P FRN	2.5	780	706	100,137	2030/9/9
SVENSKA HANDELSBANKEN FRN	1.25	680	673	95,433	2028/3/2
TORONTO-DOMINION BANK	2.551	1,020	943	133,729	2027/8/3
UBS GROUP AG FRN	2.75	390	367	52,070	2027/6/15
UBS GROUP FUNDING	1.5	1,040	1,009	143,012	2024/11/30
ユ ー ロ 計				3,365,142	
(イギリス)		千ポンド	千ポンド		
国債証券					
UK TREASURY	4.5	70	69	11,239	2034/9/7
UK TREASURY	4.75	690	681	110,152	2038/12/7
UK TREASURY	3.25	1,080	845	136,674	2044/1/22
UK TREASURY	2.5	280	178	28,784	2065/7/22
UK TREASURY INFL	0.125	210	201	32,491	2068/3/22
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AVIVA PLC FRN	6.125	220	202	32,695	2036/11/14
BNP PARIBAS FRN	2.0	500	398	64,428	2031/5/24
ENEL FINANCE INTL NV	2.875	370	279	45,115	2029/4/11
HSBC HOLDINGS PLC FRN	2.256	370	317	51,388	2026/11/13
ROYAL BANK OF CANADA	3.625	710	618	100,024	2027/6/14
SCOTTISH WIDOWS LTD	5.5	380	377	60,961	2023/6/16
小 計				673,958	
(ノルウェー)		千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ		
国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	6,360	5,443	74,468	2030/8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.125	5,960	5,290	72,372	2032/5/18
小 計				146,840	
(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					
POLAND GOVT	1.75	10,800	6,686	195,009	2032/4/25
(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					
AUSTRALIAN GOVT	1.75	130	77	7,095	2051/6/21
(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					
INDONESIA GOVERNMENT	8.375	17,273,000	18,494,562	175,698	2039/4/15
(中国)		千元	千元		
国債証券					
CHINA GOVERNMENT BOND	3.8	3,000	3,030	61,702	2023/7/9
CHINA GOVERNMENT BOND	3.38	1,000	1,024	20,870	2026/7/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.85	1,000	1,044	21,269	2026/12/12
CHINA GOVERNMENT BOND	4.29	4,500	4,885	99,473	2029/5/22
CHINA GOVERNMENT BOND	3.6	1,000	1,048	21,355	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	4.0	13,500	14,743	300,192	2035/11/30
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.4	14,000	14,163	288,392	2024/11/6
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.8	1,390	1,429	29,102	2030/10/27
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.4	6,000	6,147	125,175	2024/5/14
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.15	3,000	3,140	63,936	2027/6/18
小 計				1,031,469	

第 4 期 末		評 価 額			
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外貨建金額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(南アフリカ)		千ランド	千ランド		
国債証券					
SOUTH AFRICA GOVT	6.5	55,587	34,077	275,004	2041/2/28
合 計				15,657,133	

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

(注2) 償還年月日が「-」の銘柄は、償還期限の定めがありません。

< 売付債券 >

第 4 期 末		評 価 額			
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外貨建金額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
国債証券					
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	100	97	14,226	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.0	100	87	12,777	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	2.5	200	170	24,887	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.5	100	90	13,161	2051/10/1
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	159	23,284	2051/11/1
合 計				88,337	

(注) 邦貨換算金額は、当該日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。

<外国投資信託証券>

銘柄	第 3 期 末		第 4 期 末	
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千ドル	
WA CHINA BOND FUND L. L. C.	463,159	547,626	5,877	856,789
合 計	口 数 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	463,159 1	5,877 —	856,789 < 4.8% >

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄	別	第 4 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外	CA 10YR 1212	128	—
	US 5YR 0212	1,744	—
	UK 10YR 0212	850	—
	BTP10YR 1212	141	—
	OAT10YR 2212	442	—
	EB 5YR 0212	774	—
	EB 10YR 0212	173	—
	US 2YR 0212	1,643	—
	US 10YR 0212	—	2,896
	EB 30YR 2212	—	119
	US 20YR 0212	199	—
	USUL10YR2212	—	341
	US UL 1212	523	—
	AU 10YR 1212	161	—
国	CAN 5YR 2212	164	—
	AU 3YR 1212	1,032	—
	90DYEUR 1202	2,842	—
	90DYEUR 1203	2,709	—
	ICE3SONI2212	2,654	—

(注) 外貨建資産は、当該日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。

<オプションの銘柄別期末残高>

銘柄	別	コールプット別	第 4 期 末	
			買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	債券	RXZ2 C 1125	3	—
		RXZ2 P 1125	—	10
	金利	ERZ2 C 1219	0.067317	—
		ERZ2 P 1219	—	34

(注) 外貨建資産は、当該日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。

<スワップ及び先渡取引残高>

種 類	第 4 期 末	
	取 引 契 約 残 高 (想 定 元 本 額)	
直物為替先渡取引	百万円 3,463	

組入投資信託証券の内容

■フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	フィデリティ投信株式会社
運 用 方 針	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
主 要 運 用 対 象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

●損益の状況

項 目	第 1 期 自 2021年7月16日 至 2022年5月 2日
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	275,296,885円
売 買 益	280,820,694
売 買 損	△5,523,809
(B)信 託 報 酬 等	△40,872,198
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	234,424,687
(D)追 加 信 託 差 損 益 金	191,655,388
(売 買 損 益 相 当 額)	(191,655,388)
(E)合 計 (C+D)	426,080,075
次 期 繰 越 損 益 金 (E)	426,080,075
追 加 信 託 差 損 益 金	191,655,388
(配 当 等 相 当 額)	(13,406,456)
(売 買 損 益 相 当 額)	(178,248,932)
分 配 準 備 積 立 金	234,424,687

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	
	口 数	評 価 額
フィデリティ・外国債券・マザーファンド	千口 5,647,663	千円 15,803,292

下記は、フィデリティ・外国債券・マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	利率 (%)	期末				償還年月日
		額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)		千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
国債証券						
USTN 0.25% 04/15/23	0.2500	4,270	4,194	545,760	2023/04/15	
USTN .75% 11/15/24	0.7500	4,790	4,542	591,041	2024/11/15	
USTN .5% 03/31/25	0.5000	1,410	1,316	171,288	2025/03/31	
USTN 1.125% 10/31/26	1.1250	48,125	44,421	5,779,211	2026/10/31	
USTN 1.5% 01/31/27	1.5000	11,110	10,398	1,352,861	2027/01/31	
USTN 2.5% 03/31/27	2.5000	230	225	29,322	2027/03/31	
USTN 2.375% 03/31/29	2.3750	23,150	22,317	2,903,570	2029/03/31	
USTN 1.875% 02/15/32	1.8750	24,080	21,965	2,857,684	2032/02/15	
USTB 1.875% 11/15/51	1.8750	15,845	12,428	1,616,927	2051/11/15	
特殊債券						
EQUINOR ASA 3.125% 4/06/30	3.1250	925	877	114,170	2030/04/06	
UMBS 15TR 2.5% 05/37 #TRA	2.5000	1,000	957	124,518	2037/05/01	
UMBS 30TR 3% 05/52 #TRA	3.0000	6,050	5,703	742,027	2052/05/01	
GNV II 3% 05/52 #TRA	3.0000	10,075	9,602	1,249,335	2052/05/01	
UMBS 30TR 2.5% 05/52 #TRA	2.5000	8,375	7,640	994,074	2052/05/01	
GNV II 3.5% 05/52 #TRA	3.5000	3,500	3,423	445,414	2052/05/01	
UMBS 30TR 2% 05/52 #TRA	2.0000	5,050	4,453	579,379	2052/05/01	
GNV II 2.5% 05/52 #TRA	2.5000	3,150	2,923	380,345	2052/05/01	
社債券						
TOLL BROS FIN CORP 4.375% 4/23	4.3750	750	754	98,164	2023/04/15	
TAKE-TWO INTERA 3.3% 03/28/24	3.3000	750	745	96,982	2024/03/28	
DAILME FBN SOFR+100 04/24/14A	1.3000	1,638	1,638	213,144	2024/04/05	
LENNAR CORP 5.875% 11/15/2024	5.8750	1,172	1,216	158,289	2024/11/15	
CONOCOPHILLIP 2.4% 03/07/25	2.4000	860	836	108,875	2025/03/07	
MAGALLANE 3.638% 03/15/25 144A	3.6380	973	956	124,503	2025/03/15	
GSX CONSUM 3.125% 3/24/25 144A	3.1250	1,625	1,593	207,268	2025/03/24	
AIB GR 4.263%VAR 4/10/25 144A	4.2630	4,125	4,087	531,725	2025/04/10	
SWEDBANK 3.356% 04/04/25 144A	3.3560	1,363	1,352	175,964	2025/04/04	
CORBRIDGE F 3.5% 4/4/25 144A	3.5000	772	764	99,418	2025/04/04	
JPMORGAN CHASE 0.824VAR 6/25	0.8240	2,350	2,210	287,650	2025/06/01	
GENERAL MTRS 6.125% 10/01/25	6.1250	200	211	27,466	2025/10/01	
SOOEN 2.226VAR 01/21/26 144A	2.2260	4,535	4,234	550,957	2026/01/21	
ING GROEP NV 3.869VAR 3/28/26	3.8690	1,620	1,601	208,346	2026/03/28	
JPMORGAN CHA 4.08%VAR 4/26/26	4.0800	1,525	1,521	197,898	2026/04/26	
LENNAR CORP 5.25% 06/01/2026	5.2500	100	103	13,433	2026/06/01	
AIR LEASE CORP 1.875% 08/15/26	1.8750	2,868	2,557	332,754	2026/08/15	
AERCAP IRELAND 2.45% 10/29/26	2.4500	2,025	1,800	234,288	2026/10/29	
EQUINIX INC 2.9% 11/18/26	2.9000	2,535	2,386	310,437	2026/11/18	
NEXTERA ENER C 1.875% 01/15/27	1.8750	1,308	1,195	155,471	2027/01/15	
HCA INC 3.125% 03/15/27 144A	3.1250	209	196	25,571	2027/03/15	
MAGALLANE 3.755% 03/15/27 144A	3.7550	231	223	29,065	2027/03/15	
BDA CORP 3.569VAR 4/23/27	3.5690	575	557	72,579	2027/04/23	
CORBRIDGE F 3.65% 4/5/27 144A	3.6500	515	499	65,002	2027/04/05	
TAKE-TWO INTERA 3.7% 04/14/27	3.7000	987	966	125,763	2027/04/14	
BANK IRE 2.029VAR 9/27 144A	2.0290	2,350	2,070	269,435	2027/09/30	

銘柄	利率 (%)	期末				償還年月日
		額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
DBSW SOFR+121.9 11/16/27	1.2690	2,050	1,980	257,706	2027/11/16	
DEUTSCHE B 2.311%VAR 11/16/27	2.3110	2,185	1,932	251,364	2027/11/16	
SOCIETE GE 2.797%/VAR 1/19/28 144A	2.7970	2,130	1,919	249,670	2028/01/19	
NATIONWIDE B FBN 2/16/28 144A	1.3400	3,925	3,832	498,637	2028/02/16	
JPMORGAN FBN SOFR+118 2/24/28	1.2300	2,650	2,607	339,214	2028/02/24	
BANCO SANTAND 4.175%VAR 03/28	4.1750	600	582	75,729	2028/03/24	
WELLSFARGO 3.526%VAR 03/24/28	3.5260	1,075	1,031	134,243	2028/03/24	
ING GROEP 4.017%VAR 3/28/28	4.0170	901	872	113,552	2028/03/28	
JPMORGAN CHASE 2.069VAR 6/29	2.0690	1,400	1,225	159,374	2029/06/01	
PROSUS NV 3.68% 01/21/2030 BGS	3.6800	525	443	57,654	2030/01/21	
NEXTERA ENER CA 2.25% 06/01/30	2.2500	3,000	2,562	333,402	2030/06/01	
MSCI INC 3.625% 09/01/30 144A	3.6250	2,530	2,231	290,280	2030/09/01	
CENTENE CORP 3% 10/15/30	3.0000	2,500	2,175	282,967	2030/10/15	
AIR LEASE CORP 3.125% 12/01/30	3.1250	350	302	39,326	2030/12/01	
MSCI INC 3.875% 02/15/31 144A	3.8750	450	406	52,836	2031/02/15	
CENTENE CORP 2.5% 03/01/31	2.5000	230	191	24,873	2031/03/01	
PROSUS NV 3.061% 07/13/31 BGS	3.0610	1,800	1,407	183,126	2031/07/13	
MSCI INC 3.625% 11/01/31 144A	3.6250	554	483	62,912	2031/11/01	
AON CORP / AON 2.6% 12/02/31	2.6000	650	562	73,139	2031/12/02	
AERCAP IRELAND 3.3% 01/30/32	3.3000	1,800	1,497	194,844	2032/01/30	
NEXTERA ENER CA 2.44% 01/15/32	2.4400	1,725	1,464	190,501	2032/01/15	
DICKS SPORTING 3.15% 01/15/32	3.1500	850	709	92,339	2032/01/15	
PROSUS NV 4.193% 01/19/32 BGS	4.1930	1,525	1,286	167,384	2032/01/19	
BDA CORP 2.651%VAR 03/11/32	2.6510	790	676	88,004	2032/03/11	
HCA INC 3.625% 03/15/32 144A	3.6250	580	519	67,625	2032/03/15	
HP INC 4.2% 04/15/32	4.2000	1,841	1,688	219,679	2032/04/15	
BROADCOM 4.15% 4/15/32 144A	4.1500	1,403	1,302	169,428	2032/04/15	
CORBRIDGE FI 3.9% 4/5/32 144A	3.9000	467	438	57,021	2032/04/05	
WELLTOWER INC 3.85% 06/15/32	3.8500	1,012	963	125,292	2032/06/15	
HSBC HOL 2.871%VAR 11/22/32	2.8710	2,437	2,029	263,991	2032/11/22	
SOOEN 3.337VAR 1/21/33 144A	3.3370	2,150	1,820	236,845	2033/01/21	
TARGA RESO CORP 4.2% 02/01/33	4.2000	496	470	61,158	2033/02/01	
HSBC HLD PLC 4.762VAR 3/29/33	4.7620	752	711	92,595	2033/03/29	
MSCI INC 3.25% 08/15/33 144A	3.2500	515	435	56,616	2033/08/15	
BROADCOM 3.187% 11/15/36 BGS	3.1870	450	352	45,885	2036/11/15	
BROADCOM 3.187% 11/15/36 144A	3.1870	700	552	71,901	2036/11/15	
ARCELORMITTA 7% 10/15/39	7.0000	1,797	1,975	256,969	2039/10/15	
GS GRP INC MTN 6.25% 2/01/41	6.2500	150	175	22,991	2041/02/01	
ORACLE CORP 3.65% 03/25/41	3.6500	900	697	90,682	2041/03/25	
AERCAP LTD/TR 3.85% 10/29/41	3.8500	1,000	772	100,546	2041/10/29	
CITIGROUP INC 5.875% 1/30/42	5.8750	200	223	29,075	2042/01/30	
HCA INC 4.375% 03/15/42 144A	4.3750	170	147	19,224	2042/03/15	
MAGALLANES 5.05% 03/15/42 144A	5.0500	973	886	115,323	2042/03/15	
BARCLAYSPLC 3.33% 11/24/42	3.3300	1,184	923	120,190	2042/11/24	
ENERGY TRANSFER 6% 04/15/48	6.0000	800	783	101,875	2048/06/15	
ABBVIE INC 4.875% 11/14/2048	4.8750	2,390	2,393	311,452	2048/11/14	
ENERGY TRAN OP 6.25% 04/15/49	6.2500	650	655	85,338	2049/04/15	

銘柄	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 (千円)	
WILLIS NORTH AM 3.875% 9/15/49	3.8750	4,300	3,574	465,059	2049/09/15
DICKS SPORTING 4.1% 01/15/52	4.1000	600	438	57,081	2052/01/15
AM CORP / AMN 3.9% 02/28/52	3.9000	946	815	106,114	2052/02/28
GSK CONSUMER 4% 3/24/52 144A	4.0000	250	224	29,197	2052/03/24
CORRIDOR F 4.4% 4/5/52 144A	4.4000	667	594	77,383	2052/04/05
CSL FINANCE 4.75% 4/27/52 144A	4.7500	519	510	66,419	2052/04/27
VALERO ENERGY 4% 06/01/52	4.0000	765	635	82,719	2052/06/01
UPAC 3.5% 02/14/53	3.5000	870	736	95,826	2053/02/14
COO LLC/CAPITL 6.834% 10/23/5	6.8340	1,382	1,451	188,861	2055/10/23
AMERISER BUSCH INBEV WORLD IDC	5.8000	1,565	1,705	221,927	2059/01/23
MAGALLANE 5.391% 03/15/02 144A	5.3910	960	852	110,867	2062/03/15
小 計	—	281,132	258,519	33,633,450	—
(カナダ)		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
国債証券					
CANADA GOVT .25% 04/01/24	0.2500	9,615	9,189	929,758	2024/04/01
CANADA GOVT 2.25% 6/1/25	2.2500	5,825	5,745	581,316	2025/06/01
CANADA GOVT .5% 12/01/30	0.5000	12,140	9,983	1,010,150	2030/12/01
CANADA GOVT 1.5% 12/01/31	1.5000	3,125	2,773	280,581	2031/12/01
CANADA GOVT 2% 12/01/51	2.0000	1,400	1,177	119,183	2051/12/01
小 計	—	32,105	28,869	2,920,989	—
(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					
AUSTRALIA GOVT 1.25% 05/21/32	1.2500	4,575	3,830	352,065	2032/05/21
AUSTRALIA GOVT 3% 3/21/47 BGS	3.0000	2,640	2,426	222,971	2047/03/21
AUSTRALIA GOVT 1.75% 06/51 BGS	1.7500	4,087	2,799	257,301	2051/06/21
社債券					
BARCLAYS 2.064%VAR 5/27 BGS	2.0640	1,750	1,566	143,993	2027/05/20
BARCLAY 3.382%VAR 5/20/32 BGS	3.3820	1,250	1,018	93,556	2032/05/20
小 計	—	14,302	11,641	1,069,888	—
(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					
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/24	0.5000	11,440	10,812	908,900	2024/05/15
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/26	0.5000	8,750	7,757	652,079	2026/05/15
NEW ZEALAND GOV .25% 05/15/28	0.2500	2,525	2,069	173,982	2028/05/15
小 計	—	22,715	20,639	1,734,962	—
(イギリス)		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
国債証券					
UK GILT .125% 01/30/26 BGS	0.1250	1,270	1,200	196,445	2026/01/30
UK GILT .375% 10/22/30 REGS	0.3750	7,340	6,519	1,066,721	2030/10/22
UK GILT .875% 07/31/33 REGS	0.8750	2,482	2,207	361,240	2033/07/31
UK GILT 1.5% 07/22/47 REGS	1.5000	700	621	101,734	2047/07/22
UK GILT .625% 10/22/50 REGS	0.6250	2,565	1,797	294,059	2050/10/22
UK GILT 1.25% 07/31/51 REGS	1.2500	1,425	1,178	192,880	2051/07/31
社債券					
HSC HLD PL 1.75%VAR 07/24/27	1.7500	1,628	1,504	246,217	2027/07/24
NATVE 2.057%VAR 11/09/28 BGS	2.0570	1,200	1,098	179,804	2028/11/09
AT&T INC 4.375% 9/14/29	4.3750	1,250	1,318	215,652	2029/09/14
TIME WARNER CAB 5.75% 6/02/31	5.7500	1,935	2,115	346,179	2031/06/02
DIRECT LINE IN 4% 06/05/32 BGS	4.0000	3,200	2,996	490,201	2032/06/05
小 計	—	24,995	22,560	3,691,138	—

銘柄	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 (千円)	
(ノルウェー)		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券					
NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2	2.0000	54,700	52,588	728,877	2028/04/26
NORWAY GOVERNMENT 1.25% 9/17/3	1.2500	42,925	37,585	520,929	2031/09/17
小 計	—	97,625	90,173	1,249,807	—
(スウェーデン)		千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券					
SWEDEN GOVT 1.375% 06/23/71 BE	1.3750	7,415	4,789	63,410	2071/06/23
小 計	—	7,415	4,789	63,410	—
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券					
MEXICO UNITED 5.75% 03/05/26	5.7500	86,850	77,554	493,734	2026/03/05
MEXICO GOVT 7.5% 6/3/27 M20	7.5000	12,500	11,720	74,617	2027/06/03
MEXICO GOVT 7.75% 5/29/31	7.7500	43,950	40,268	256,362	2031/05/29
小 計	—	143,300	129,543	824,714	—
(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					
INDONESIA GOVT 7% 5/15/22	7.0000	825,000	825,412	7,428	償還/05/15
INDONESIA GOVT 7% 5/15/27	7.0000	28,776,000	29,375,979	264,383	2027/05/15
小 計	—	29,601,000	30,201,392	271,812	—
(チェコ)		千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
国債証券					
CZECH REPUBLIC .25% 02/10/27	0.2500	55,280	44,982	250,532	2027/02/10
小 計	—	55,280	44,982	250,532	—
(韓国)		千韓国・ウォン	千韓国・ウォン		
国債証券					
KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10	2.6250	2,320,200	2,246,255	231,139	2028/06/10
KOREA GOVT 1.5% 12/10/30	1.5000	15,016,960	13,026,912	1,340,469	2030/12/10
小 計	—	17,337,160	15,273,167	1,571,608	—
(中国)		千オフジョア・人民元	千オフジョア・人民元		
国債証券					
CHINA GOVT 2.75% 08/08/22	2.7500	11,390	11,415	222,638	2022/08/08
CHINA PEOPLE RE OF 2.94% 10/24	2.9400	20,500	20,764	404,964	2024/10/17
CHINA GOVT 1.99% 04/09/25	1.9900	41,070	40,513	790,118	2025/04/09
CHINA GOVT 2.68% 05/21/30	2.6800	36,050	35,458	691,545	2030/05/21
CHINA GOVT 3.27% 11/19/30	3.2700	55,000	56,730	1,106,410	2030/11/19
CHINA GOVT 3.02% 05/27/31	3.0200	30,000	30,284	590,636	2031/05/27
CHINA GOVT 2.89% 11/18/31	2.8900	50,140	50,243	979,894	2031/11/18
特殊債券					
CHINA DEV BANK 3.09% 06/18/30	3.0900	43,450	43,284	844,176	2030/06/18
小 計	—	287,600	288,696	5,630,386	—
(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					
POLAND GOVT .25% 10/25/26	0.2500	6,675	5,029	147,342	2026/10/25
POLAND GOVT 1.25% 10/25/30	1.2500	16,950	11,429	334,823	2030/10/25
小 計	—	23,625	16,458	482,166	—

銘柄	第 1 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 (千円)	
(アイルランド)					
社債券					
AIB GROUP 2.25%/VAR 04/28 BGS	2.2500	1,097	1,069	146,506	2028/04/04
AIB GR 2.875%/VAR 05/30/31 BGS	2.8750	765	731	100,236	2031/05/30
BANKIR 1.375%/VAR 08/11/31 BGS	1.3750	1,818	1,639	224,700	2031/08/11
LIENDE PLC 1.625%/03/31/35 BGS	1.6250	1,200	1,107	151,760	2035/03/31
(オランダ)					
社債券					
ING G 0.125%/VAR 11/29/25 BGS	0.1250	1,300	1,243	170,370	2025/11/29
ING GBO 1.25%/VAR 02/27 BGS	1.2500	1,800	1,731	237,209	2027/02/16
RABO 3.75% 12/27 RGS	0.3750	2,900	2,682	367,623	2027/12/01
DIGITAL DUT 1.25% 02/01/31 BGS	1.2500	2,450	2,029	278,035	2031/02/01
STELLANTIS 1.25% 06/20/33 BGS	1.2500	2,520	1,989	272,565	2033/06/20
PROSIS NV 1.985% 07/13/33 BGS	1.9850	1,475	1,118	153,213	2033/07/13
WOLSKA 4.375%/VAR PERP BGS	4.3750	1,900	1,745	239,185	2049/12/31
VWIF 3.748%/VAR PERP RGS	3.7480	900	839	114,995	2049/12/31
RABORANK NEDERLAND 4.875% PERP RGS	4.8750	1,200	1,125	154,167	2049/12/31
(フランス)					
社債券					
BNPFA 0.875%/VAR 07/11/30 BGS	0.8750	2,700	2,367	324,386	2030/07/11
BPCE 1% 01/14/32 RGS	1.0000	2,900	2,443	334,782	2032/01/14
TOTALENERG 3.25%/VAR PERP BGS	3.2500	3,317	2,743	375,867	2049/12/31
(ドイツ)					
国債証券					
GERMANY FED REPUBLIC 0.5% 2/25	0.5000	2,665	2,670	365,848	2025/02/15
GERMANY GOVT 0% 04/10/26 REGS	0.0000	3,230	3,157	432,594	2026/04/10
GERMANY GOVT 0% 02/15/32 REGS	0.0000	38,620	35,240	4,828,634	2032/02/15
GERMANY GOVT 0% 08/15/52 REGS	0.0000	9,020	6,496	890,109	2052/08/15
社債券					
VONVIA SE 1.875% 6/28/28 BGS	1.8750	1,000	959	131,447	2028/06/28
VONVIA SE 2.375% 3/25/32 BGS	2.3750	600	568	77,904	2032/03/25
DEUTSCHE 4.0%/VAR 06/32 BGS	4.0000	800	764	104,685	2032/06/24
BAYER AG 4.5%/VAR 3/25/32 BGS	4.5000	1,100	1,082	148,355	2032/03/25
BAYER AG 5.375%/VAR 3/32 BGS	5.3750	700	698	95,726	2032/03/25
(スペイン)					
新株予約権付社債					
CELLNEX COV .75% 11/20/31 BGS	0.7500	600	503	68,989	2031/11/20
社債券					
CELLNEX FINANCE 1.25% 01/15/29	1.2500	2,500	2,084	285,580	2029/01/15
CELLNEX FINANCE 2% 02/15/33 RE	2.0000	3,800	2,983	408,730	2033/02/15
(イタリア)					
社債券					
TERNA 2.375%/VAR PERP RGS	2.3750	1,105	1,012	138,796	2049/12/31
(その他)					
社債券					
CREDIT SUISSE 2.125% 10/13/26 RGS	2.1250	1,854	1,802	246,950	2026/10/13
MSTDF 0.406%/VAR 10/29/27	0.4060	850	781	107,042	2027/10/29
BARCLAYS PLC 0.875% 01/28/28 BGS	0.8770	1,200	1,099	150,702	2028/01/28

銘柄	第 1 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 (千円)	
JPMC CO 1.965% 03/23/30 REGS	1.9630	2,920	2,831	388,015	2030/03/23
NETFLIX LN 3.625% 06/15/30 BGS	3.6250	3,335	3,268	447,836	2030/06/15
CREDIT 2.875%/VAR 04/02/32 BGS	2.8750	1,519	1,420	194,585	2032/04/02
BAA CORP 2.824%/VAR 4/27/33 BGS	2.8240	765	761	104,279	2033/04/27
BERKSHIRE HAT 2% 03/18/34	2.0000	846	791	108,509	2034/03/18
ユ ー ロ 計	-	109,271	97,583	13,370,931	-
合 計	-	-	-	66,765,801	-

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	第 1 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 LONG GILT FUT	387	-

(注)邦貨換算金額は、当該日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。

<スワップ及び先渡取引残高>

種 類	第 1 期 末	
	取 引 契 約 残 高 (想 定 元 本 額)	
	買 建 (百万円)	売 建 (百万円)
直物為替先渡取引(NDF)	209	-

組入投資信託証券の内容

■PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class

●ファンドの概要

投資顧問会社	Pacific Investment Management Company LLC
運用方針	トータル・リターンの最大化を目指して運用を行います。
主要運用対象	<p>主として日本を除く世界の債券等*に投資します。</p> <p>*投資可能な債券は、以下のものを含みます。</p> <ul style="list-style-type: none">・各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券・社債・政府および企業が発行したインフレ連動債・仕組債・ローンおよびローン・パーティシペーション・譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形・現先取引および逆現先取引・国際機関の債券 など
組入制限	<p>債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以上とします。</p> <p>投資する公社債は原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付けを取得しているものに限り、投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてAA-格相当以上に維持します。</p> <p>平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。</p> <p>同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の5%以内とします(国債や政府機関債等を除きます。)</p>

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「PIMCO BERMUDA TRUST IV Annual Report June 30, 2022」の情報を基に掲載しています。

PIMCO Global Bond Strategy Fund

● 損益の状況 (2022年6月30日までの会計期間)

(Amounts in thousands)

	PIMCO Global Bond Strategy Fund	PIMCO Global High Yield Strategy Fund	PIMCO U.S. High Yield Strategy Fund A	PIMCO U.S. High Yield Strategy Fund B
Investment Income:				
Interest, net of foreign taxes*	\$ 1,922	\$ 2,361	\$ 2	\$ 15
Total Income	1,922	2,361	2	15
Expenses:				
Advisory fees - S (JPY)	331 ⁽¹⁾	0	0	0
Management fees - C (JPY Hedged)	19 ⁽²⁾	0	0	0
Interest expense	3	26	0	1
Miscellaneous expense	1	0	0	0
Total Expenses	354	26	0	1
Net Investment Income	1,568	2,335	2	14
Net Realized Gain (Loss):				
Investments in securities, net of foreign taxes*	(2,604)	(14)	0	(1)
Investments in Affiliates	0	0	2,607	3,864
Exchange-traded or centrally cleared financial derivative instruments	(3,128)	54	0	0
Over the counter financial derivative instruments	(1,337)	(1,450)	(3,233)	4,610
Foreign currency	(259)	(206)	1	24
Net Realized Gain (Loss)	(7,328)	(1,616)	(625)	8,497
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation):				
Investments in securities	(17,427)	(10,053)	0	(1)
Investments in Affiliates	0	0	(4,006)	(9,256)
Exchange-traded or centrally cleared financial derivative instruments	(1,974)	174	0	0
Over the counter financial derivative instruments	922	(8)	(508)	(3,788)
Foreign currency assets and liabilities	(125)	(6)	0	0
Net Change in Unrealized (Depreciation)	(18,604)	(9,893)	(4,514)	(13,045)
Net (Loss)	(25,932)	(11,509)	(5,139)	(4,548)
Net (Decrease) in Net Assets Resulting from Operations	\$ (24,364)	\$ (9,174)	\$ (5,137)	\$ (4,534)
* Foreign taxes	\$ 3	\$ 1	\$ 0	\$ 0

A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.

⁽¹⁾ Period from July 26, 2021 (inception date) to June 30, 2022.

⁽²⁾ Period from February 18, 2022 (inception date) to June 30, 2022.

● 投資明細表 (2022年6月30日現在)

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 111.1%		
AUSTRALIA 3.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Santos Finance Ltd.		
3.649% due 04/29/2031	\$ 100	\$ 85
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 2.2%		
AFG Trust		
1.599% due 03/10/2053	AUD 686	466
Bluestone Sapphire XXV		
2.094% due 09/21/2053	439	298
Firstmac Mortgage Funding Trust		
2.329% due 12/10/2044	133	92
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4		
1.831% due 02/19/2053	727	491
La Trobe Financial Capital Markets Trust		
1.743% due 01/14/2053	575	390
Liberty PRIME		
1.800% due 01/25/2053	612	414
Pepper I-Prime Trust		
1.685% due 07/15/2053	476	323
Pepper Residential Securities Trust No.30		
1.785% due 01/15/2063	573	389
Pepper Residential Securities Trust No.31		
1.688% due 04/23/2063	166	114
RedZed Trust		
1.640% due 06/09/2053	357	242
Resimac Premier		
1.623% due 02/13/2053	683	463
Securitized Australian Mortgage Trust		
1.811% due 02/20/2046	58	39
		3,721
SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
Australia Government Bond		
3.250% due 04/21/2029	3,300	2,233
South Australian Government Financing Authority		
1.750% due 05/24/2032	100	55
Treasury Corp. of Victoria		
4.250% due 12/20/2032	100	69
		2,357
Total Australia		6,163
(Cost \$6,955)		
BERMUDA 0.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Bacardi Ltd.		
4.700% due 05/15/2028	\$ 100	99
Total Bermuda		99
(Cost \$98)		
CANADA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Province of Ontario		
7.500% due 02/07/2024	CAD 800	660
Total Canada		660
(Cost \$701)		

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
CAYMAN ISLANDS 2.7%		
ASSET-BACKED SECURITIES 1.9%		
AMMC CLO 20 Ltd.		
1.914% due 04/17/2029	\$ 352	\$ 348
Anchorage Capital CLO 9 Ltd.		
2.184% due 07/15/2032	500	488
Ares XXXIX CLO Ltd.		
2.094% due 04/18/2031	500	488
HERA Commercial Mortgage Ltd.		
2.662% due 02/18/2038	200	197
LoanCore Issuer Ltd.		
2.329% due 01/17/2037	500	486
Mountain View CLO LLC		
2.084% due 01/16/2031	500	490
Nassau Ltd.		
2.194% due 10/15/2029	227	225
Vibrant CLO IV Ltd.		
2.183% due 07/20/2032	500	486
		3,208
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%		
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.		
4.600% due 03/27/2024 (a)	800	803
Sands China Ltd.		
5.125% due 08/08/2025	300	252
5.400% due 08/08/2028	200	154
Tencent Holdings Ltd.		
3.975% due 04/11/2029	200	190
		1,399
Total Cayman Islands		4,607
(Cost \$4,852)		
CHILE 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Chile Government International Bond		
2.450% due 01/31/2031	600	513
2.550% due 01/27/2032	400	341
Total Chile		854
(Cost \$966)		
CHINA 3.9%		
SOVEREIGN ISSUES 3.9%		
China Development Bank		
3.400% due 01/08/2028	CNY 4,300	656
4.040% due 04/10/2027	3,500	549
4.040% due 07/06/2028	10,600	1,673
China Government International Bond		
2.370% due 01/20/2027	2,600	384
2.850% due 06/04/2027	750	113
3.010% due 05/13/2028	9,300	1,408
3.390% due 03/16/2050	900	135
3.530% due 10/18/2051	700	109
3.720% due 04/12/2051	7,900	1,260
3.810% due 09/14/2050	1,500	242
Total China		6,529
(Cost \$6,595)		

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
DENMARK 4.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.1%		
Jyske Realkredit AJS		
1.000% due 10/01/2050	DKK 2,547	\$ 281
1.500% due 10/01/2050	125	14
1.500% due 10/01/2053	298	34
2.000% due 10/01/2050	8	1
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
1.000% due 10/01/2050	2,752	305
1.500% due 10/01/2050	1,265	144
1.500% due 10/01/2053	398	45
2.000% due 10/01/2050	17	2
2.500% due 10/01/2047	5	1
Nykredit Realkredit AJS		
1.000% due 10/01/2050	3,986	429
1.000% due 10/01/2053	98	11
1.500% due 10/01/2050	389	44
1.500% due 10/01/2053	12,536	1,391
2.000% due 10/01/2050	223	28
3.000% due 10/01/2047	3	1
3.000% due 10/01/2053	21,700	2,851
Realkredit Danmark AJS		
1.000% due 10/01/2050	984	108
1.000% due 10/01/2053	198	21
1.500% due 10/01/2053	10,371	1,142
2.500% due 04/01/2036	27	4
2.500% due 04/01/2047	8	1
Total Denmark		6,858
(Cost \$8,541)		
FRANCE 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
BNP Paribas S.A.		
2.871% due 04/19/2032	\$ 700	579
5.198% due 01/10/2030	200	200
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)	200	190
		969
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
France Government Bond		
0.750% due 05/25/2052	EUR 720	478
2.000% due 05/25/2048	864	827
		1,305
Total France		2,274
(Cost \$3,114)		
GERMANY 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Deutsche Bank AG		
1.750% due 11/19/2030	100	86
3.035% due 05/28/2032 (h)	\$ 400	317
3.547% due 09/18/2031	300	251
3.961% due 11/26/2025	200	194
Total Germany		848
(Cost \$1,003)		
HONG KONG 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Lenovo Group Ltd.		
3.421% due 11/02/2030	200	170
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.		
4.150% due 04/18/2023	200	199

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
Total Hong Kong (Cost \$410)	\$	369
INDONESIA 0.1% SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Indonesia Government International Bond		
5.125% due 01/15/2045	\$ 200	192
Total Indonesia (Cost \$251)		192
IRELAND 1.8% ASSET-BACKED SECURITIES 1.7%		
Accunia European CLO I DAC		
0.950% due 07/15/2030	EUR 90	93
Aurium CLO IV DAC		
0.730% due 01/16/2031	300	308
Cairn CLO IV DAC		
0.600% due 04/30/2031	200	206
Carlyle Euro CLO DAC		
0.890% due 08/15/2032	500	507
Contego CLO IV DAC		
0.640% due 01/23/2030	100	103
Harvest CLO XXII DAC		
0.850% due 01/15/2032	200	203
Invesco Euro CLO I DAC		
0.850% due 07/15/2031	200	203
Jubilee CLO XI DAC		
0.610% due 04/15/2030	200	207
OCP Euro CLO DAC		
0.880% due 09/22/2034	500	506
Palmer Square European Loan Funding DAC		
0.780% due 04/15/2031	554	572
		2,908
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
AerCap Ireland Capital DAC		
2.450% due 10/29/2026	\$ 200	174
Total Ireland (Cost \$3,565)		3,082
ISRAEL 0.3% SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Israel Government International Bond		
2.750% due 07/03/2030	300	279
3.375% due 01/15/2050	200	162
Total Israel (Cost \$540)		441
ITALY 0.2% CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
AMCO - Asset Management Co. SpA		
1.500% due 07/17/2023	EUR 100	105
UniCredit SpA		
5.458% due 06/30/2035	\$ 200	162
		267
SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Italy Buoni Poliennali del Tesoro		
2.800% due 03/01/2067	EUR 46	38

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
Total Italy (Cost \$381)	\$	305
JAPAN 1.8% CORPORATE BONDS & NOTES 1.6%		
East Japan Railway Co.		
0.773% due 09/15/2034	EUR 100	79
1.104% due 09/15/2039	100	73
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
2.309% due 07/20/2032	\$ 400	326
3.407% due 03/07/2024	150	149
3.741% due 03/07/2029	200	190
Nippon Life Insurance Co.		
5.000% due 10/18/2042	400	401
Nissan Motor Co. Ltd.		
2.652% due 03/17/2026	EUR 100	98
3.201% due 09/17/2028	100	93
4.345% due 09/17/2027	\$ 300	276
4.810% due 09/17/2030	400	356
Nomura Holdings, Inc.		
2.172% due 07/14/2028	400	337
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
4.436% due 04/02/2024 (a)	300	300
		2,678
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Japan Government International Bond		
0.700% due 06/20/2051	¥ 53,000	343
Total Japan (Cost \$3,545)		3,021
LUXEMBOURG 0.0% CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
3.125% due 11/17/2023	EUR 200	89
Total Luxembourg (Cost \$237)		89
MALAYSIA 0.0% SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Malaysia Government International Bond		
4.736% due 03/15/2046	MYR 200	44
4.893% due 06/08/2038	100	23
Total Malaysia (Cost \$78)		67
MULTINATIONAL 0.2% CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Delta Air Lines, Inc.		
4.750% due 10/20/2028	\$ 300	284
Total Multinational (Cost \$332)		284
NETHERLANDS 0.4% CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
ING Groep NV		
4.550% due 10/02/2028	200	195
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)	200	164
JT International Financial Services BV		
3.875% due 09/28/2028	200	193
		552

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1%		
Dutch Property Finance BV		
0.235% due 07/28/2058	EUR 95	\$ 98
Total Netherlands (Cost \$708)		650
NORWAY 0.0% SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Norway Government Bond		
1.750% due 03/13/2025	NOK 600	59
Total Norway (Cost \$74)		59
PERU 0.2% SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Peru Government International Bond		
5.940% due 02/12/2029	PEN 700	168
6.350% due 08/12/2028	100	25
6.950% due 08/12/2031	400	100
Total Peru (Cost \$407)		293
QATAR 0.3% CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Qatar Energy		
3.125% due 07/12/2041	\$ 300	236
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Qatar Government International Bond		
4.625% due 06/02/2046	200	199
Total Qatar (Cost \$560)		435
ROMANIA 0.0% SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Romania Government International Bond		
3.875% due 10/29/2035	EUR 100	78
Total Romania (Cost \$110)		78
SAUDI ARABIA 0.5% CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Saudi Arabian Oil Co.		
2.250% due 11/24/2030	\$ 400	341
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Saudi Government International Bond		
3.625% due 03/04/2028	300	297
4.500% due 10/26/2046	200	183
		480
Total Saudi Arabia (Cost \$917)		821
SINGAPORE 1.1% CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
BOC Aviation Ltd.		
3.500% due 01/31/2023	200	200
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Singapore Government Bond		
1.625% due 07/01/2031	SGD 900	579
2.875% due 07/01/2029	1,400	1,005
		1,584

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
Total Singapore (Cost \$1,962)	\$	1,784
SOUTH KOREA 1.5% SOVEREIGN ISSUES 1.5%		
Korea Treasury Bond		
1.250% due 03/10/2026	KRW 936,000	665
2.125% due 06/10/2027	1,070,300	770
2.375% due 12/10/2027	270,000	196
2.625% due 06/10/2028	1,220,400	892
5.500% due 12/10/2029	69,400	60
Total South Korea (Cost \$3,073)		2,583
SPAIN 1.1% SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Spain Government Bond		
1.250% due 10/31/2030	EUR 190	184
1.450% due 04/30/2029	780	787
1.450% due 10/31/2071	397	233
3.450% due 07/30/2066	530	577
Total Spain (Cost \$2,438)		1,781
SUPRANATIONAL 0.2% SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
European Investment Bank		
0.500% due 07/21/2023	AUD 300	200
0.500% due 08/10/2023	200	133
Total Supranational (Cost \$423)		333
SWITZERLAND 1.5% CORPORATE BONDS & NOTES 1.5%		
Credit Suisse AG		
6.500% due 08/08/2023 (a)	\$ 1,300	1,303
Credit Suisse Group AG		
4.194% due 04/01/2031	500	443
UBS AG		
7.625% due 08/17/2022 (a)	550	552
UBS Group AG		
2.859% due 08/15/2023	300	300
Total Switzerland (Cost \$2,735)		2,598
THAILAND 0.1% SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Thailand Government Bond		
1.585% due 12/17/2035	THB 11,200	257
Total Thailand (Cost \$310)		257
UNITED ARAB EMIRATES 0.3% CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
DAE Sukuk (DIFC) Ltd.		
3.750% due 02/15/2026	\$ 200	190
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Abu Dhabi Government International Bond		
3.875% due 04/16/2050	400	356

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
Total United Arab Emirates (Cost \$659)	\$	546
UNITED KINGDOM 7.3% CORPORATE BONDS & NOTES 2.3%		
Barclays Bank PLC		
7.625% due 11/21/2022 (a)	\$ 400	404
Barclays PLC		
3.650% due 03/16/2025	400	392
7.125% due 06/15/2025 (a/lb)	GBP 200	234
7.750% due 09/15/2023 (a/lb)	\$ 200	197
HSBC Holdings PLC		
1.750% due 07/24/2027	GBP 200	218
2.804% due 05/24/2032	\$ 200	164
4.750% due 07/04/2029 (a/lb)	EUR 200	176
5.250% due 09/16/2022 (a/lb)	200	207
6.000% due 09/29/2023 (a/lb)	200	207
6.000% due 05/22/2027 (a/lb)	\$ 200	180
Imperial Brands Finance PLC		
3.500% due 07/26/2026	300	281
NatWest Group PLC		
4.445% due 05/08/2030	300	283
5.076% due 01/27/2030	200	196
Standard Chartered PLC		
1.456% due 01/14/2027	400	353
7.750% due 04/02/2023 (a/lb)	200	198
Weir Group PLC		
2.200% due 05/13/2026	300	284
		3,954
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 2.0%		
Avon Finance No.2 PLC		
2.014% due 09/20/2048	GBP 448	542
Canada Square Funding PLC		
2.024% due 06/17/2058	91	109
Eurosail PLC		
0.000% due 12/15/2044	EUR 300	307
Finsbury Square PLC		
1.565% due 12/16/2071	GBP 486	581
Hawksmoor Mortgages		
1.703% due 05/25/2053	162	197
Lanebrook Mortgage Transaction PLC		
1.111% due 07/20/2058	98	116
London Wall Mortgage Capital PLC		
1.351% due 05/15/2051	177	212
Pierpont BTL PLC		
1.592% due 12/22/2053	195	232
Polaris PLC		
1.730% due 12/23/2058	94	113
Towd Point Mortgage Funding Auburn 14 PLC		
1.883% due 05/20/2045	423	512
Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC		
1.605% due 10/20/2051	49	59
Tower Bridge Funding PLC		
1.763% due 11/20/2063	94	113
Trinity Square PLC		
1.300% due 07/15/2059	161	194
Twin Bridges PLC		
1.893% due 03/12/2055	92	109
		3,396

	元本 (單位：千)	時價 (單位：千)
SOVEREIGN ISSUES 3.0%		
United Kingdom Gilt		
1.250% due 07/22/2027	GBP 2,600	\$ 3,057
4.250% due 12/07/2040	1,347	2,020
		5,077
Total United Kingdom (Cost \$14,465)		12,427
UNITED STATES 40.6% ASSET-BACKED SECURITIES 1.8%		
Credit Acceptance Auto Loan Trust		
1.370% due 07/16/2029	\$ 700	690
Landmark Funding Trust		
2.000% due 04/20/2032	700	602
Mariner Finance Issuance Trust		
2.100% due 11/20/2036	700	618
Navient Private Education Refi Loan Trust		
2.120% due 01/15/2069	60	56
Navient Student Loan Trust		
2.774% due 03/25/2066	531	524
SMB Private Education Loan Trust		
1.600% due 09/15/2054	587	535
		3,025
CORPORATE BONDS & NOTES 8.2%		
AbbVie, Inc.		
3.200% due 11/21/2029	300	276
AES Corp.		
2.450% due 01/15/2031	200	161
Amgen, Inc.		
3.350% due 02/22/2032	300	275
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
5.550% due 01/23/2049	100	102
AT&T, Inc.		
2.250% due 02/01/2032	50	41
3.550% due 09/15/2055	118	89
Aviation Capital Group LLC		
4.125% due 08/01/2025	100	95
5.500% due 12/15/2024	100	99
Bank of America Corp.		
2.687% due 04/22/2032	300	252
3.384% due 04/02/2026	400	388
3.419% due 12/20/2028	415	387
4.571% due 04/27/2033	500	487
Black Hills Corp.		
2.500% due 06/15/2030	100	84
Boeing Co.		
2.750% due 02/01/2026	50	47
3.600% due 05/01/2034	100	80
3.625% due 02/01/2031	50	43
Boston Scientific Corp.		
2.650% due 06/01/2030	300	262
British Airways 2018-1 Class A Pass-Through Trust		
4.125% due 09/20/2031	76	69
Broadcom, Inc.		
2.450% due 02/15/2031	50	40
3.419% due 04/15/2033	100	83
3.469% due 04/15/2034	300	245
4.150% due 04/15/2032	300	271
4.300% due 11/15/2032	48	44

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Charter Communications Operating LLC		
3.850% due 04/01/2061	\$ 24	\$ 16
3.900% due 06/01/2052	24	17
3.950% due 06/30/2062	150	101
4.400% due 12/01/2061	150	108
Citigroup, Inc.		
2.572% due 06/03/2031 (h)	500	421
2.976% due 11/05/2030	100	87
3.070% due 02/24/2028	600	557
Comcast Corp.		
2.937% due 11/01/2056	131	91
Dell International LLC		
6.020% due 06/15/2026	100	104
Energy Transfer LP		
5.300% due 04/01/2044	50	43
5.400% due 10/01/2047	100	88
6.000% due 06/15/2048	138	130
Essential Utilities, Inc.		
3.351% due 04/15/2050	36	27
Energy Metro, Inc.		
2.250% due 06/01/2030	100	86
Goldman Sachs Group, Inc.		
0.555% due 04/30/2024	EUR 100	105
1.250% due 02/07/2029	100	90
2.383% due 07/21/2032	\$ 200	162
2.615% due 04/22/2032	100	83
3.615% due 03/15/2028	500	474
3.691% due 06/05/2028	200	190
HCA, Inc.		
4.125% due 06/15/2029	100	91
4.500% due 02/15/2027	500	481
Hyundai Capital America		
0.800% due 04/03/2023	100	98
JPMorgan Chase & Co.		
2.522% due 04/22/2031	250	213
2.580% due 04/22/2032	200	168
2.739% due 10/15/2030	100	87
2.963% due 01/25/2033	300	258
4.080% due 04/26/2026	500	494
4.323% due 04/26/2028	600	591
Las Vegas Sands Corp.		
3.900% due 08/08/2029	100	82
Mid-America Apartments LP		
3.600% due 06/01/2027	100	96
Mileage Plus Holdings LLC		
6.500% due 06/20/2027	200	197
Morgan Stanley		
1.512% due 07/20/2027	200	176
2.943% due 01/21/2033	300	257
4.210% due 04/20/2028	500	489
Nissan Motor Acceptance Co. LLC		
2.000% due 03/09/2026	300	260
Oracle Corp.		
2.950% due 04/01/2030	100	85
3.950% due 03/25/2051 (h)	100	74
4.100% due 03/25/2061 (h)	80	57
Pacific Gas & Electric Co.		
3.150% due 01/01/2026	100	92
3.250% due 06/01/2031	200	162

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Santander Holdings USA, Inc.		
4.500% due 07/17/2025	\$ 200	\$ 198
Southern California Edison Co.		
3.600% due 02/01/2045	50	38
3.650% due 06/01/2051	100	78
Southern California Gas Co.		
2.550% due 02/01/2030	400	354
Southern Co.		
3.700% due 04/30/2030	100	93
Spirit AeroSystems, Inc.		
4.600% due 06/15/2028	23	17
T-Mobile USA, Inc.		
3.300% due 02/15/2051	126	92
3.600% due 11/15/2060	326	238
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 05/01/2028	90	80
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust		
2.700% due 05/01/2032	91	78
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
5.875% due 10/15/2027	41	40
VMware, Inc.		
2.200% due 08/15/2031	100	79
4.700% due 05/15/2030	100	97
Wells Fargo & Co.		
2.393% due 06/02/2028	200	179
2.572% due 02/11/2031	100	86
3.526% due 03/24/2028	300	284
3.584% due 05/22/2028	100	95
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.		
3.200% due 06/15/2025	300	286
WP Carey, Inc.		
4.000% due 02/01/2025	100	99
		13,919
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 1.8%		
Adjustable Rate Mortgage Trust		
2.925% due 09/25/2035 (c)	12	10
Alternative Loan Trust		
6.000% due 04/25/2037 (c)	119	62
Banc of America Funding Trust		
3.461% due 01/20/2047 (c)	17	16
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
2.535% due 10/25/2033	8	7
2.744% due 11/25/2034	5	5
2.817% due 02/25/2034	2	2
2.846% due 05/25/2034	20	18
2.995% due 05/25/2034	20	19
3.003% due 05/25/2033	32	31
3.048% due 07/25/2033	10	10
Bear Stearns Alternative-A Trust (c)		
2.984% due 01/25/2036	151	148
3.066% due 02/25/2036	30	24
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust		
2.999% due 12/26/2046 (c)	14	12
BSREP Commercial Mortgage Trust		
2.275% due 08/15/2038	500	481
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
2.190% due 09/25/2035	27	27
3.790% due 09/25/2035	17	17

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
1.985% due 02/20/2036 (c)	\$ 13	\$ 10
1.991% due 02/20/2036 (c)	30	29
2.204% due 04/25/2035	5	5
2.264% due 03/25/2035	50	43
2.711% due 11/25/2034	27	26
3.571% due 08/25/2034 (c)	1	1
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
1.744% due 07/25/2037	200	141
CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates		
2.593% due 07/25/2033	1	1
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
2.132% due 08/19/2045	4	4
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust		
3.213% due 08/25/2035 (c)	8	6
Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates		
3.600% due 01/25/2029	200	201
GMACM Mortgage Loan Trust		
3.589% due 11/19/2035 (c)	6	6
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates		
2.684% due 10/25/2033	1	1
GSR Mortgage Loan Trust		
2.680% due 03/25/2033	5	4
HarborView Mortgage Loan Trust		
3.217% due 07/19/2035 (c)	7	5
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
3.016% due 12/25/2034	9	9
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust		
3.723% due 03/15/2050	100	98
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust		
3.694% due 03/15/2050	100	98
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
2.812% due 01/16/2037	100	95
JPMorgan Mortgage Trust		
2.203% due 11/25/2033	11	11
2.496% due 02/25/2035	7	7
2.947% due 07/25/2035	25	24
Lehman Asset-Backed Securities Mortgage Loan Trust		
1.714% due 06/25/2037	24	17
Long Beach Mortgage Loan Trust		
2.184% due 10/25/2034	39	36
Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust		
1.764% due 12/15/2030	47	45
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
2.277% due 02/25/2033	16	15
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
3.102% due 11/15/2049	100	95
Morgan Stanley Capital I Trust		
3.530% due 06/15/2050	100	97
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
2.549% due 10/25/2035	20	13
Ready Capital Mortgage Financing LLC		
2.574% due 07/25/2036	500	480
Residential Asset Securitization Trust		
5.500% due 06/25/2033	45	44

	元本 (單位：千)	時価 (單位：千)
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust		
1.754% due 05/25/2037 (c)	\$ 332	\$ 264
Sequoia Mortgage Trust		
2.602% due 04/20/2035	7	7
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
2.064% due 05/25/2037	29	26
2.513% due 04/25/2034	17	16
2.543% due 02/25/2034	14	14
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
2.044% due 05/25/2036	47	38
2.295% due 03/19/2034	8	8
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
2.562% due 04/25/2035	6	6
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
2.244% due 01/25/2045	7	7
2.368% due 03/25/2033	65	63
2.462% due 03/25/2034	44	44
3.220% due 06/25/2033	8	8
	<u>3,057</u>	
MUNICIPAL BONDS & NOTES 0.2%		
Illinois, Electric Agency Revenue Bonds, Series 2009		
6.832% due 02/01/2035	200	229
STRUCTURED NOTES 0.2%		
JPMorgan Structured Products BV		
6.375% due 04/19/2032	IDR 5,922,000	376
U.S. GOVERNMENT AGENCIES 14.0%		
Fannie Mae		
2.287% due 02/01/2036	\$ 21	21
4.000% due 12/01/2025	11	12
4.000% due 02/01/2026	25	25
4.000% due 06/01/2048	37	37
4.000% due 09/01/2048	66	66
4.500% due 06/01/2038	49	50
6.000% due 12/01/2037	7	8
Fannie Mae, TBA (d)		
3.000% due 08/01/2052	8,800	8,190
3.500% due 08/01/2052	8,200	7,879
4.000% due 08/01/2052	6,900	6,794
Freddie Mac		
6.000% due 12/01/2033	81	84
6.000% due 04/15/2036	92	100
Ginnie Mae		
3.000% due 04/20/2047	169	162
3.500% due 01/20/2048	187	183
5.000% due 02/15/2039	84	89
	<u>23,700</u>	
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 14.4%		
Treasury Inflation Protected Securities		
0.750% due 02/15/2045 (e)(k)	333	299
U.S. Treasury Bonds		
1.625% due 11/15/2050	1,132	797
1.875% due 02/15/2041	6,150	4,826
1.875% due 11/15/2051	600	450
2.000% due 11/15/2041	300	238
2.250% due 02/15/2052	300	247
2.375% due 02/15/2042	1,800	1,527
2.500% due 02/15/2045	134	114
2.875% due 05/15/2043	1	1
2.875% due 05/15/2052	400	378
3.625% due 08/15/2043	221	228
4.375% due 05/15/2041	237	271

	元本 (單位：千)	時価 (單位：千)
U.S. Treasury Notes		
0.375% due 04/30/2025	\$ 50	\$ 46
2.750% due 08/31/2023	7,000	6,985
2.750% due 02/28/2025	8,000	7,945
	<u>24,352</u>	
Total United States (Cost \$73,384)		
	<u>68,658</u>	
SHORT-TERM INSTRUMENTS 34.2%		
REPURCHASE AGREEMENTS (i) 10.0%		
		<u>16,918</u>
TIME DEPOSITS 0.6%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.250% due 07/01/2022	AUD 36	25
0.250% due 07/01/2022	NZD 148	92
1.060% due 07/01/2022	\$ 3	3
Bank of Nova Scotia		
0.560% due 07/04/2022	CAD 190	148
1.060% due 07/01/2022	\$ 5	5
BNP Paribas Bank		
(1.200%) due 07/01/2022	CHF 26	27
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 106	111
(0.730%) due 07/01/2022	DKK 4	1
0.370% due 07/04/2022	HKD 7	1
0.520% due 07/01/2022	GBP 3	4
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.360%) due 07/01/2022	¥ 3	0
0.005% due 07/01/2022	SEK 3	0
0.070% due 07/01/2022	NOK 3	0
Citibank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 18	18
DBS Bank Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	16	16
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 37	39
0.520% due 07/01/2022	GBP 43	52
JPMorgan Chase Bank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 37	37
MUFG Bank Ltd.		
(0.360%) due 07/01/2022	¥ 2,627	19
Royal Bank of Canada		
1.060% due 07/01/2022	\$ 2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 102	107
(0.360%) due 07/01/2022	¥ 2,231	16
1.060% due 07/01/2022	\$ 16	16
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 12	12
(0.360%) due 07/01/2022	¥ 10,254	75
0.520% due 07/01/2022	GBP 5	6
1.060% due 07/01/2022	\$ 35	35
The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd.		
0.370% due 07/04/2022	HKD 252	32
0.650% due 07/01/2022	SGD 224	161
	<u>1,060</u>	
JAPAN TREASURY BILLS 18.3%		
(0.184%) due 09/26/2022 (f)	¥ 310,000	2,283
(0.147%) due 09/20/2022 (g)	530,000	3,903
(0.138%) due 08/08/2022 (f)	250,000	1,840

	元本 (單位：千)	時価 (單位：千)
(0.122%) due 08/15/2022 (f)	¥ 170,000	1,252
(0.121%) due 08/22/2022 (f)	280,000	2,061
(0.119%) due 08/01/2022 (f)	170,000	1,251
(0.115%) due 07/25/2022 (g)	220,000	1,620
(0.106%) due 08/29/2022 (g)	1,100,000	8,099
(0.098%) due 07/11/2022 (f)	160,000	1,178
(0.094%) due 09/12/2022 (f)	690,000	5,080
(0.082%) due 07/04/2022 (f)	320,000	2,355
	<u>30,922</u>	
U.S. TREASURY BILLS (f) 5.3%		
0.634% due 07/19/2022	\$ 4,000	3,998
0.652% due 07/05/2022	3,000	3,000
0.737% due 07/12/2022	1,900	1,899
	<u>8,897</u>	
Total Short-Term Instruments (Cost \$59,501)		
	<u>57,797</u>	
Total Investments in Securities 111.0% (Cost \$203,890)		
	<u>\$ 187,842</u>	
Financial Derivative Instruments (j)(l) 0.7% (Cost or Premiums, net \$ (97))		
		<u>1,170</u>
Other Assets and Liabilities, net (11.7%) (19,776)		
		<u>\$ 169,236</u>

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Contingent convertible security.
(b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
(c) Security is in default.
(d) When-Issued security.
(e) Principal amount of security is adjusted for inflation.
(f) Coupon represents a yield to maturity.
(g) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(h) RESTRICTED SECURITIES:

Issuer Description	Coupon	Maturity Date	Acquisition Date	Cost	Market Value	Market Value as Percentage of Net Assets
Citigroup, Inc.	2.572%	06/03/2031	06/09/2022	\$ 428	\$ 421	0.25%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/27/2021	414	317	0.19%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	07/27/2021	111	74	0.04%
Oracle Corp.	4.100%	03/25/2061	04/15/2021	89	57	0.03%
Total Restricted Securities				\$ 1,042	\$ 869	0.51%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS
(i) REPURCHASE AGREEMENTS:

Counterparty	Lending Rate	Settlement Date	Maturity Date	Principal Amount	Collateralized By	Collateral Received, at Value	Repurchase Agreements, at Value	Repurchase Agreement Proceeds to be Received ⁽¹⁾
BPS	(0.560%)	06/10/2022	09/08/2022	EUR 4,800	Belgium Government Bond 2.150% due 06/22/2066			
					U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0.750% due 07/15/2028	\$ (5,029)	\$ 5,018	\$ 5,011
SAL	1.490%	06/30/2022	07/01/2022	\$ 11,900	U.S. Treasury Notes 3.000% due 06/30/2024	(12,137)	11,900	11,901
Total Repurchase Agreements						\$ (17,166)	\$ 16,918	\$ 16,912

SHORT SALES:

Counterparty	Description	Coupon	Maturity Date	Principal Amount	Proceeds	Payable for Short Sales
BOS	Fannie Mae, TBA	2.000%	08/01/2052	\$ 5,840	\$ (5,064)	\$ (5,065)
BOS	Fannie Mae, TBA	2.500%	08/01/2052	520	(467)	(467)
Total Short Sales (3.3%)					\$ (5,531)	\$ (5,532)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of June 30, 2022:

Counterparty	Repurchase Agreement Proceeds to be Received	Payable for Reverse Repurchase Agreements	Payable for Sale-Buyback Transactions	Payable for Short Sales	Total Borrowings and Other Financing Transactions	Collateral Pledged/(Received)	Net Exposure ⁽²⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 5,011	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 5,011	\$ (5,150)	\$ (139)
SAL	11,901	0	0	0	11,901	(12,137)	(236)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
BOS	0	0	0	(5,532)	(5,532)	0	(5,532)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 16,912	\$ 0	\$ 0	\$ (5,532)			

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

⁽²⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

The average amount of borrowings outstanding during the period ended June 30, 2022 was \$423 at a weighted average interest rate of 0.034%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

(j) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED

FUTURES CONTRACTS:

Description	Type	Expiration Month	# of Contracts	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
					Asset	Liability
Australia Government 3-Year Bond September Futures	Short	09/2022	104	\$ (6)	\$ 0	\$(35)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	21	(6)	11	0
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	22	(67)	11	0
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	Long	09/2022	15	(1)	31	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	32	(90)	98	0
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2022	42	179	0	(158)
Euro-Bund 30-Year Bond September Futures	Long	09/2022	4	(57)	29	0
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	1	(2)	3	0
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	Long	09/2022	63	(23)	42	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2022	4	4	0	(2)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2022	6	4	0	(3)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	29	(17)	20	0
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	Short	09/2022	1	1	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	17	(20)	16	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	Long	09/2022	5	(18)	5	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September Futures	Long	09/2022	7	(35)	16	0
Total Futures Contracts				\$ (154)	\$ 282	\$ (199)

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

Reference Entity	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Implied Credit Spread at June 30, 2022 ⁽²⁾	Notional Amount ⁽³⁾	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
							Asset	Liability
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	1.142%	\$ 200	\$ (1)	\$ (5)	\$ 0	\$ 0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	2.445%	300	(17)	(16)	0	0
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	1.799%	EUR 100	(5)	(3)	0	(1)
					\$ (23)	\$ (24)	\$ 0	\$ (1)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

Index/Tranches	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Notional Amount ⁽³⁾	Market Value ⁽⁴⁾	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
						Asset	Liability
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2031	\$ 1,080	\$ (23)	\$ (19)	\$ 0	\$ 0
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2027	7,800	0	(92)	0	(2)
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2032	4,100	(106)	(54)	0	(1)
iTraxx Europe Series 37 Index	1.000%	06/20/2027	EUR 1,000	(9)	(11)	0	(3)
				\$ (138)	\$ (176)	\$ 0	\$ (6)

INTEREST RATE SWAPS

Pay/Receive Floating Rate	Floating Rate Index	Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
							Asset	Liability
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	0.900%	03/10/2024	CAD 600	\$ (20)	\$ (20)	\$ 1	\$ 0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	1.000%	06/16/2026	1,200	(86)	(47)	2	0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	1.900%	12/18/2029	3,350	(286)	(293)	12	0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	12/18/2049	550	(107)	(97)	3	0
Receive	3-Month Canadian Bank Bill	1.750%	06/17/2050	20	(5)	(6)	0	0
Pay ⁽⁵⁾	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.000%	06/14/2024	NZD 10,600	(18)	(1)	8	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024	6,900	(285)	(214)	11	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	3.750%	06/15/2027	1,000	(8)	(2)	3	0
Receive	3-Month SEK-STIBOR	0.750%	03/21/2023	SEK 2,000	1	4	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2024	\$ 2,400	81	154	0	(2)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.665%	01/12/2029	1,900	(146)	(146)	13	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	AUD 400	(42)	(42)	1	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032	1,200	(129)	(103)	4	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.500%	12/15/2026	EUR 460	(24)	(40)	6	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027	1,050	(54)	(42)	13	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027	800	(43)	(35)	11	0

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

Pay/Receive	Floating Rate	Floating Rate Index	Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Market Value	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	Variation Margin		
								Asset	Liability	
Pay ⁽ⁱ⁾	6-Month	EURIBOR	(0.250%)	09/21/2027	EUR 10,100	\$ (1,099)	\$ (415)	\$ 133	\$ 0	
Pay ⁽ⁱⁱ⁾	6-Month	EURIBOR	0.250%	09/21/2032	9,170	(1,763)	(372)	147	0	
Pay ⁽ⁱⁱ⁾	6-Month	EURIBOR	0.500%	09/21/2052	800	(284)	(4)	21	0	
Pay	7-Day	China Fixing Repo Rate	2.500%	03/16/2027	CNY 23,100	(12)	(31)	4	0	
Receive		Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.143%	02/19/2031	¥ 30,000	6	6	0	(1)	
Receive		Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.200%	12/15/2041	10,000	9	6	0	0	
Receive		Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042	90,000	45	20	0	(2)	
Receive		Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.800%	06/15/2052	90,000	43	39	0	(3)	
Pay		IBMEXID	5.970%	05/06/2030	MXN 2,800	(23)	(20)	0	0	
Receive ⁽ⁱⁱⁱ⁾		Secured Overnight Financing Rate	1.320%	12/21/2023	\$ 10,500	202	113	0	(14)	
Receive ⁽ⁱⁱⁱ⁾		Secured Overnight Financing Rate	1.050%	12/15/2024	5,400	205	97	0	(15)	
Pay		Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	800	(90)	(17)	5	0	
Receive		Secured Overnight Financing Rate	1.855%	05/04/2032	200	(19)	(19)	2	0	
Receive		Secured Overnight Financing Rate	2.365%	06/23/2032	1,500	(56)	(56)	13	0	
Pay		Singapore Overnight Index Average	3.000%	06/15/2027	SGD 7,700	77	50	0	(23)	
Pay		Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.010%	02/07/2023	GBP 3,100	(59)	(59)	1	0	
Pay ⁽ⁱⁱⁱ⁾		Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.750%	09/21/2032	900	(158)	6	0	0	
Pay		Swiss Overnight Rate Average	(0.500%)	09/15/2026	CHF 2,800	(185)	(162)	40	0	
							\$ (4,332)	\$ (1,748)	\$ 454	\$ (60)
Total Swap Agreements							\$ (4,493)	\$ (1,948)	\$ 454	\$ (67)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of June 30, 2022:

- (k) **Securities with an aggregate market value of \$20 and cash of \$2,537 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of June 30, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.**

Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	Financial Derivative Assets					Financial Derivative Liabilities				
	Market Value		Variation Margin			Market Value		Variation Margin		
	Purchased Options	Futures	Asset		Total	Written Options	Futures	Liability		Total
			Swap Agreements	Swap Agreements				Swap Agreements	Swap Agreements	
	\$ 0	\$ 282	\$ 454	\$ 736	\$ 0	\$ (199)	\$ (67)	\$ (266)		

⁽ⁱ⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

⁽ⁱⁱ⁾ Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

⁽ⁱⁱⁱ⁾ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

^(iv) The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

^(v) This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for Further information.

(l) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER
FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered		Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
		Asset	Liability		Asset	Liability
AZD	07/2022	AUD	98	\$ 68	\$ 1	\$ 0
AZD	08/2022	\$	68	AUD 98	0	(1)
BOA	07/2022	AUD	139	\$ 97	1	0
BOA	07/2022	JPY	320,000	2,630	275	0
BOA	07/2022	\$	421	AUD 597	0	(11)

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
BOA	07/2022	\$ 5,679	DKK 39,925	\$ 0	\$ (66)
BOA	08/2022	CAD 152	\$ 118	0	0
BOA	08/2022	DKK 39,844	5,679	67	0
BOA	08/2022	EUR 6,174	6,629	156	0
BOA	08/2022	JPY 250,000	1,925	81	0
BOA	08/2022	\$ 97	AUD 139	0	(1)
BOA	08/2022	1,481	EUR 1,395	0	(19)
BOA	08/2022	809	GBP 648	0	(21)
BOA	08/2022	237	NOK 2,252	0	(8)
BOA	08/2022	748	SEK 7,400	0	(25)
BPS	07/2022	DKK 5,370	\$ 778	23	0
BPS	07/2022	JPY 52,300	405	20	0
BPS	07/2022	170,000	1,350	97	0
BPS	07/2022	MXN 44	2	0	0
BPS	07/2022	NZD 167	105	1	0
BPS	07/2022	\$ 188	DKK 1,319	0	(2)
BPS	07/2022	10	MXN 204	0	0
BPS	08/2022	CAD 121	\$ 94	0	0
BPS	08/2022	THB 3	0	0	0
BPS	08/2022	\$ 738	CAD 955	2	0
BPS	08/2022	8,245	EUR 7,804	0	(6)
BPS	08/2022	26	IDR 385,508	0	0
BPS	08/2022	177	2,623,154	0	(2)
BPS	09/2022	JPY 317,000	\$ 2,373	28	0
BPS	09/2022	MXN 204	10	0	0
BRC	07/2022	JPY 160,000	1,313	135	0
BRC	07/2022	\$ 1,914	JPY 259,593	0	(3)
BRC	08/2022	GBP 48	\$ 59	1	0
BRC	08/2022	JPY 280,000	2,194	126	0
BRC	08/2022	258,171	1,914	3	0
BRC	08/2022	170,000	1,327	74	0
BRC	08/2022	SGD 220	159	1	0
BRC	08/2022	\$ 29	IDR 424,160	0	0
BRC	08/2022	163	NOK 1,596	0	(1)
BRC	08/2022	35	SEK 343	0	(1)
BRC	09/2022	JPY 373,000	\$ 2,792	32	0
CBK	08/2022	IDR 4,197,862	285	5	0
CBK	11/2022	PEN 768	194	0	(6)
CBK	11/2022	\$ 139	PEN 552	4	0
CBK	12/2022	76	320	7	0
CBK	02/2023	PEN 1,121	\$ 282	0	(7)
DUB	07/2022	DKK 6,799	1,007	51	0
DUB	07/2022	\$ 292	PLN 1,275	0	(9)
DUB	08/2022	GBP 1,091	\$ 1,346	20	0
DUB	08/2022	\$ 24,446	EUR 23,022	0	(305)
DUB	08/2022	54	THB 1,873	0	(1)
GLM	08/2022	13	PEN 49	0	0
GLM	08/2022	3	THB 90	0	0
GLM	09/2022	87	MYR 382	0	0
GLM	10/2022	105	MXN 2,156	0	0
HUS	08/2022	CNH 2,943	\$ 438	0	(1)
HUS	08/2022	\$ 141	IDR 2,062,592	0	(3)
HUS	05/2023	CNH 326	\$ 49	0	0
JPM	07/2022	\$ 133	CZK 3,121	0	(1)
JPM	07/2022	121	DKK 836	0	(4)
JPM	07/2022	481	NOK 4,736	0	(2)
JPM	08/2022	CNH 1,294	\$ 192	0	(1)
JPM	08/2022	EUR 587	615	0	0
JPM	08/2022	JPY 170,000	1,322	67	0
JPM	08/2022	KRW 268,563	211	4	0
JPM	08/2022	SGD 1,763	1,283	16	0
JPM	08/2022	\$ 319	IDR 4,688,635	0	(6)
JPM	08/2022	34	PEN 131	0	0
MBC	07/2022	MXN 160	\$ 8	0	0
MBC	07/2022	\$ 2,743	AUD 3,983	0	(4)
MBC	07/2022	297	NZD 455	0	(14)
MBC	08/2022	AUD 3,983	\$ 2,743	4	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
MBC	08/2022	\$ 1,466	CAD 1,878	\$ 0	\$ (10)
MBC	08/2022	208	CHF 206	8	0
MBC	08/2022	113	EUR 108	0	0
MBC	08/2022	478	NOK 4,735	1	0
MBC	09/2022	JPY 310,000	\$ 2,317	21	0
MYI	07/2022	DKK 38,811	5,659	203	0
MYI	07/2022	JPY 1,681	13	1	0
MYI	07/2022	\$ 1,268	DKK 8,894	0	(18)
MYI	08/2022	CAD 97	\$ 75	0	0
MYI	08/2022	DKK 8,362	1,191	13	0
MYI	08/2022	EUR 887	938	8	0
MYI	08/2022	GBP 159	196	3	0
MYI	08/2022	JPY 6,373	47	0	0
MYI	08/2022	KRW 1,113,970	873	14	0
MYI	08/2022	SEK 157	15	0	0
MYI	08/2022	\$ 35	AUD 51	0	0
MYI	08/2022	3,812	CNY 25,589	4	0
MYI	08/2022	253	DKK 1,794	0	0
MYI	08/2022	329	EUR 315	2	0
MYI	08/2022	227	GBP 181	0	(7)
MYI	08/2022	32	IDR 477,155	0	(1)
MYI	08/2022	255	NOK 2,475	0	(5)
MYI	08/2022	17	NZD 27	0	0
MYI	08/2022	133	THB 4,568	0	(3)
RBC	08/2022	JPY 1,100,000	\$ 8,699	571	0
RBC	08/2022	\$ 2,624	CAD 3,396	8	0
RBC	08/2022	150	GBP 121	0	(3)
SCX	07/2022	JPY 50,000	\$ 401	32	0
SCX	07/2022	\$ 232	ILS 780	0	(9)
SCX	08/2022	CNH 5,221	\$ 779	1	0
SCX	08/2022	\$ 643	CHF 643	30	0
SCX	08/2022	6,288	CNY 42,087	0	(13)
SCX	09/2022	67	CLP 56,107	0	(9)
SCX	09/2022	67	MYR 282	0	(3)
SOG	08/2022	251	NOK 2,457	0	(2)
SSB	08/2022	87	KRW 109,194	0	(3)
SSB	09/2022	400	MYR 1,753	0	(3)
TOR	08/2022	CHF 26	\$ 26	0	(1)
TOR	09/2022	JPY 530,000	3,969	46	0
UAG	07/2022	AUD 4,292	3,066	114	0
UAG	07/2022	\$ 113	HUF 39,691	0	(9)
UAG	08/2022	66	CNY 443	0	0
UAG	08/2022	447	KRW 572,982	0	(5)
UAG	09/2022	147	MXN 2,922	0	(4)
UAG	10/2022	234	4,783	0	(1)
				\$ 2,381	\$ (695)

C (JPY, HEDGED) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
BOA	07/2022	EUR 6	\$ 6	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2022	GBP 471	595	23	0
BOA	07/2022	\$ 135	AUD 195	0	(1)
BOA	07/2022	19	DKK 134	0	0
BOA	07/2022	78	JPY 10,499	0	(1)
BOA	08/2022	AUD 195	\$ 135	1	0
BOA	08/2022	CNY 34	5	0	0
BOA	08/2022	DKK 134	19	0	0
BOA	08/2022	\$ 37	CNY 249	0	0
BPS	07/2022	CAD 4	\$ 3	0	0
BPS	07/2022	CHF 58	80	0	0
BPS	07/2022	EUR 113	120	2	0
BPS	07/2022	GBP 4	5	0	0
BPS	07/2022	JPY 126,840	935	2	0
BPS	07/2022	PLN 76	17	0	0

C (JPY, HEDGED) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
BPS	07/2022	\$ 2,707	EUR 2,573	\$ 0	\$ (17)
BPS	07/2022	576	GBP 475	0	0
BPS	07/2022	2,826	JPY 363,775	0	(148)
BPS	08/2022	EUR 2,523	\$ 2,659	16	0
BPS	08/2022	GBP 475	577	0	0
BPS	08/2022	\$ 901	JPY 122,219	0	0
BRC	07/2022	JPY 197,140	\$ 1,453	2	0
BRC	07/2022	\$ 32	JPY 4,265	0	0
BRC	08/2022	SGD 4	\$ 3	0	0
BRC	08/2022	\$ 1,453	JPY 196,820	0	(2)
CBK	07/2022	ILS 58	\$ 17	0	0
CBK	07/2022	MXN 137	7	0	0
CBK	07/2022	\$ 129	EUR 120	0	(3)
CBK	07/2022	26	JPY 3,506	0	0
GLM	07/2022	0	DKK 0	0	0
GLM	08/2022	DKK 0	\$ 0	0	0
GLM	09/2022	HKD 11	1	0	0
HUS	07/2022	HUF 2,536	7	1	0
HUS	08/2022	CLP 3,200	4	0	0
HUS	08/2022	IDR 240,252	16	0	0
JPM	07/2022	CZK 304	13	0	0
JPM	07/2022	\$ 3	AUD 5	0	0
JPM	07/2022	0	CZK 1	0	0
JPM	07/2022	598	JPY 76,330	0	(36)
JPM	08/2022	AUD 5	\$ 3	0	0
JPM	08/2022	CNY 4,385	655	1	0
JPM	08/2022	IDR 546,141	37	1	0
JPM	08/2022	KRW 74,380	58	1	0
JPM	08/2022	SGD 32	23	0	0
MBC	07/2022	CAD 40	32	1	0
MBC	07/2022	DKK 30	4	0	0
MBC	07/2022	EUR 12	13	0	0
MBC	07/2022	13	14	0	0
MBC	07/2022	JPY 7,338	54	0	0
MBC	07/2022	450,254	3,303	0	(11)
MBC	07/2022	NOK 98	10	1	0
MBC	07/2022	NZD 27	18	1	0
MBC	07/2022	SEK 511	52	3	0
MBC	07/2022	\$ 69	EUR 65	0	0
MBC	07/2022	12	12	0	0
MBC	07/2022	458	JPY 58,262	0	(29)
MBC	07/2022	54	7,338	0	0
MBC	08/2022	EUR 12	\$ 13	0	0
MBC	08/2022	\$ 3,357	JPY 456,866	12	0
MYI	07/2022	DKK 133	\$ 20	1	0
MYI	07/2022	JPY 75,630	556	0	(1)
MYI	07/2022	\$ 3	AUD 4	0	0
MYI	07/2022	28	CAD 36	0	0
MYI	07/2022	4	DKK 28	0	0
MYI	07/2022	91	EUR 87	0	0
MYI	07/2022	52	GBP 43	0	0
MYI	07/2022	16	JPY 2,212	0	0
MYI	08/2022	AUD 4	\$ 3	0	0
MYI	08/2022	CNY 2,724	406	0	0
MYI	08/2022	DKK 28	4	0	0
MYI	08/2022	KRW 96,271	76	1	0
MYI	08/2022	PEN 19	5	0	0
MYI	08/2022	\$ 291	JPY 39,530	1	0
MYI	09/2022	MYR 171	\$ 39	0	0
RBC	07/2022	JPY 116,897	860	0	0
RBC	07/2022	\$ 79	CAD 101	0	0
RBC	08/2022	CAD 101	\$ 79	0	0
RBC	08/2022	\$ 860	JPY 116,701	0	0
SCX	07/2022	JPY 424,387	\$ 3,120	0	(4)
SCX	07/2022	\$ 26	AUD 38	0	0
SCX	07/2022	3,832	JPY 492,537	0	(207)
SCX	08/2022	AUD 38	\$ 26	0	0

C (JPY, HEDGED) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)		
				Asset	Liability	
SCX	08/2022	\$ 3,120	JPY 423,690	\$ 4	\$ 0	
SOG	07/2022	EUR 2,630	\$ 2,827	77	0	
SOG	09/2022	HKD 4	1	0	0	
TOR	07/2022	CAD 433	339	3	0	
TOR	07/2022	JPY 143,793	1,065	6	0	
TOR	07/2022	\$ 7	AUD 10	0	0	
TOR	07/2022	238	CAD 306	0	(1)	
TOR	07/2022	3,850	JPY 488,712	0	(253)	
TOR	08/2022	AUD 10	\$ 7	0	0	
TOR	08/2022	CAD 306	238	1	0	
TOR	08/2022	\$ 1,065	JPY 143,563	0	(6)	
UAG	07/2022	AUD 252	\$ 180	7	0	
UAG	08/2022	KRW 13,294	11	0	0	
UAG	09/2022	MXN 480	24	1	0	
				\$ 170	\$ (720)	
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 2,551	\$ (1,415)	

PURCHASED OPTIONS:
INTEREST RATE SWAPIONS

Counterparty	Description	Floating Rate Index	Pay/Receive Floating Rate	Exercise Rate	Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Cost	Market Value
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.000%	03/15/2023	300	\$ 28	\$ 141

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

Counterparty	Description	Strike Price	Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Cost	Market Value
BOA	Call - OTC Singapore dollar versus Chinese renminbi	CNH 4.819	09/27/2022	900	\$ 5	\$ 7
					\$ 33	\$ 148

WRITTEN OPTIONS:
INTEREST RATE SWAPIONS

Counterparty	Description	Floating Rate Index	Pay/Receive Floating Rate	Exercise Rate	Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Premiums (Received)	Market Value
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.800%	08/24/2022	2,000	\$ (21)	\$ (35)
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	(0.175%)	03/15/2023	900	(25)	(216)
DUB	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.350%	08/08/2022	200	(1)	0
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.550%	08/08/2022	200	(1)	(4)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0.870%	11/02/2022	12,700	(26)	0
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	1.270%	11/02/2022	12,700	(26)	(291)
							\$ (100)	\$ (546)

CREDIT DEFAULT SWAPIONS

Counterparty	Description	Buy/Sell Protection	Exercise Rate	Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Premiums (Received)	Market Value
BOA	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.200%	07/20/2022	400	\$ 0	\$ 0
BOA	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.400%	08/17/2022	300	(1)	(1)
BPS	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.200%	07/20/2022	600	(1)	0
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.600%	08/17/2022	300	(1)	(1)
						\$ (3)	\$ (2)

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

Counterparty	Description	Strike Price	Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Premiums (Received)	Market Value
BOA	Call - OTC Singapore dollar versus Chinese renminbi	CNH 4.960	09/27/2022	900	\$ (2)	\$ (2)
Total Written Options					\$ (105)	\$ (550)

SWAP AGREEMENTS:
CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

Counterparty	Reference Entity	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Implied Credit Spread at June 30, 2022 ⁽²⁾	Notional Amount ⁽⁴⁾	Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	Swap Agreements, at Value Asset	Swap Agreements, at Value Liability
JPM	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2023	2.075%	\$ 300	\$ (16)	\$ 12	\$ 0	\$ (4)

INTEREST RATE SWAPS

Counterparty	Pay/Receive Floating Rate	Floating Rate Index	Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	Swap Agreements, at Value Asset	Swap Agreements, at Value Liability
BOA	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	4.000%	06/15/2027	MYR 16,400	\$ (9)	\$ (21)	\$ 0	\$ (30)
Total Swap Agreements						\$ (25)	\$ (9)	\$ 0	\$ (34)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of OTC financial derivative instruments and collateral pledged/(received) as of June 30, 2022:

Cash of \$391 has been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as of June 30, 2022.

Counterparty	Financial Derivative Assets				Financial Derivative Liabilities						
	Forward Foreign Currency Contracts	Purchased Options	Swap Agreements	Total Over the Counter	Forward Foreign Currency Contracts	Written Options	Swap Agreements	Total Over the Counter	Net Market Value of OTC Derivatives	Collateral Pledged/(Received)	Net Exposure ⁽⁵⁾
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ 0
BOA	603	7	0	610	(153)	(38)	(30)	(221)	389	(270)	119
BPS	191	141	0	332	(230)	(216)	0	(446)	(114)	0	(114)
BRC	374	0	0	374	(7)	(1)	0	(8)	366	(260)	106
CBK	16	0	0	16	(16)	0	0	(16)	0	0	0
DUB	71	0	0	71	(315)	(4)	0	(319)	(248)	0	(248)
GLM	0	0	0	0	0	(291)	0	(291)	(291)	391	100
HUS	1	0	0	1	(4)	0	0	(4)	(3)	0	(3)
JPM	90	0	0	90	(50)	0	(4)	(54)	36	0	36
MBC	52	0	0	52	(68)	0	0	(68)	(16)	0	(16)
MYI	251	0	0	251	(35)	0	0	(35)	216	(80)	136
RBC	579	0	0	579	(3)	0	0	(3)	576	(560)	16
SCX	67	0	0	67	(245)	0	0	(245)	(178)	0	(178)
SOG	77	0	0	77	(2)	0	0	(2)	75	0	75
SSB	0	0	0	0	(6)	0	0	(6)	(6)	0	(6)
TOR	56	0	0	56	(261)	0	0	(261)	(205)	0	(205)
UAG	122	0	0	122	(19)	0	0	(19)	103	0	103
Total Over the Counter	\$ 2,551	\$ 148	\$ 0	\$ 2,699	\$ (1,415)	\$ (550)	\$ (34)	\$ (1,999)			

⁽¹⁾ Notional amount represents the number of contracts.

⁽²⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

⁽³⁾ Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

⁽⁴⁾ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

⁽⁵⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from OTC financial derivative instruments can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

FAIR VALUE OF FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS

The following is a summary of the fair valuation of the Fund's derivative instruments categorized by risk exposure. See Note 7, Principal and Other Risks, in the Notes to Financial Statements on risks of the Fund.

Fair Values of Financial Derivative Instruments on the Statements of Assets and Liabilities as of June 30, 2022:

Derivatives not accounted for as hedging instruments						
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Financial Derivative Instruments - Assets						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 282	\$ 282
Swap Agreements	0	0	0	0	454	454
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 736	\$ 736
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,551	\$ 0	\$ 2,551
Purchased Options	0	0	0	7	141	148
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,558	\$ 141	\$ 2,699
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,558	\$ 877	\$ 3,435
Financial Derivative Instruments - Liabilities						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (199)	\$ (199)
Swap Agreements	0	(7)	0	0	(60)	(67)
	\$ 0	\$ (7)	\$ 0	\$ 0	\$ (259)	\$ (266)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1,415)	\$ 0	\$ (1,415)
Written Options	0	(2)	0	(2)	(546)	(550)
Swap Agreements	0	(4)	0	0	(30)	(34)
	\$ 0	\$ (6)	\$ 0	\$ (1,417)	\$ (576)	\$ (1,999)
	\$ 0	\$ (13)	\$ 0	\$ (1,417)	\$ (835)	\$ (2,265)

The Effect of Financial Derivative Instruments on the Statements of Operations for the period ended June 30, 2022:

Derivatives not accounted for as hedging instruments						
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (2,004)	\$ (2,004)
Swap Agreements	0	17	0	0	(1,141)	(1,124)
	\$ 0	\$ 17	\$ 0	\$ 0	\$ (3,145)	\$ (3,128)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1,506)	\$ 0	\$ (1,506)
Written Options	0	11	0	1	158	170
Swap Agreements	0	1	0	0	(2)	(1)
	\$ 0	\$ 12	\$ 0	\$ (1,505)	\$ 156	\$ (1,337)
	\$ 0	\$ 29	\$ 0	\$ (1,505)	\$ (2,989)	\$ (4,465)
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (135)	\$ (135)
Swap Agreements	0	(202)	0	0	(1,637)	(1,839)
	\$ 0	\$ (202)	\$ 0	\$ 0	\$ (1,772)	\$ (1,974)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 1,323	\$ 0	\$ 1,323
Purchased Options	0	0	0	2	103	105
Written Options	0	0	0	0	(487)	(487)
Swap Agreements	0	(5)	0	0	(14)	(19)
	\$ 0	\$ (5)	\$ 0	\$ 1,325	\$ (398)	\$ 922
	\$ 0	\$ (207)	\$ 0	\$ 1,325	\$ (2,170)	\$ (1,052)

FAIR VALUE MEASUREMENTS

The following is a summary of the fair valuations according to the inputs used as of June 30, 2022 in valuing the Fund's assets and liabilities:

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 06/30/2022	Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 06/30/2022
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Australia					Spain				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 85	\$ 0	\$ 85	Sovereign Issues	\$ 0	\$ 1,781	\$ 0	\$ 1,781
Mortgage-Backed Securities	0	3,721	0	3,721	Supranational				
Sovereign Issues	0	2,357	0	2,357	Sovereign Issues	0	333	0	333
Bermuda					Switzerland				
Corporate Bonds & Notes	0	99	0	99	Corporate Bonds & Notes	0	2,598	0	2,598
Canada					Thailand				
Sovereign Issues	0	660	0	660	Sovereign Issues	0	257	0	257
Cayman Islands					United Arab Emirates				
Asset-Backed Securities	0	3,208	0	3,208	Corporate Bonds & Notes	0	190	0	190
Corporate Bonds & Notes	0	1,399	0	1,399	Sovereign Issues	0	356	0	356
Chile					United Kingdom				
Sovereign Issues	0	854	0	854	Corporate Bonds & Notes	0	3,954	0	3,954
China					Mortgage-Backed Securities	0	3,396	0	3,396
Sovereign Issues	0	6,529	0	6,529	Sovereign Issues	0	5,077	0	5,077
Denmark					United States				
Corporate Bonds & Notes	0	6,858	0	6,858	Asset-Backed Securities	0	3,025	0	3,025
France					Corporate Bonds & Notes	0	13,919	0	13,919
Corporate Bonds & Notes	0	969	0	969	Mortgage-Backed Securities	0	3,057	0	3,057
Sovereign Issues	0	1,305	0	1,305	Municipal Bonds & Notes	0	229	0	229
Germany					Structured Notes	0	376	0	376
Corporate Bonds & Notes	0	848	0	848	U.S. Government Agencies	0	23,700	0	23,700
Hong Kong					U.S. Treasury Obligations	0	24,352	0	24,352
Corporate Bonds & Notes	0	369	0	369	Short-Term Instruments	0	57,797	0	57,797
Indonesia					Total Investments	\$ 0	\$ 187,842	\$ 0	\$ 187,842
Sovereign Issues	0	192	0	192	Short Sales, at value	\$ 0	\$ (5,532)	\$ 0	\$ (5,532)
Ireland					Financial Derivative Instruments - Assets				
Asset-Backed Securities	0	2,908	0	2,908	Exchange-traded or centrally				
Corporate Bonds & Notes	0	174	0	174	cleared	241	495	0	736
Israel					Over the counter	0	2,699	0	2,699
Sovereign Issues	0	441	0	441		\$ 241	\$ 3,194	\$ 0	\$ 3,435
Italy					Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Corporate Bonds & Notes	0	267	0	267	Exchange-traded or centrally				
Sovereign Issues	0	38	0	38	cleared	(193)	(73)	0	(266)
Japan					Over the counter	0	(1,999)	0	(1,999)
Corporate Bonds & Notes	0	2,678	0	2,678		\$ (193)	\$ (2,072)	\$ 0	\$ (2,265)
Sovereign Issues	0	343	0	343	Totals	\$ 48	\$ 183,432	\$ 0	\$ 183,480
Luxembourg									
Corporate Bonds & Notes	0	89	0	89					
Malaysia									
Sovereign Issues	0	67	0	67					
Multinational									
Corporate Bonds & Notes	0	284	0	284					
Netherlands									
Corporate Bonds & Notes	0	552	0	552					
Mortgage-Backed Securities	0	98	0	98					
Norway									
Sovereign Issues	0	59	0	59					
Peru									
Sovereign Issues	0	293	0	293					
Qatar									
Corporate Bonds & Notes	0	236	0	236					
Sovereign Issues	0	199	0	199					
Romania									
Sovereign Issues	0	78	0	78					
Saudi Arabia									
Corporate Bonds & Notes	0	341	0	341					
Sovereign Issues	0	480	0	480					
Singapore									
Corporate Bonds & Notes	0	200	0	200					
Sovereign Issues	0	1,584	0	1,584					
South Korea									
Sovereign Issues	0	2,583	0	2,583					

There were no significant transfers into or out of Level 3 during the period ended June 30, 2022.

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	期騰落率	中騰落率	期騰落率	中騰落率			
第18期(2018年5月29日)	円 26,619	% △0.1	441.246	% 0.2	% 98.0	% 0.8	百万円 243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	2.1	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510.445	6.1	98.1	1.1	304,255
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509.621	△0.2	97.2	1.9	306,130

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2021年 5月31日	円 30,717	% －	510.445	% －	% 98.1	% 1.1
6月末	30,662	△0.2	508.662	△0.3	96.8	2.3
7月末	30,869	0.5	513.081	0.5	98.8	0.5
8月末	30,875	0.5	512.289	0.4	97.2	1.9
9月末	30,660	△0.2	508.953	△0.3	97.7	1.6
10月末	31,292	1.9	518.317	1.5	98.3	1.0
11月末	30,970	0.8	512.768	0.5	96.9	2.3
12月末	31,153	1.4	516.730	1.2	97.5	2.1
2022年 1月末	30,627	△0.3	507.460	△0.6	97.1	2.0
2月末	30,088	△2.0	500.360	△2.0	97.7	1.4
3月末	31,088	1.2	514.015	0.7	97.5	1.6
4月末	31,147	1.4	514.167	0.7	97.9	0.8
(当期末) 2022年 5月30日	30,737	0.1	509.621	△0.2	97.2	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

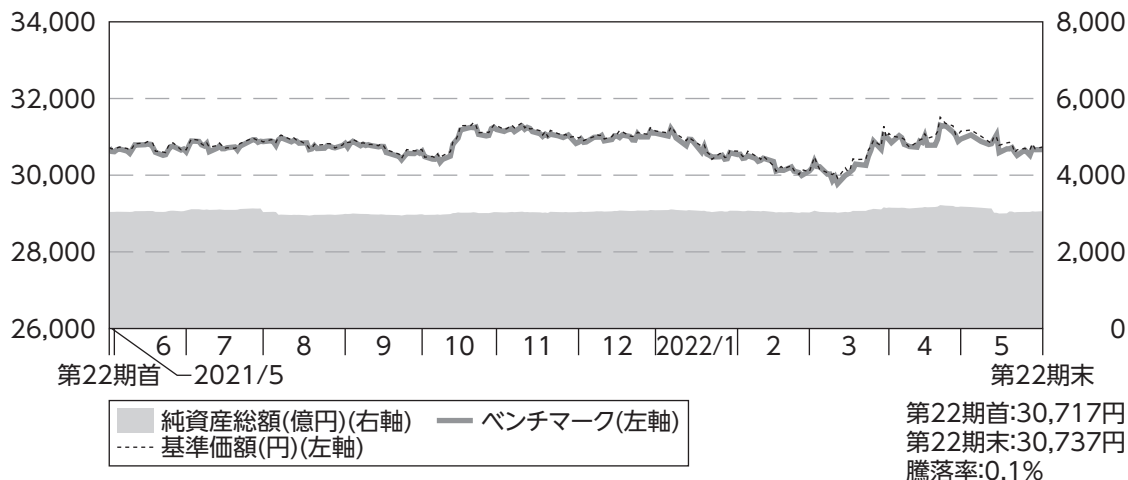
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2021年8月上旬にかけて、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬から10月上旬にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)で量的金融緩和の縮小開始が示唆されたことなどから主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬には、日本の貿易収支悪化懸念から円安の動きが加速し、基準価額は上昇しました。10月下旬から12月上旬は、主要国の長期金利が低下したものの円高となり、12月中旬から2022年1月上旬は、主要国の長期金利が上昇したものの円安となったことから、基準価額はレンジ内推移となりました。1月中旬から3月中旬にかけては米国で大幅利上げへの警戒感が高まったことから主要国の長期金利が上昇して基準価額は下落しましたが、3月下旬には日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから円売りが加速し、上昇しました。4月から5月上旬にかけて基準価額はレンジ内推移となり、以降は長期金利上昇と円安が一服したことから、緩やかに下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2021年12月上旬まで上下動しながらレンジ内での動きが続いていましたが、12月中旬以降は、米国で金融引き締めペースの加速見通しが強まったことや世界的にインフレ加速に対する警戒が続いたことから、概ね上昇推移となりました。

外国為替市場では、2022年3月上旬までは、円は主要通貨に対して円安傾向ながらレンジ内での展開が続いていましたが、3月中旬以降は、他の主要国の長期金利が大幅に上昇する中で日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことや資源価格高騰による日本の貿易収支悪化懸念から、主要通貨に対する円安が大幅に加速しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

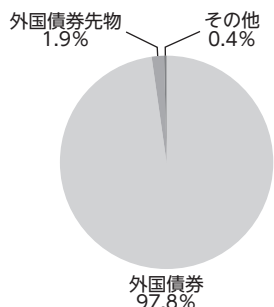
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.7%
2	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.6%
3	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 1.25% 09/30/28	アメリカ	0.5%
5	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
6	EURO-BUND 2206	ドイツ	0.5%

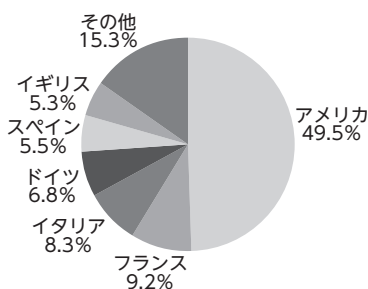
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/51	アメリカ	0.5%
9	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
10	T 0.25% 09/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		826	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

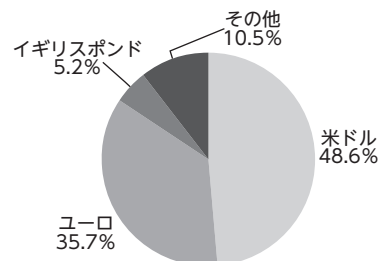
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

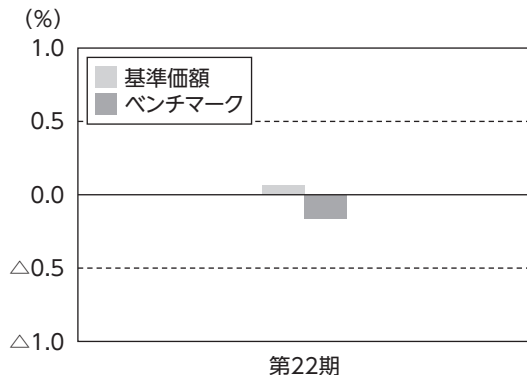


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	7	0.024	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(7)	(0.023)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	7	0.025	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(30,845円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期		
		買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 401,216	千米ドル 335,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 25,360	千カナダドル 26,202
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 60,029	千メキシコペソ 100,386
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 38,129	千ユーロ 42,369
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,105	39,020
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	33,494	38,246
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	8,355	8,221
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,711	24,064
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,598	7,602
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,311	7,046
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,437	2,880
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,390	3,773
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 13,005	千イギリスポンド 27,780
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,776	千スウェーデンクローナ 21,158
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 9,121	千ノルウェークローネ 6,550
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,764	千デンマーククローネ 20,425
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 10,602	千ポーランドズロチ 20,693
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 4,003	千オーストラリアドル 23,876
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,224	千シンガポールドル 4,350
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,698	千マレーシアリンギット 11,065
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 268,308	千オフショア人民元 -	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 16,105	千イスラエルシェケル 21,192	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 63,854	百万円 61,561	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 35,250	百万円 131	% 0.4	百万円 35,483	百万円 351	% 1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,117,914	30,860	2.8	1,116,764	30,326	2.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,234,970	千米ドル 1,161,808	千円 147,572,910	% 48.2	% —	% 21.4	% 17.1	% 9.7
カ ナ ダ	千カナダドル 64,950	千カナダドル 61,671	6,159,165	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 369,820	千メキシコペソ 355,118	2,306,634	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 142,510	千ユーロ 149,133	20,325,345	6.6	—	3.9	1.6	1.1
イ タ リ ア	180,290	181,990	24,803,426	8.1	—	4.7	2.2	1.2
フ ラ ン ス	195,640	201,735	27,494,486	9.0	—	5.4	2.5	1.1
オ ラ ン ダ	37,260	38,688	5,272,830	1.7	—	1.1	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,860	119,841	16,333,215	5.3	—	3.2	1.5	0.6
ベ ル ギ ー	43,490	45,243	6,166,301	2.0	—	1.5	0.5	0.1
オーストリア	28,260	28,531	3,888,520	1.3	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	12,390	11,847	1,614,662	0.5	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	15,570	15,302	2,085,579	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 93,140	千イギリスポンド 98,476	15,794,705	5.2	—	4.0	0.7	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 62,360	千スウェーデンクローナ 62,898	813,906	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 58,140	千ノルウェークローネ 56,123	752,049	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 62,040	千デンマーククローネ 65,222	1,194,873	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 51,380	千ポーランドズロチ 42,924	1,281,487	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 54,440	千オーストラリアドル 50,793	4,623,245	1.5	—	1.0	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 14,290	千シンガポールドル 14,083	1,307,226	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 50,920	千マレーシアリンギット 50,710	1,471,893	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中国オフショア	千オフショア人民元 266,140	千オフショア人民元 270,299	5,112,008	1.7	—	0.7	0.6	0.3
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,160	千イスラエルシェケル 31,896	1,209,741	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	297,584,217	97.2	—	51.4	29.9	15.9

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,651	1,225,966	2024/1/15
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,536	576,203	2024/2/15
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,366	935,755	2023/5/15
T 0.125% 05/31/23	0.125	6,800	6,670	847,254	2023/5/31
T 0.125% 07/31/23	0.125	5,000	4,885	620,611	2023/7/31
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	7,851	997,286	2023/9/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,774	987,501	2023/10/15
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,144	399,406	2023/12/15
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	12,517	1,589,982	2024/3/15
T 0.25% 05/15/24	0.25	10,000	9,583	1,217,233	2024/5/15
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	7,850	997,146	2023/6/15
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,603	1,092,808	2024/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	928	117,969	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,818	612,024	2025/7/31
T 0.25% 09/30/23	0.25	12,000	11,697	1,485,836	2023/9/30
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	6,919	878,894	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,314	421,065	2025/10/31
T 0.25% 11/15/23	0.25	11,000	10,687	1,357,541	2023/11/15
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,349	933,557	2026/1/31
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	6,736	855,693	2024/4/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,491	951,578	2025/4/30
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,618	1,094,693	2024/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,878	619,607	2027/7/31
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,771	606,073	2024/8/15
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,283	798,085	2024/9/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,059	896,721	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,767	351,557	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,683	467,830	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	10,593	1,345,640	2026/2/28
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,800	863,743	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,639	335,278	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,135	398,254	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	3,100	2,771	352,001	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,148	526,987	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,646	844,286	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	4,500	4,072	517,288	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	11,988	1,522,754	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,338	932,168	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	10,105	1,283,564	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,227	282,991	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	8,891	1,129,386	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,599	965,292	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,214	1,297,395	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,000	2,781	353,343	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,700	470,093	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	11,830	10,891	1,383,432	2026/8/31
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,388	1,319,517	2024/11/15
T 0.75% 12/31/23	0.75	3,370	3,288	417,732	2023/12/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,429	943,639	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,545	704,425	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,600	1,219,433	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,293	799,427	2028/7/31
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,689	976,664	2024/12/15
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,546	831,480	2025/1/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	13,192	1,675,681	2031/2/15

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	8,165	1,037,157	2025/2/28
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,302	927,563	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,236	157,099	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	7,300	5,245	666,313	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	10,210	9,242	1,173,924	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	4,726	600,338	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,333	931,532	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	8,650	5,721	726,702	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	8,000	7,326	930,619	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,500	8,685	1,103,272	2028/6/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,504	572,218	2023/7/31
T 1.25% 08/15/31	1.25	16,120	14,179	1,801,055	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	14,500	13,212	1,678,259	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,563	833,638	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,675	847,881	2026/12/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,872	491,884	2025/1/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,962	630,324	2023/6/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	6,767	859,617	2050/8/15
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,475	314,442	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	3,957	502,691	2023/9/30
T 1.375% 11/15/31	1.375	18,030	15,983	2,030,200	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	4,496	571,113	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,491	570,563	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,676	720,977	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,922	752,221	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	7,131	905,836	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,299	1,054,238	2024/9/30
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,928	880,010	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,787	989,194	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,177	276,587	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	11,150	10,170	1,291,906	2031/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	995	126,481	2023/5/31
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,263	795,626	2029/8/15
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,479	314,883	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,671	339,276	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	5,042	640,484	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	578,979	2026/11/30
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,680	467,504	2023/5/15
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,364	300,394	2024/6/30
T 1.75% 08/15/41	1.75	14,500	11,494	1,460,050	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,805	356,291	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	6,453	819,699	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	5,138	652,654	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,849	488,927	2027/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,019	637,576	2026/7/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,913	751,194	2024/8/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	9,300	7,243	920,111	2051/11/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,324	1,057,420	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,021	510,858	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,179	784,982	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,281	416,765	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,446	691,842	2024/6/30
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	6,747	857,014	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	15,150	12,151	1,543,541	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	9,897	1,257,171	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	5,700	4,717	599,234	2041/11/15
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,078	645,031	2024/2/29

外国債券インデックス マザーファンド ー第22期ー

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,363	935,321	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,364	300,370	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,519	447,108	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,763	605,004	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,952	629,071	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,674	339,715	2023/11/30
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	3,993	507,216	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,753	1,111,916	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,300	1,965	249,670	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,375	936,834	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	6,976	886,153	2024/4/30
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	5,598	711,121	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,338	1,059,125	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,510	445,895	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	4,687	595,401	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,252	794,255	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,067	1,278,828	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,335	550,744	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,451	946,499	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,496	571,121	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,352	679,933	2024/12/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	5,761	731,778	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,568	326,291	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,690	2,643	335,757	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,812	992,312	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	5,050	4,429	562,672	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,984	633,115	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	6,100	5,345	678,998	2049/11/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,477	441,766	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,984	633,164	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,710	1,506	191,360	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	3,524	447,705	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,909	1,004,692	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	4,447	564,927	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,570	580,514	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,677	594,118	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	13,340	13,213	1,678,428	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,251	921,038	2025/3/31
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	4,928	626,032	2023/6/30
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,518	446,905	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,807	737,610	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,019	383,493	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,544	831,298	2028/2/15
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	3,906	496,206	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,516	700,683	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,007	127,977	2023/7/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,211	153,876	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,754	476,893	2047/8/15
T 2.75% 08/31/23	2.75	1,500	1,511	191,947	2023/8/31
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,915	878,457	2025/8/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	2,320	2,336	296,838	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	3,920	3,646	463,141	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,834	359,989	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,025	511,295	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	7,297	926,920	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	3,934	499,746	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	5,388	684,452	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,845	488,438	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,496	698,107	2025/7/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,938	500,213	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	2,167	275,370	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,792	608,801	2023/9/30
T 2.875% 10/31/23	2.875	7,900	7,972	1,012,630	2023/10/31
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,363	300,233	2046/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,056	515,277	2023/11/30
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	7,544	958,306	2025/11/30
T 3% 02/15/47	3.0	800	774	98,376	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,346	552,035	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	5,000	4,942	627,855	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,576	200,226	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	2,500	2,406	305,666	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	3,108	394,865	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	5,346	679,116	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,243	538,985	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,050	641,475	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,694	342,463	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,043	1,043	132,295	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,974	250,824	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,948	755,641	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,071	517,153	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,564	1,087,890	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	1,741	221,190	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,083	391,649	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	5,587	709,758	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	826	104,949	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,555	324,544	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,130	270,631	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,172	275,990	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,256	413,688	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,611	204,683	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,055	134,118	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	2,731	346,979	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,191	151,391	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,254	286,306	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,298	291,905	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,960	3,516	446,622	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,312	166,715	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	664	84,378	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,053	260,807	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,689	214,576	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	928	117,949	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,390	176,271	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,489	189,230	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,345	297,923	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,897	240,977	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,694	215,259	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,313	166,828	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,732	220,021	2023/8/15
小 計				147,572,910	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,090	208,797	2026/3/1
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	2,400	2,303	230,069	2024/4/1
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,549	254,663	2023/5/1
CAN 0.25% 08/01/23	0.25	1,360	1,326	132,435	2023/8/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	2,480	2,320	231,717	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,590	2,145	214,263	2030/12/1
CAN 0.75% 02/01/24	0.75	1,300	1,262	126,121	2024/2/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	671	67,069	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	749	74,820	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,431	142,965	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,390	138,832	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	2,980	2,797	279,362	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,230	322,599	2030/6/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	490	480	47,982	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,060	105,892	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,304	130,316	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,565	356,125	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,172	117,143	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	4,170	3,724	371,926	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,830	1,431	142,965	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,263	126,165	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,290	1,199	119,834	2032/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	3,460	3,441	343,694	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,710	3,959	395,436	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,290	228,798	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,784	178,225	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,224	122,302	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,330	1,329	132,777	2024/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,650	1,626	162,468	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	760	743	74,253	2064/12/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,300	1,438	143,629	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,216	121,477	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	526	52,539	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,396	139,447	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	960	1,222	122,042	2033/6/1
小 計				6,159,165	
(メキシコ)					
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,578	62,216	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	31,259	203,043	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	3,700	3,345	21,731	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	12,500	10,952	71,137	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	47,710	43,077	279,804	2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	37,190	241,570	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	35,980	34,318	222,909	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,040	21,796	141,574	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	10,600	9,984	64,850	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	33,794	219,508	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	28,400	26,256	170,547	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	29,070	28,706	186,461	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	38,660	38,526	250,245	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,670	26,331	171,033	2038/11/18
小 計				2,306,634	
(ドイツ)					
国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 06/16/23	—	1,090	1,090	148,683	2023/6/16
BKO 0% 09/15/23	—	3,150	3,149	429,266	2023/9/15
BKO 0% 12/15/23	—	1,880	1,879	256,163	2023/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,470	2,319	316,192	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	3,120	2,891	394,094	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	2,790	2,542	346,559	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,260	1,954	266,411	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	3,380	2,880	392,523	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,248	579,018	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,306	450,612	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	4,190	3,911	533,085	2030/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
DBR 0% 08/15/30	—	670	626	85,386	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,450	3,172	432,368	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,420	3,142	428,307	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,260	868	118,378	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,960	2,851	388,612	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	2,500	2,383	324,806	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	3,825	521,362	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,080	2,977	405,849	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,553	347,986	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	3,089	421,053	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,998	408,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,680	3,636	495,603	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	1,940	1,922	262,046	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,029	276,606	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,640	3,704	504,613	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	3,631	494,871	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,065	417,794	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,345	319,728	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,695	231,015	2024/2/15
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	2,931	399,530	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,360	4,226	575,994	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,810	4,894	667,058	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,230	3,048	415,504	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,060	553,415	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,150	3,170	432,153	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,167	431,633	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,990	4,258	580,374	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,480	3,913	533,305	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,933	536,102	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,001	409,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,551	484,000	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,751	238,735	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,266	172,548	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	3,330	3,316	452,039	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	3,007	409,924	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,705	505,072	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	1,100	1,065	145,211	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,900	2,824	384,933	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	3,500	3,444	469,497	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,510	205,886	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,389	325,709	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	986	134,475	2024/1/15
BTPS 0% 01/30/24	—	940	927	126,384	2024/1/30
BTPS 0% 04/01/26	—	1,460	1,362	185,735	2026/4/1
BTPS 0% 04/15/24	—	3,000	2,944	401,338	2024/4/15
BTPS 0% 08/01/26	—	2,580	2,389	325,607	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,461	199,225	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	2,900	2,799	381,502	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,503	204,934	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	2,900	2,896	394,822	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	564	76,983	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,820	248,059	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,829	249,357	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	2,280	2,052	279,685	2028/7/15
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,114	151,838	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,599	354,231	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	670	671	91,483	2023/10/15

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,144	292,291	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,230	1,903	259,443	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	767	104,620	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,550	2,125	289,726	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,952	266,072	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,248	306,468	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,805	246,074	2031/12/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,898	258,799	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	1,773	241,708	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,700	1,400	190,940	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,296	312,937	2025/5/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,407	328,083	2024/11/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	913	124,460	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,412	328,751	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	2,812	383,301	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	2,713	369,837	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,337	318,565	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	1,190	162,262	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	1,012	137,978	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	2,260	1,816	247,545	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,450	2,489	339,326	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,723	371,224	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,246	306,111	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,116	288,415	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,741	373,572	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,236	441,104	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	524	71,506	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	920	713	97,258	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,303	314,003	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	1,672	227,938	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,522	343,851	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,810	1,532	208,806	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,910	2,984	406,721	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,035	413,703	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,037	413,988	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,210	2,023	275,803	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,130	984	134,236	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	3,190	3,289	448,325	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,012	274,222	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,483	474,823	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,407	191,790	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	1,967	268,213	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,820	1,885	256,989	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,195	299,171	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,246	578,745	2030/3/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,274	309,942	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,860	2,046	278,917	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	3,947	537,945	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	2,926	398,863	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,297	313,172	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,720	507,068	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	3,838	523,087	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	3,011	410,499	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,100	2,607	355,411	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,022	548,219	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	3,600	490,764	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,240	2,811	383,187	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,000	3,739	509,627	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,262	580,896	2029/11/1

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,881	392,692	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,940	3,714	506,243	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,432	604,159	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,726	235,326	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	895	122,005	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/24	—	4,850	4,832	658,613	2024/2/25
FRTR 0% 02/25/25	—	2,050	2,016	274,790	2025/2/25
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,067	690,629	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	3,560	3,413	465,192	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/24	—	3,750	3,730	508,414	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	6,390	6,286	856,845	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/32	—	1,970	1,701	231,957	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	4,815	656,351	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,412	737,604	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	4,990	4,370	595,606	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,566	621,011	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,571	759,369	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,690	6,617	901,859	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,131	699,336	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	3,160	2,497	340,363	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	505	68,870	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,980	1,474	200,979	2044/6/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,290	6,194	844,233	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,350	2,387	325,235	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	2,060	1,438	196,047	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,738	782,068	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,671	636,676	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,330	5,335	727,231	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,090	3,919	534,147	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	5,130	4,819	656,812	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,770	6,880	937,769	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,590	3,202	436,497	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,470	745,536	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	1,614	220,066	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,320	3,314	451,277	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,289	584,633	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	3,571	486,706	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,253	579,648	2024/5/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	7,180	7,899	1,076,653	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,110	5,600	763,251	2027/10/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,400	4,221	575,340	2045/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,050	5,589	761,736	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,420	3,507	478,066	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,030	3,029	412,822	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	4,437	604,738	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,650	5,980	815,070	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,520	6,363	867,346	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,630	4,942	673,618	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	6,685	911,164	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	6,135	836,189	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,241	305,512	2025/10/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/24	—	2,230	2,224	303,109	2024/1/15
NETHER 0% 01/15/26	—	790	770	104,999	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,774	241,871	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/29	—	1,390	1,300	177,218	2029/1/15

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
NETHER 0% 01/15/38	—	960	759	103,546	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,490	970	132,283	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,500	1,374	187,376	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,820	1,643	224,026	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,287	311,794	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,570	1,488	202,810	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,040	877	119,628	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,302	313,783	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	700	650	88,655	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,560	1,554	211,919	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,683	229,482	2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,540	1,571	214,222	2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,059	280,685	2024/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,263	308,452	2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,330	2,963	403,870	2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,250	3,096	422,045	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	2,900	395,254	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,170	295,792	2028/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,230	304,047	2025/1/31	
SPGB 0% 01/31/26	—	2,720	2,613	356,154	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	1,560	1,469	200,210	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	1,930	1,782	242,975	2028/1/31	
SPGB 0% 04/30/23	—	1,630	1,629	222,134	2023/4/30	
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,086	284,420	2024/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	3,180	2,721	370,974	2031/4/30	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,271	309,541	2024/7/30	
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,599	490,607	2023/7/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,400	3,105	423,196	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,960	1,717	234,012	2031/10/31	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,950	2,743	373,891	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,939	264,304	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,374	323,635	2027/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,172	159,733	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	650	498	67,899	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,470	1,665	227,027	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,260	1,831	249,547	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	2,927	398,928	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,750	2,768	377,327	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	3,070	3,067	418,033	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,570	3,559	485,163	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,672	364,295	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,055	416,405	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	411	56,085	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,677	364,946	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,113	424,401	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	2,625	357,890	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	900	740	100,897	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	2,899	395,210	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,990	2,024	275,852	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	2,922	398,309	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,501	340,954	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	1,886	257,131	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,050	3,202	436,468	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,200	2,338	318,655	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,780	1,991	271,421	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,677	364,950	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,135	427,272	2037/1/31	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	2,845	387,803	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,169	431,986	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,240	3,023	412,400	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,574	350,934	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,250	3,089	421,055	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,490	4,272	582,351	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,740	2,536	345,721	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,862	526,379	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,462	335,566	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,353	184,487	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	430	409	55,791	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,680	1,466	199,874	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,248	170,202	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,030	1,032	140,714	2023/10/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	480	426	58,155	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	1,240	940	128,203	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,621	220,984	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	342	46,726	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,680	2,694	367,273	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,682	229,337	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,260	1,245	169,796	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,560	1,535	209,208	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,301	313,277	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	2,770	2,680	365,374	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,465	199,771	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	610	502	68,507	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	755	102,910	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,240	1,114	151,856	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,300	1,176	160,368	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,048	142,941	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	780	767	104,661	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,180	1,208	164,661	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	784	106,922	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,239	305,170	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,180	160,866	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,566	213,503	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,331	181,434	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,870	2,509	342,065	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,305	177,978	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,290	3,149	429,296	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,507	478,014	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,450	1,311	178,783	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,640	1,453	198,110	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	914	124,622	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,120	1,120	152,760	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,440	1,430	194,985	2024/7/15	
RAGB 0% 10/20/40	—	670	477	65,042	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	486	66,246	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,693	230,836	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	1,071	146,024	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	440	266	36,307	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,210	1,193	162,608	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	592	80,727	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,076	282,958	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	330	167	22,880	2120/6/30	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	510	482	65,737	2032/2/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,070	1,090	148,558	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,030	972	132,483	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	216	29,530	2086/11/2	
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,020	139,049	2024/10/21	
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,361	185,616	2023/10/20	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	810	780	106,397	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,080	1,174	160,026	2034/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,044	142,336	2044/6/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	638	87,026	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,400	327,199	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,370	1,591	216,840	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,502	204,819	2027/7/15	
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB 0% 09/15/23	—	570	569	77,582	2023/9/15	
RFGB 0% 09/15/24	—	420	415	56,619	2024/9/15	
RFGB 0% 09/15/26	—	200	192	26,257	2026/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	800	717	97,809	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	330	265	36,172	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	285	38,851	2052/4/15	
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	540	480	65,442	2031/9/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	500	380	51,816	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	612	83,482	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	380	290	39,601	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	850	115,897	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	650	626	85,378	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	723	98,611	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	800	760	103,649	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	693	94,546	2025/9/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	560	529	72,134	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	455	62,015	2047/4/15	
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	752	102,588	2024/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	640	723	98,657	2042/7/4	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	606	82,648	2028/7/4	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	916	124,899	2025/7/4	
(アイルランド)						
国債証券						
IRISH 0% 10/18/31	—	850	741	101,012	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	899	122,598	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,090	991	135,187	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	416	56,710	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	610	516	70,411	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	500	392	53,537	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	690	684	93,284	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,640	1,658	225,992	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,196	163,018	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	651	88,836	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	810	811	110,627	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	708	96,504	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	815	111,099	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,150	1,158	157,891	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,319	179,838	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,024	139,621	2024/3/18	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,316	179,406	2025/3/13	
ユーロ計				107,984,367		
(イギリス)						
国債証券						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,520	1,446	232,005	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	3,300	3,227	517,637	2024/1/31	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,077	333,232	2028/1/31	
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,110	1,072	172,015	2025/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	3,270	2,821	452,574	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,910	1,811	290,494	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,157	345,999	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,020	940	150,856	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	782	125,467	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,659	266,102	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,810	2,319	372,094	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	880	594	95,393	2050/10/22	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,360	2,343	375,912	2023/7/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,170	881	141,444	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	510	452	72,628	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,601	256,897	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	400	366	58,847	2032/1/31	
UKT 1% 04/22/24	1.0	800	793	127,299	2024/4/22	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	500	424	68,100	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	520	381	61,202	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	935	150,052	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	830	663	106,431	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,373	380,645	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,599	256,534	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,370	2,044	327,887	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	420	358	57,481	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,620	1,621	260,081	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	1,633	261,968	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,480	1,313	210,615	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,183	189,749	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,210	2,003	322,159	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,630	2,478	397,600	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,809	290,170	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,524	404,952	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,510	1,710	274,281	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,736	278,580	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,180	2,556	410,003	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,290	2,799	448,953	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	2,770	444,331	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,155	345,782	2052/7/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,306	370,019	2060/1/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	2,051	329,096	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,544	408,190	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,620	2,097	336,401	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,559	250,103	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,750	2,288	367,079	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,920	2,651	425,243	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,143	343,724	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,910	2,871	460,485	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,860	2,348	376,707	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,210	3,037	487,197	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,804	289,353	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,238	359,052	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,300	2,515	403,517	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,584	254,059	2028/12/7	
小計				15,794,705		
(スウェーデン)						
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	6,470	5,738	74,256	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,800	7,481	96,809	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,560	7,168	92,763	2029/11/12	

当		期		末		
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)		
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,440	8,283	107,188	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	12,561	162,539	2023/11/13	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	4,980	5,328	68,955	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,300	9,582	124,002	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,310	6,753	87,389	2039/3/30	
小計				813,906		
(ノルウェー)		千ノルウェー	千ノルウェー			
国債証券		クローネ	クローネ			
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,590	3,176	42,568	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	6,480	5,878	78,770	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,670	4,501	60,319	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,680	4,512	60,461	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,720	5,612	75,204	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	6,340	5,972	80,036	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,020	4,855	65,064	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	10,660	10,679	143,105	2023/5/24	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,220	3,070	41,150	2032/5/18	
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,760	7,863	105,368	2024/3/14	
小計				752,049		
(デンマーク)		千デンマーク	千デンマーク			
国債証券		クローネ	クローネ			
DGB 0% 11/15/24	—	2,550	2,514	46,062	2024/11/15	
DGB 0% 11/15/31	—	5,830	5,165	94,629	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	6,050	4,231	77,524	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	8,850	8,612	157,790	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,410	11,853	217,149	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,550	7,699	141,057	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,510	5,697	104,381	2025/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	13,290	19,447	356,278	2039/11/15	
小計				1,194,873		
(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						
POLGB 0% 07/25/24	—	2,160	1,885	56,302	2024/7/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,850	2,165	64,655	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,039	90,752	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,759	82,368	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	650	423	12,645	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,586	107,059	2024/10/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,550	3,309	98,809	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,860	5,830	174,057	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	3,088	92,207	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	5,750	4,663	139,231	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,220	4,815	143,768	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,910	4,449	132,840	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,410	2,334	69,697	2023/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	572	17,091	2029/4/25	
小計				1,281,487		
(オーストラリア)		千オーストラリア	千オーストラリア			
国債証券		ドル	ドル			
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	3,430	3,234	294,440	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,138	194,682	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,040	1,838	167,315	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,250	2,659	242,112	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,360	1,969	179,243	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,272	206,870	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	2,756	250,935	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,760	1,176	107,084	2051/6/21	

当		期		末		
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)		
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,910	2,516	229,039	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,140	1,088	99,065	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,520	3,348	304,761	2030/5/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,388	126,365	2024/4/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,439	131,056	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,050	978	89,060	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,901	173,056	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,624	147,849	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,410	1,370	124,753	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,508	137,324	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,000	970	88,342	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,560	2,593	236,058	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,200	2,215	201,615	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,077	98,062	2039/6/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,672	152,268	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,890	1,982	180,422	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,310	2,565	233,478	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,504	227,979	2027/4/21	
小計				4,623,245		
(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						
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	750	704	65,351	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	530	503	46,761	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	650	598	55,534	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	810	691	64,180	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	275	25,547	2051/10/1	
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	409	37,964	2024/2/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,080	1,068	99,135	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	890	839	77,942	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	730	730	67,828	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	408	37,926	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	530	533	49,496	2028/5/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	760	760	70,558	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	626	58,188	2042/4/1	
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	620	624	57,980	2023/7/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	662	61,514	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	1,200	1,224	113,641	2030/9/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,590	1,614	149,890	2024/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	886	82,296	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	920	85,487	2027/3/1	
小計				1,307,226		
(マレーシア)		千マレーシア	千マレーシア			
国債証券		リンギット	リンギット			
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,510	1,349	39,156	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	1,920	1,925	55,877	2024/6/14	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,490	43,267	2027/5/31	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,870	2,852	82,799	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,520	1,369	39,760	2040/5/22	
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	942	27,350	2023/8/17	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,180	1,119	32,496	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,670	1,601	46,485	2033/4/15	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,041	30,230	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,489	43,239	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,135	32,964	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,987	57,691	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,120	2,135	61,997	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	605	17,564	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	3,120	3,156	91,610	2025/9/15	

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,780	1,806	52,428	2024/9/30
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	2,340	2,095	60,809	2050/6/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,280	1,300	37,741	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	3,000	3,014	87,493	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	2,030	1,984	57,609	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,500	2,565	74,470	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,860	2,945	85,484	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,770	1,824	52,967	2033/11/7
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,480	1,468	42,618	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,280	2,355	68,354	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	2,310	2,392	69,440	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,680	1,699	49,323	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,030	1,056	30,659	2043/9/30
小計				1,471,893	
(中国オフショア)		千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	29,520	29,240	553,007	2025/4/9
CGB 2.28% 03/17/24	2.28	9,700	9,720	183,830	2024/3/17
CGB 2.47% 09/02/24	2.47	18,980	19,083	360,906	2024/9/2
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	9,000	9,001	170,240	2027/4/15
CGB 2.56% 10/21/23	2.56	30,440	30,628	579,262	2023/10/21
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	22,480	22,308	421,898	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	17,240	17,391	328,905	2026/8/12
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	7,900	7,946	150,287	2029/3/24
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	11,650	11,793	223,043	2024/4/8
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	12,330	12,512	236,648	2027/6/4
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	5,510	5,562	105,208	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	10,280	10,419	197,053	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	7,230	7,378	139,539	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	6,850	6,971	131,841	2031/5/27
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	26,760	27,345	517,164	2026/3/11
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,120	134,656	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	5,410	5,614	106,182	2027/12/3
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	5,520	5,614	106,179	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	2,950	3,092	58,487	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	2,390	2,577	48,753	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	7,460	8,164	154,413	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,580	6,141	116,143	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	4,110	4,671	88,351	2048/10/22
小計				5,112,008	
(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					
ILGOV 0.15% 07/31/23	0.15	840	829	31,474	2023/7/31
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	1,210	1,166	44,236	2024/10/31
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	860	809	30,692	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,316	87,848	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	2,830	2,549	96,708	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	280	250	9,482	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,190	1,807	68,565	2037/5/31
ILGOV 1.5% 11/30/23	1.5	2,230	2,241	85,009	2023/11/30
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,240	1,236	46,902	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	2,750	2,725	103,382	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,010	2,004	76,018	2028/9/28
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	4,080	4,231	160,473	2024/3/31
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	3,130	3,391	128,622	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,030	2,755	104,494	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	3,060	3,581	135,829	2026/10/30
小計				1,209,741	
合計				297,584,217	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		当期末	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外国	EURO-SCHATZ	496	—
	US 5YR NOTE	1,065	—
	EURO-BOBL FU	781	—
	EURO-BUND	1,613	—
	US 10YR NOTE	869	—
	US LONG BOND	912	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 297,584,217	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,619,511	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	306,203,728	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(300,593,413千円)の投資信託財産総額(306,203,728千円)に対する比率は98.2%です。

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

1米ドル=127.02円

1ユーロ=136.29円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=91.02円

1オフショア人民元=18.9124円

1カナダドル=99.87円

1イギリスポンド=160.39円

1デンマーククローネ=18.32円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

1メキシコペソ=6.4954円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ポーランドズロチ=29.8545円

1マレーシアリンギット=29.0252円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年5月30日現在
(A)資 産	312,166,419,317円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,231,147,162
公 社 債(評価額)	297,584,217,256
未 収 入 金	5,975,913,184
未 収 利 息	1,602,999,713
前 払 費 用	68,788,346
差 入 委 託 証 拠 金	703,353,656
(B)負 債	6,035,903,620
未 払 金	6,013,434,102
未 払 解 約 金	22,464,619
未 払 利 息	4,899
(C)純 資 産 総 額(A-B)	306,130,515,697
元 本	99,597,188,643
次 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(D)受 益 権 総 口 数	99,597,188,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,737円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	5,588,602,464円
受 取 利 息	5,591,422,848
そ の 他 収 益 金	85,970
支 払 利 息	△2,906,354
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,919,550,310
売 買 益	28,346,868,449
売 買 損	△33,266,418,759
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△355,314,134
取 引 益	228,024,368
取 引 損	△583,338,502
(D)そ の 他 費 用	△78,636,127
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	235,101,893
(F)前 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	37,399,000,336
(H)解 約 差 損 益 金	△36,304,804,877
(I) 計 (E+F+G+H)	206,533,327,054
次 期 繰 越 損 益 金(I)	206,533,327,054

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

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は99,051,563,319円、期中追加設定元本額は17,957,103,019円、期中一部解約元本額は17,411,477,695円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	15,588,874,755円
世界経済インデックスファンド	13,705,517,215円
DC世界経済インデックスファンド	12,670,772,916円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,035,294,676円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,187,835,347円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,001,557,866円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,526,946,203円
DC外国債券インデックス・オープン	2,299,774,574円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,173,342,834円
DCマイセレクション25	1,953,384,106円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,763,244,024円
DCマイセレクション50	1,676,561,671円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,322,110,043円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,316,783,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,312,521,937円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,174,457,124円
DCマイセレクション75	1,141,290,393円
DCマイセレクションS25	934,868,709円
グローバル経済コア	843,868,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,139,958円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	737,949,757円
DCマイセレクションS50	736,631,684円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,286,117円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	600,790,052円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	569,673,405円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	545,698,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(切替型)	537,685,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	501,882,298円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	449,635,006円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	445,614,258円
DCマイセレクションS75	414,158,205円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	387,700,518円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	344,318,886円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,732,727円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	311,958,664円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	305,209,636円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	283,459,403円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン	250,909,160円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,415,573円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	211,302,672円
SMT インデックスバランス・オープン	196,612,068円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	169,275,387円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,549,248円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	102,644,337円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	92,308,746円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	82,452,091円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	75,911,463円

バランス25VA2(適格機関投資家専用)	73,784,318円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	71,940,031円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	70,266,398円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	53,860,232円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	47,930,499円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,411,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,403,026円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,157,130円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,454,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	13,381,571円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,541,025円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,653,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,114,094円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,968,437円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,146,398円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,811,153円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,650,011円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,324,475円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,718円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2022年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年12月11日から無期限です。
運用方針	新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	新興国の債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
	期騰	中落率	期騰	中落率					
	円	%		%	%	%	%	百万円	
第10期(2018年11月12日)	16,292	△4.6	30,698.89	△4.7	95.9	—	—	45,550	
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	53,734	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	61,667	
第13期(2021年11月10日)	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—	—	79,131	
第14期(2022年11月10日)	18,499	4.7	35,702.58	5.0	97.0	—	—	88,174	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	騰	落率	騰	落率		
(当期首) 2021年11月10日	円	%		%	%	%
	17,665	—	34,005.46	—	97.1	—
11月末	17,071	△3.4	32,777.10	△3.6	96.0	—
12月末	17,534	△0.7	33,749.85	△0.8	95.8	—
2022年 1月末	17,513	△0.9	33,673.33	△1.0	95.7	—
2月末	17,311	△2.0	33,817.04	△0.6	96.6	—
3月末	17,543	△0.7	33,782.77	△0.7	95.7	—
4月末	17,385	△1.6	33,306.37	△2.1	97.2	—
5月末	17,589	△0.4	33,884.38	△0.4	94.6	—
6月末	17,878	1.2	34,445.35	1.3	94.6	—
7月末	17,536	△0.7	33,692.82	△0.9	95.8	—
8月末	18,095	2.4	34,986.65	2.9	95.9	—
9月末	17,904	1.4	34,492.17	1.4	96.0	—
10月末	18,340	3.8	35,377.32	4.0	96.5	—
(当期末) 2022年11月10日	円	%		%	%	%
	18,499	4.7	35,702.58	5.0	97.0	—

(注1)騰落率は期首比です。

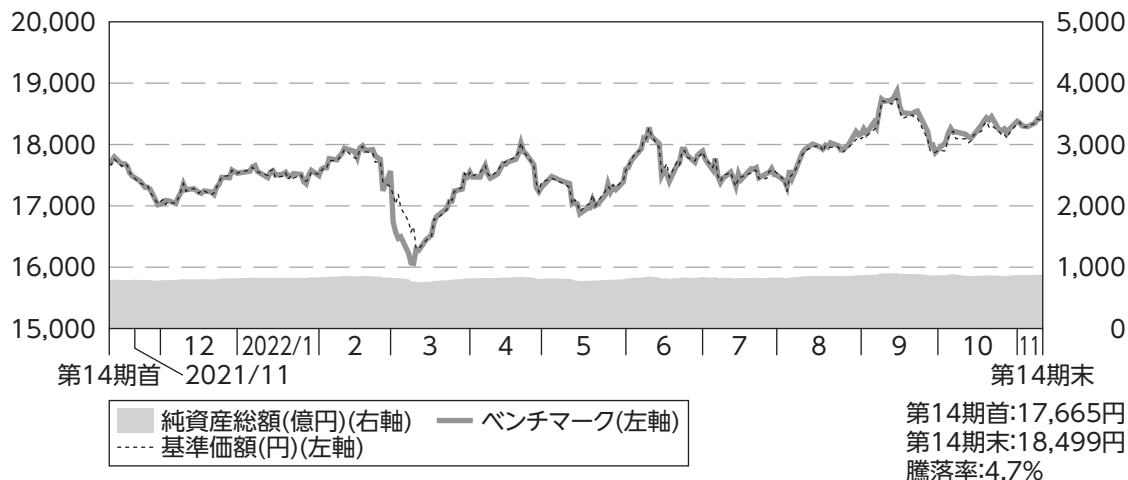
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)です。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドとは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

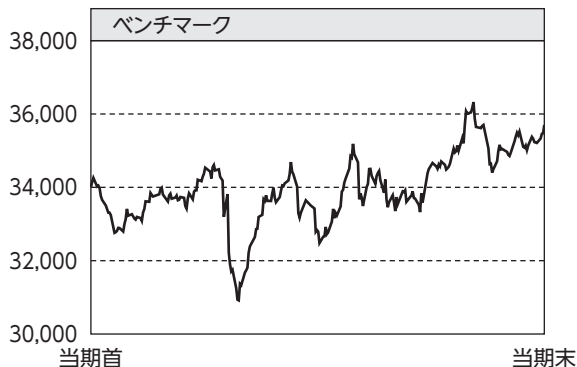


(注)ベンチマークは、2021年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2022年2月中旬にかけて、新興国金利が緩やかながらも上昇(債券価格は下落)基調で推移したものの、インフレへの警戒感が意識される中、外国為替市場で新興国通貨が対円で堅調に推移したことから、基準価額はレンジ内推移となりました。2月下旬から3月上旬にかけては、ウクライナ情勢の深刻化を受けたリスク回避の動きから、新興国通貨が対円で下落するとともに新興国金利が大幅に上昇し、基準価額は下落しました。3月中旬以降6月上旬にかけて、欧米の中央銀行が利上げペースを加速させる中、多くの新興国でもインフレ抑制と通貨防衛の観点から中央銀行による積極的な利上げが継続された一方で、日銀が現行の金融緩和策の維持を決定したことから新興国通貨に対して円安の動きとなり、基準価額は上昇しました。基準価額は、7月末にかけてもみ合い推移となった後、8月から9月中旬にかけては、再び円安の動きが対新興国通貨に波及し、上昇しました。その後9月下旬にかけて、新興国金利が上昇して基準価額は下落しましたが、10月以降は、再び円売り新興国通貨買いの動きが優勢となり、上昇しました。

投資環境



新興国為替市場では、ウクライナ情勢の深刻化を受けたリスク回避の動きから新興国通貨が対円で下落する局面もありましたが、欧米の中央銀行が利上げペースを加速させる中、多くの新興国でもインフレ抑制と通貨防衛の観点から中央銀行による積極的な利上げが継続された一方で、日銀が現行の金融緩和策の維持を継続したことから、新興国通貨は対円で概ね上昇推移となりました。

新興国債券市場では、新興国内でのインフレ圧力の高まりや欧米先進国の大幅利上げを背景に多くの新興国の中央銀行が利上げを継続して実施した影響により、新興国金利は上昇推移が続きました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

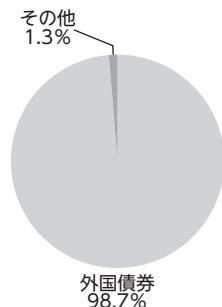
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	2.9%
2	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	2.0%
3	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.9%
4	BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	1.6%
5	SAGB 8% 01/31/30	南アフリカ	1.5%
6	MBONO 5.75% 03/05/26	メキシコ	1.3%

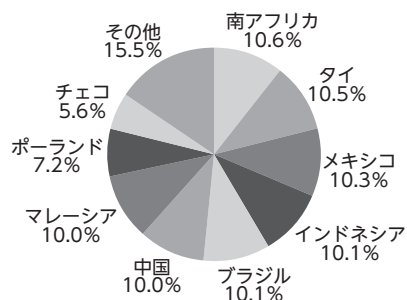
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	BNTNF 10% 01/01/27	ブラジル	1.3%
8	MBONO 7.75% 05/29/31	メキシコ	1.2%
9	SAGB 8.75% 02/28/48	南アフリカ	1.2%
10	MBONO 8% 09/05/24	メキシコ	1.1%
組入銘柄数		238	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

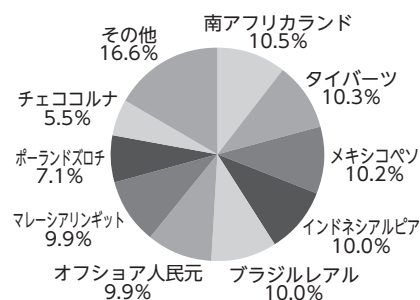
○資産別配分



○国別配分



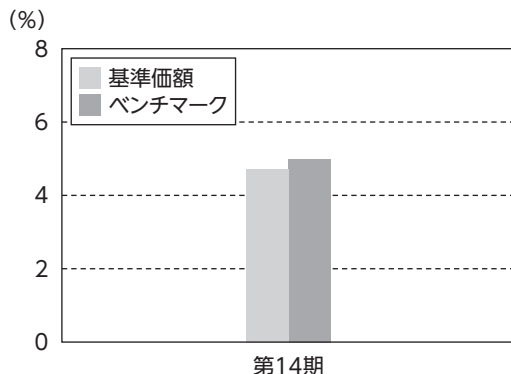
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

ベンチマークとの乖離の主なマイナス要因は、為替評価差要因*等です。

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

今後の運用方針

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月1日~2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	20 (20) (-) (0)	0.116 (0.114) (-) (0.002)	(c) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	20	0.116	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(17,641円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 312,989	千メキシコペソ 363,627
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 122,660	千ブラジルリアル 160,354
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 2,402,467	千チリペソ 1,918,167
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 44,813,785	千コロンビアペソ 12,761,189
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルー・ソル 12,311	千ペルー・ソル 5,180
	ウ ル グ ア イ	国 債 証 券	千ウルグアイペソ 4,520	千ウルグアイペソ -
	ド ミ ニ カ 共 和 国	国 債 証 券	千ドミニカペソ -	千ドミニカペソ 20,169
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 7,918	千トルコリラ 104,161
	チ ェ コ	国 債 証 券	千チェココルナ 290,463	千チェココルナ 86,646
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 2,130,026	千ハンガリーフォリント 956,678
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 63,146	千ポーランドズロチ 39,128
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 298,800	千ロシアルーブル 290,749
	ル ー マ ニ ア	国 債 証 券	千ルーマニア・レイ 129,265	千ルーマニア・レイ 19,214
	国	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングgit 135,111
タ イ		国 債 証 券	千タイバーツ 928,460	千タイバーツ 563,101
フ ィ リ ピ ン		国 債 証 券	千フィリピンペソ -	千フィリピンペソ 14,655
イ ン ド ネ シ ア		国 債 証 券	千インドネシアルピア 272,892,980	千インドネシアルピア 270,266,030
中 国 オ フ シ ョ ア		国 債 証 券	千オフショア人民元 95,541	千オフショア人民元 122,818
南 ア フ リ カ		国 債 証 券	千南アフリカランド 391,239	千南アフリカランド 84,210

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	0.057391 百万円	0.057391 百万円	100.0	0.057391 百万円	0.057391 百万円	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	234,315	14,462	6.2	234,620	14,432	6.2

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	末		
		評 価 額				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 1,269,950	千メキシコペソ 1,159,300	千円 8,679,568	% 9.8	% —	% 4.6	% 3.4	% 1.8
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 353,000	千ブラジルレアル 307,548	8,656,903	9.8	9.8	1.3	3.7	4.9
チ リ	千チリペソ 12,530,000	千チリペソ 11,703,060	1,888,370	2.1	—	1.3	0.8	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 148,800,000	千コロンビアペソ 109,247,331	3,263,982	3.7	—	1.3	2.4	—
ペ ル ー	千ペルー・ソル 63,850	千ペルー・ソル 58,962	2,206,507	2.5	—	2.1	0.3	0.2
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 42,000	千ウルグアイペソ 36,357	132,510	0.2	—	0.2	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 33,000	千ドミニカペソ 31,548	84,973	0.1	0.1	—	0.1	—
チ ェ コ	千チェココルナ 952,900	千チェココルナ 799,175	4,819,590	5.5	—	2.9	1.9	0.6
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 9,962,000	千ハンガリーフォリント 7,086,787	2,586,698	2.9	—	1.2	1.1	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 247,800	千ポーランドズロチ 199,993	6,221,849	7.1	—	2.0	3.4	1.7
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 116,700	千ルーマニア・レイ 100,168	3,007,581	3.4	—	1.1	1.5	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 290,100	千マレーシアリンギット 277,550	8,634,218	9.8	—	5.4	2.8	1.6
タイ	千タイバーツ 2,320,300	千タイバーツ 2,275,985	9,012,904	10.2	—	5.5	3.3	1.5
フィリピン	千フィリピンペソ 30,000	千フィリピンペソ 26,877	67,822	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 920,700,000	千インドネシアルピア 921,002,670	8,657,425	9.8	—	6.4	2.3	1.1
中国オフショア	千オフショア人民元 418,500	千オフショア人民元 428,700	8,632,363	9.8	—	4.7	3.1	1.9
南アフリカ	千南アフリカランド 1,311,200	千南アフリカランド 1,093,299	9,008,790	10.2	10.2	8.4	1.9	—
合 計	—	—	85,562,061	97.0	20.1	48.5	32.0	16.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(メキシコ)						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBONO 10% 11/20/36	10.0	31,800	32,425	242,768		2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	104,250	104,107	779,440		2024/12/5
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	46,000	39,393	294,931		2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	175,300	155,731	1,165,944		2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	114,000	105,402	789,135		2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	158,100	141,075	1,056,220		2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	84,500	69,245	518,432		2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	13,600	11,762	88,066		2034/11/23
MBONO 8% 07/31/53	8.0	12,000	9,928	74,335		2053/7/31
MBONO 8% 09/05/24	8.0	128,400	123,754	926,537		2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	100,600	83,872	627,943		2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	88,000	85,701	641,638		2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	115,100	108,993	816,026		2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	98,300	87,906	658,148		2038/11/18
小計				8,679,568		
(ブラジル)						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/24	—	104,100	90,606	2,550,398		2024/1/1
BLTN 0% 01/01/26	—	24,500	17,127	482,110		2026/1/1
BLTN 0% 07/01/23	—	53,300	49,141	1,383,244		2023/7/1
BLTN 0% 07/01/24	—	13,850	11,446	322,185		2024/7/1
BLTN 0% 07/01/25	—	38,900	28,853	812,176		2025/7/1
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	31,800	30,632	862,238		2025/1/1
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	41,200	38,668	1,088,439		2027/1/1
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	26,700	24,291	683,772		2029/1/1
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	13,850	12,352	347,692		2031/1/1
BNTNF 10% 01/01/33	10.0	1,500	1,310	36,878		2033/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,317	37,092		2028/1/10
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	1,800	50,673		2024/1/5
小計				8,656,903		
(チリ)						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
BTPCL 2.3% 10/01/28	2.3	805,000	659,189	106,364		2028/10/1
BTPCL 2.5% 03/01/25	2.5	2,985,000	2,726,903	440,004		2025/3/1
BTPCL 4.5% 03/01/26	4.5	1,920,000	1,814,322	292,753		2026/3/1
BTPCL 4.7% 09/01/30	4.7	2,160,000	1,997,711	322,344		2030/9/1
BTPCL 5% 03/01/35	5.0	2,210,000	2,051,390	331,006		2035/3/1
BTPCL 5% 10/01/28	5.0	660,000	628,115	101,350		2028/10/1
BTPCL 6% 01/01/43	6.0	1,790,000	1,825,426	294,545		2043/1/1
小計				1,888,370		
(コロンビア)						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	65,300,000	55,708,736	1,664,409		2027/6/28
COLTES 6.25% 11/26/25	6.25	18,000,000	14,892,480	444,942		2025/11/26
COLTES 7.25% 10/18/34	7.25	40,100,000	25,043,653	748,229		2034/10/18
COLTES 7.25% 10/26/50	7.25	25,400,000	13,602,462	406,400		2050/10/26
小計				3,263,982		

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(ペルー)						
国債証券		千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
PERUG 5.35% 08/12/40	5.35	4,500	3,432	128,444		2040/8/12
PERUG 5.4% 08/12/34	5.4	6,350	5,204	194,758		2034/8/12
PERUG 5.7% 08/12/24	5.7	3,700	3,638	136,160		2024/8/12
PERUG 5.94% 02/12/29	5.94	9,500	8,832	330,530		2029/2/12
PERUG 6.15% 08/12/32	6.15	8,300	7,438	278,371		2032/8/12
PERUG 6.35% 08/12/28	6.35	8,350	7,993	299,131		2028/8/12
PERUG 6.9% 08/12/37	6.9	8,250	7,558	282,847		2037/8/12
PERUG 6.95% 08/12/31	6.95	8,350	8,016	299,996		2031/8/12
PERUG 8.2% 08/12/26	8.2	6,550	6,848	256,266		2026/8/12
小計				2,206,507		
(ウルグアイ)						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
URUGUA 8.25% 05/21/31	8.25	25,000	21,117	76,965		2031/5/21
URUGUA 8.5% 03/15/28	8.5	17,000	15,240	55,544		2028/3/15
小計				132,510		
(ドミニカ共和国)						
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
DOMREP 9.75% 06/05/26	9.75	33,000	31,548	84,973		2026/6/5
(チェコ)						
国債証券		千チェココロンナ	千チェココロンナ			
CZGB 0% 12/12/24	—	24,000	21,331	128,643		2024/12/12
CZGB 0.05% 11/29/29	0.05	26,100	17,965	108,345		2029/11/29
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	69,200	55,150	332,595		2027/2/10
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	47,000	44,335	267,371		2023/10/25
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	68,900	50,179	302,619		2030/5/15
CZGB 1% 06/26/26	1.0	62,800	53,188	320,763		2026/6/26
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	57,000	41,226	248,627		2031/3/13
CZGB 1.25% 02/14/25	1.25	58,500	52,834	318,631		2025/2/14
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	22,700	13,046	78,681		2040/4/24
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	51,500	37,787	227,882		2032/6/23
CZGB 2% 10/13/33	2.0	64,500	46,930	283,021		2033/10/13
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	62,700	57,108	344,403		2025/9/17
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	63,300	53,763	324,233		2028/8/25
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	80,500	68,150	410,995		2029/7/23
CZGB 3.5% 05/30/35	3.5	22,000	18,395	110,939		2035/5/30
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	34,500	30,796	185,723		2036/12/4
CZGB 5% 09/30/30	5.0	20,000	19,373	116,832		2030/9/30
CZGB 5.5% 12/12/28	5.5	33,000	32,835	198,020		2028/12/12
CZGB 5.7% 05/25/24	5.7	45,200	45,030	271,568		2024/5/25
CZGB 6% 02/26/26	6.0	39,500	39,744	239,689		2026/2/26
小計				4,819,590		
(ハンガリー)						
国債証券		千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
HGB 1% 11/26/25	1.0	635,000	475,913	173,709		2025/11/26
HGB 1.5% 04/22/26	1.5	610,500	444,028	162,071		2026/4/22
HGB 1.5% 08/23/23	1.5	222,500	206,484	75,367		2023/8/23
HGB 1.5% 08/26/26	1.5	514,000	363,480	132,671		2026/8/26

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
HGB 2% 05/23/29	2.0	403,000	253,148	92,399	2029/5/23	
HGB 2.25% 04/20/33	2.25	712,000	378,136	138,020	2033/4/20	
HGB 2.25% 06/22/34	2.25	256,000	130,662	47,692	2034/6/22	
HGB 2.5% 10/24/24	2.5	548,000	457,804	167,100	2024/10/24	
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	580,500	422,145	154,084	2026/12/22	
HGB 3% 04/25/41	3.0	371,000	172,856	63,093	2041/4/25	
HGB 3% 06/26/24	3.0	402,500	349,225	127,468	2024/6/26	
HGB 3% 08/21/30	3.0	615,000	392,240	143,169	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	592,000	420,639	153,534	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	380,000	188,176	68,684	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	812,000	509,018	185,793	2031/10/22	
HGB 4.5% 03/23/28	4.5	300,000	224,856	82,073	2028/3/23	
HGB 4.75% 11/24/32	4.75	300,000	205,638	75,058	2032/11/24	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	660,000	564,511	206,048	2025/6/24	
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	476,000	446,340	162,915	2023/11/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	572,000	481,481	175,742	2028/10/22	
小計				2,586,698		
(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						
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	18,500	13,829	430,243	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	14,300	12,152	378,073	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	18,700	11,734	365,054	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	17,400	10,654	331,475	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	17,950	16,234	505,059	2024/10/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	19,800	18,482	575,006	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	24,100	19,987	621,809	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	17,600	13,979	434,916	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	20,600	16,156	502,628	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	26,100	19,324	601,203	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	25,350	22,694	706,017	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	14,700	12,433	386,810	2027/5/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	12,700	12,328	383,550	2023/10/25	
小計				6,221,849		
(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						
ROMGB 2.5% 10/25/27	2.5	3,000	2,259	67,842	2027/10/25	
ROMGB 3.25% 04/29/24	3.25	1,200	1,120	33,642	2024/4/29	
ROMGB 3.25% 06/24/26	3.25	8,000	6,656	199,869	2026/6/24	
ROMGB 3.65% 07/28/25	3.65	12,600	11,087	332,896	2025/7/28	
ROMGB 3.65% 09/24/31	3.65	6,000	4,138	124,259	2031/9/24	
ROMGB 3.7% 11/25/24	3.7	10,000	9,123	273,940	2024/11/25	
ROMGB 4% 10/25/23	4.0	14,900	14,381	431,811	2023/10/25	
ROMGB 4.15% 01/26/28	4.15	10,500	8,499	255,197	2028/1/26	
ROMGB 4.15% 10/24/30	4.15	6,400	4,722	141,795	2030/10/24	
ROMGB 4.25% 06/28/23	4.25	5,100	4,987	149,761	2023/6/28	
ROMGB 4.5% 06/17/24	4.5	2,200	2,075	62,327	2024/6/17	
ROMGB 4.75% 02/24/25	4.75	3,200	2,939	88,263	2025/2/24	
ROMGB 4.75% 10/11/34	4.75	4,500	3,141	94,313	2034/10/11	
ROMGB 4.85% 04/22/26	4.85	4,700	4,159	124,879	2026/4/22	
ROMGB 4.85% 07/25/29	4.85	2,800	2,250	67,559	2029/7/25	
ROMGB 5% 02/12/29	5.0	6,000	4,917	147,653	2029/2/12	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ROMGB 5.8% 07/26/27	5.8	10,100	8,946	268,628	2027/7/26	
ROMGB 6.7% 02/25/32	6.7	5,500	4,760	142,939	2032/2/25	
小計				3,007,581		
(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						
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	27,300	23,726	738,113	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	9,650	9,638	299,840	2024/6/14	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	18,650	18,069	562,126	2027/5/31	
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	8,500	7,903	245,852	2032/7/15	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	19,000	18,362	571,245	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	18,350	15,833	492,546	2040/5/22	
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	7,100	7,139	222,092	2023/8/17	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	8,200	7,558	235,122	2034/7/5	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	6,100	6,092	189,532	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	20,300	19,604	609,856	2029/8/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	10,300	10,134	315,266	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	14,450	14,302	444,916	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	17,100	16,959	527,584	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	23,000	22,994	715,340	2025/9/15	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	19,550	19,693	612,643	2024/9/30	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	14,450	12,396	385,647	2050/6/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	9,100	9,181	285,636	2024/7/15	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	20,050	19,076	593,432	2035/5/31	
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	3,200	3,214	99,992	2029/4/30	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	6,200	6,045	188,063	2042/10/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	9,550	9,623	299,368	2037/4/7	
小計				8,634,218		
(タイ)		千タイバーツ	千タイバーツ			
国債証券						
THAIGB 0.75% 06/17/24	0.75	102,500	101,111	400,400	2024/6/17	
THAIGB 0.95% 06/17/25	0.95	142,200	138,986	550,385	2025/6/17	
THAIGB 1% 06/17/27	1.0	176,000	164,945	653,183	2027/6/17	
THAIGB 1.45% 12/17/24	1.45	197,000	195,640	774,737	2024/12/17	
THAIGB 1.585% 12/17/35	1.585	59,800	48,865	193,507	2035/12/17	
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	65,100	53,590	212,217	2035/6/17	
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	99,100	92,007	364,349	2029/12/17	
THAIGB 2% 06/17/42	2.0	78,600	59,320	234,911	2042/6/17	
THAIGB 2% 12/17/31	2.0	31,000	28,716	113,718	2031/12/17	
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	113,600	112,585	445,838	2026/12/17	
THAIGB 2.4% 12/17/23	2.4	123,000	124,448	492,817	2023/12/17	
THAIGB 2.875% 06/17/46	2.875	90,100	74,405	294,645	2046/6/17	
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	111,000	112,361	444,953	2028/12/17	
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	122,700	118,196	468,059	2038/6/17	
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	129,200	127,479	504,817	2036/6/17	
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	99,000	100,458	397,814	2023/6/16	
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	175,500	185,461	734,427	2031/6/20	
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	180,000	191,820	759,609	2032/6/25	
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	105,400	111,536	441,684	2025/12/12	
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	119,500	134,046	530,825	2029/6/22	
小計				9,012,904		

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(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					
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	26,877	67,822	2036/1/14
(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					
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	8,610,861	80,942	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	7,500,000	8,286,900	77,896	2025/9/15
INDOGB 5.125% 04/15/27	5.125	44,000,000	40,709,680	382,670	2027/4/15
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	36,500,000	34,843,995	327,533	2026/4/15
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	16,000,000	15,151,520	142,424	2028/5/15
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	17,800,000	16,109,890	151,432	2036/6/15
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	51,000,000	47,793,120	449,255	2032/4/15
INDOGB 6.375% 07/15/37	6.375	16,100,000	15,112,909	142,061	2037/7/15
INDOGB 6.375% 08/15/28	6.375	20,000,000	19,174,400	180,239	2028/8/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	62,500,000	58,990,625	554,511	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	50,000,000	49,691,000	467,095	2025/6/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	20,000,000	18,740,400	176,159	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	40,800,000	40,527,048	380,954	2027/5/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	43,000,000	42,012,720	394,919	2030/9/15
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	31,300,000	31,036,767	291,745	2042/6/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	34,000,000	33,765,060	317,391	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	19,700,000	19,627,110	184,494	2038/5/15
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	34,700,000	34,641,010	325,625	2035/6/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	18,400,000	18,472,864	173,644	2032/8/15
INDOGB 8.125% 05/15/24	8.125	46,800,000	47,854,872	449,835	2024/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	31,200,000	32,606,496	306,501	2029/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	36,000,000	37,882,080	356,091	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	13,400,000	14,065,176	132,212	2032/6/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	53,600,000	54,804,928	515,166	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	44,000,000	46,653,200	438,540	2034/3/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	21,200,000	22,551,076	211,980	2039/4/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	40,100,000	41,816,280	393,073	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	23,700,000	25,543,860	240,112	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	28,700,000	31,057,705	291,942	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	12,869,118	120,969	2031/7/15
小計				8,657,425	
(中国オフショア)		千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	13,600	13,519	272,221	2025/4/9
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	10,200	10,172	204,841	2025/8/25
CGB 2.26% 02/24/25	2.26	3,000	3,005	60,515	2025/2/24
CGB 2.36% 07/02/23	2.36	8,000	8,028	161,660	2023/7/2
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	5,400	5,400	108,745	2027/4/15
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	6,000	6,003	120,891	2027/7/25
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	6,400	6,350	127,880	2032/9/1
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	27,300	27,212	547,950	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	10,000	10,101	203,412	2026/8/12
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	7,700	7,696	154,975	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	6,500	6,524	131,374	2029/6/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	12,000	12,093	243,505	2029/3/24
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	11,700	11,848	238,586	2024/4/8

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	18,400	18,692	376,387	2027/6/4
CGB 2.88% 11/05/23	2.88	6,900	6,971	140,385	2023/11/5
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	8,000	8,095	163,010	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	6,000	6,101	122,857	2028/10/14
CGB 2.94% 10/17/24	2.94	23,000	23,390	470,998	2024/10/17
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	15,000	15,354	309,175	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	8,500	8,697	175,137	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	12,900	13,179	265,374	2025/10/22
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	7,500	7,677	154,590	2026/3/11
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	20,000	20,563	414,070	2026/12/5
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	15,300	15,769	317,540	2029/11/21
CGB 3.19% 04/11/24	3.19	24,100	24,561	494,582	2024/4/11
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	5,600	5,759	115,964	2025/12/6
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	22,000	22,716	457,422	2026/6/6
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	10,300	10,700	215,469	2028/11/22
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	22,000	23,013	463,394	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	9,700	10,079	202,970	2027/12/3
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	14,200	14,817	298,376	2029/5/23
CGB 3.29% 10/18/23	3.29	10,000	10,150	204,387	2023/10/18
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	7,500	8,016	161,418	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	7,300	8,026	161,617	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	16,500	18,408	370,666	2050/9/14
小計				8,632,363	
(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					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	189,400	199,637	1,645,009	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	72,200	47,163	388,630	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	64,100	40,069	330,173	2041/2/28
SAGB 7% 02/28/31	7.0	75,700	59,993	494,342	2031/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	182,600	159,869	1,317,328	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	129,000	108,710	895,777	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	113,700	90,111	742,521	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	116,000	90,751	747,791	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	158,200	123,462	1,017,330	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	110,000	92,184	759,599	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	100,300	81,345	670,285	2040/1/31
小計				9,008,790	
合計				85,562,061	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 85,562,061	% 97.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,678,804	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	88,240,865	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(87,999,447千円)の投資信託財産総額(88,240,865千円)に対する比率は99.7%です。

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

1米ドル=146.41円	1メキシコペソ=7.4869円	1ブラジルリアル=28.1481円
1チリペソ=0.161357円	1コロンビアペソ=0.029877円	1ペルー・ソル=37.422円
1ウルグアイペソ=3.6446円	1ドミニカペソ=2.6934円	1ユーロ=146.66円
1チェココナ=6.0307円	1ハンガリーフォリント=0.365003円	1ポーランドズロチ=31.1102円
1ルーマニア・レイ=30.0252円	1マレーシアリンギット=31.1086円	1タイバーツ=3.96円
1フィリピンペソ=2.5234円	1インドネシアルピア=0.0094円	1オフショア人民元=20.1361円
1南アフリカランド=8.24円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年11月10日現在
(A)資 産	88,240,865,650円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,217,560,706
公 社 債(評価額)	85,562,061,713
未 収 利 息	1,353,239,033
前 払 費 用	108,004,198
(B)負 債	66,448,893
未 払 解 約 金	66,448,348
未 払 利 息	545
(C)純 資 産 総 額(A-B)	88,174,416,757
元 本	47,663,305,590
次 期 繰 越 損 益 金	40,511,111,167
(D)受 益 権 総 口 数	47,663,305,590口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,499円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日
(A)配 当 等 収 益	4,995,213,140円
受 取 利 息	4,995,719,399
そ の 他 収 益 金	51,042
支 払 利 息	△557,301
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,050,808,955
売 買 益	13,585,818,352
売 買 損	△14,636,627,307
(C)そ の 他 費 用	△98,972,233
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	3,845,431,952
(E)前 期 繰 越 損 益 金	34,335,351,861
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	7,191,685,832
(G)解 約 差 損 益 金	△4,861,358,478
(H) 計 (D+E+F+G)	40,511,111,167
次 期 繰 越 損 益 金(H)	40,511,111,167

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換によるものを含みます。

(注2) (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3) (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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は44,796,605,697円、期中追加設定元本額は9,491,259,965円、期中一部解約元本額は6,624,560,072円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

世界経済インデックスファンド	13,623,240,711円
DC世界経済インデックスファンド	11,511,812,974円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,247,443,705円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,205,574,648円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,668,677,646円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,942,180,440円
グローバル経済コア	748,562,508円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	748,141,408円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	500,045,638円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	491,248,452円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	464,021,590円
SMT 世界経済インデックス・オープン	372,459,099円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	274,886,771円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	273,471,389円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	258,840,573円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	250,720,521円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	246,972,169円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	210,199,620円
コア投資戦略ファンド(成長型)	181,683,363円
SMT インデックスバランス・オープン	168,796,465円
私専世界経済バシブファンド(適格機関投資家専用)	136,997,450円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	94,217,538円
コア投資戦略ファンド(切替型)	81,053,946円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	43,180,163円
コア投資戦略ファンド(安定型)	35,878,977円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	34,524,277円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	30,592,816円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	27,692,488円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	19,402,087円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	11,990,059円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,291,954円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,220,880円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	9,921,305円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	6,301,210円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,982,340円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	3,565,644円
10資産分散投資ファンド	13,984円

お知らせ

該当事項はありません。

マネープールマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2022年11月21日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2010年2月26日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等にも投資します。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
第 9 期 (2018年11月20日)	円 10,032	% △0.1	% —	% —	百万円 577,044
第10期 (2019年11月20日)	10,024	△0.1	—	—	544,455
第11期 (2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	486,701
第12期 (2021年11月22日)	10,015	△0.0	—	—	358,814
第13期 (2022年11月21日)	10,011	△0.0	—	—	371,933

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
	騰 落	率		
(当 期 首) 2021年11月22日	円 10,015	% —	% —	% —
11月末	10,015	0.0	—	—
12月末	10,015	0.0	—	—
2022年 1月末	10,014	△0.0	—	—
2月末	10,014	△0.0	—	—
3月末	10,014	△0.0	—	—
4月末	10,014	△0.0	—	—
5月末	10,014	△0.0	—	—
6月末	10,013	△0.0	—	—
7月末	10,013	△0.0	—	—
8月末	10,013	△0.0	—	—
9月末	10,012	△0.0	—	—
10月末	10,012	△0.0	—	—
(当 期 末) 2022年11月21日	10,011	△0.0	—	—

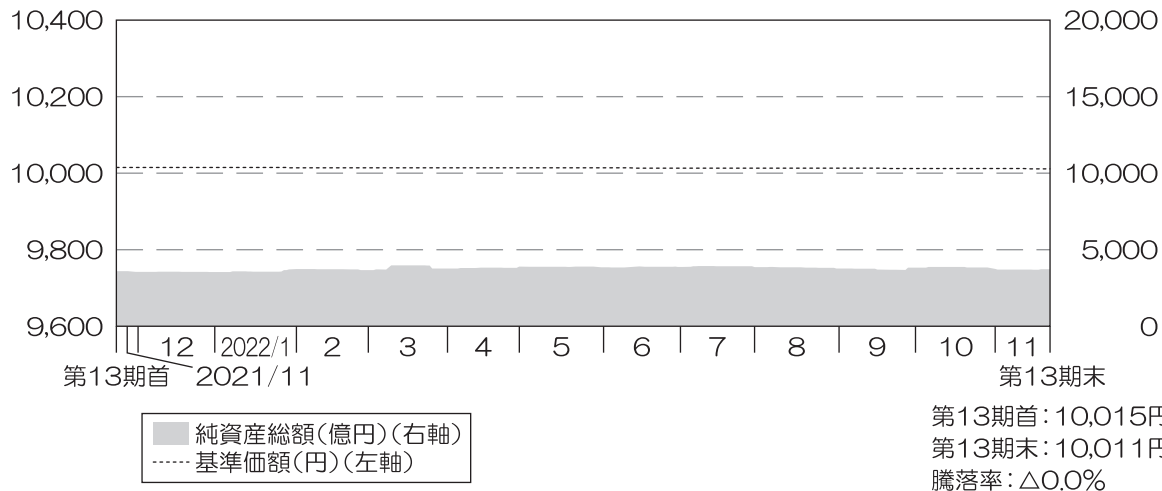
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

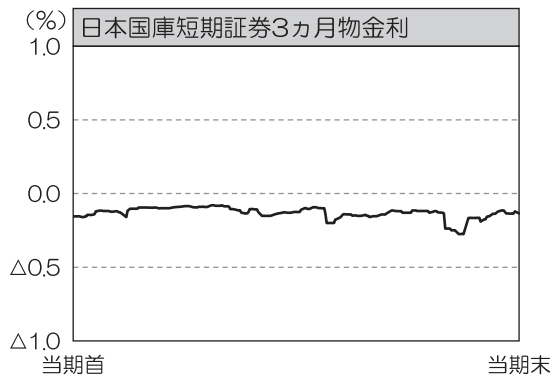
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09\sim 0\%$ 近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

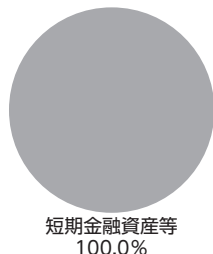
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

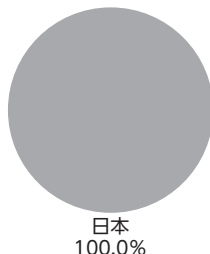
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

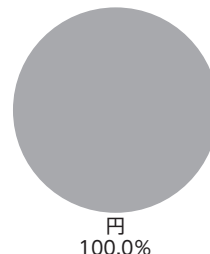
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主としてわが国の公社債を投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。ポートフォリオにつきましては、金利動向やマーケット環境を踏まえながら、債券組入比率の向上を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月23日～2022年11月21日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,013円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コール・ローン	91,846,878	6,401,770	7.0	91,833,999	6,401,770	7.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 371,934,952	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	371,934,952	100.0

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2022年11月21日現在
(A) 資産	371,934,952,946円
コール・ローン等	371,934,952,946
(B) 負債	1,497,555
未払解約金	544,709
未払利息	952,764
その他未払費用	82
(C) 純資産総額(A-B)	371,933,455,391
元本	371,514,353,891
次期繰越損益金	419,101,500
(D) 受益権総口数	371,514,353,891口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,011円

■損益の状況

項目	当期 自2021年11月23日 至2022年11月21日
(A) 配当等収益	△150,256,731円
受取利息	1,724,564
支払利息	△151,981,295
(B) その他費用	△82
(C) 当期損益金(A+B)	△150,256,813
(D) 前期繰越損益金	549,315,622
(E) 追加信託差損益金	155,678,449
(F) 解約差損益金	△135,635,758
(G) 計(C+D+E+F)	419,101,500
次期繰越損益金(G)	419,101,500

(注1) (E)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2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は358,265,002,227円、期中追加設定元本額は114,656,558,826円、期中一部解約元本額は101,407,207,162円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	103,275,806,469円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	97,023,993,837円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	40,913,946,872円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	30,921,835,681円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	23,295,546,510円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	21,404,228,793円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	15,577,844,099円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	4,267,283,000円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	4,138,099,571円
北米株配当戦略投信2018-11 (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	3,905,313,624円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
225ベアファンド9 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	3,382,622,913円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,616,273,059円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,331,276,690円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	1,057,375,332円
米国株価指数レバレッジ戦略ファンド (米国国債リスクコントロール型) (適格機関投資家専用)	99,396,417円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	299,461円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円

債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210, 100円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105, 486円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99, 941円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49, 791円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19, 911円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9, 983円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9, 983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9, 983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9, 979円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9, 972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9, 972円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9, 970円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9, 970円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9, 970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9, 963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9, 963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 962円
GARSファンド	9, 961円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9, 961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9, 961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9, 961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9, 961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9, 961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (ブラジル・リアルコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (円コース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (メキシコ・ペソコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (トルコ・リラコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (米ドルコース)	9, 960円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9, 957円
債券コア・セクション	9, 956円
国内株式SMTBセクション (SMA専用)	9, 953円
債券コア戦略ファンド	9, 953円
外国債券SMTBセクション (SMA専用)	9, 952円
外国株式SMTBセクション (SMA専用)	9, 951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9, 951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9, 950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9, 950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4, 989円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4, 985円
バンクローン・オープン (ユーロコース) (SMA専用)	1, 993円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (毎月決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (毎月決算型)	1, 991円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1, 990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1, 990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1, 990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (豪ドルコース)	988円

お知らせ

該当事項はありません。