

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	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	外国債券インデックスe	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 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。	

外国債券インデックスe

運用報告書(全体版)

第14期(決算日 2024年2月7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。)

【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			ベンチマーク		債券組入率	債券先比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
第10期(2020年2月7日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
第11期(2021年2月8日)	14,274	0	6.0	477.531	6.8	97.3	1.3	1.3	3,221
第12期(2022年2月7日)	14,758	0	3.4	496.296	3.9	97.6	1.5	1.5	2,912
第13期(2023年2月7日)	14,955	0	1.3	505.817	1.9	97.9	1.4	1.4	2,805
第14期(2023年2月7日)	14,783	0	△1.2	503.924	△0.4	98.2	0.8	0.8	2,708
第14期(2024年2月7日)	16,696	0	12.9	571.679	13.4	98.4	0.5	0.5	2,867

(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		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2023年 2月7日	14,783	—	503.924	—	98.2	0.8
2月末	14,819	0.2	503.372	△0.1	97.8	1.2
3月末	15,000	1.5	507.635	0.7	98.2	0.7
4月末	15,103	2.2	513.970	2.0	98.4	0.6
5月末	15,486	4.8	527.860	4.7	98.3	0.5
6月末	16,096	8.9	548.017	8.8	98.0	0.9
7月末	15,743	6.5	534.743	6.1	98.1	0.8
8月末	16,164	9.3	550.428	9.2	98.2	0.6
9月末	15,918	7.7	542.874	7.7	98.2	0.6
10月末	15,892	7.5	541.404	7.4	98.1	0.6
11月末	16,441	11.2	563.373	11.8	98.3	0.4
12月末	16,453	11.3	559.659	11.1	98.4	0.4
2024年 1月末	16,736	13.2	573.726	13.9	98.1	0.5
(当期末)						
2024年 2月7日	16,696	12.9	571.679	13.4	98.4	0.5

(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。

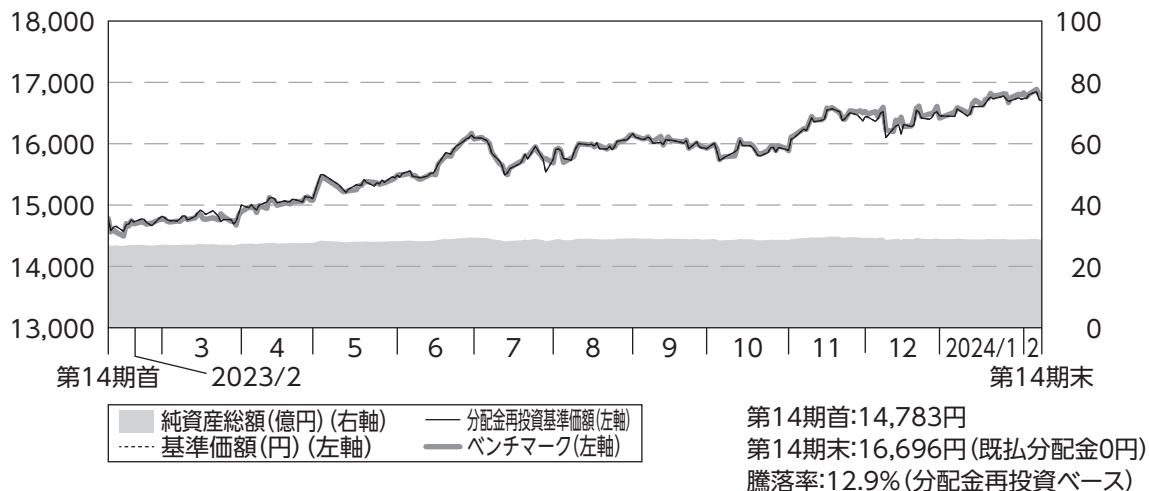
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

【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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

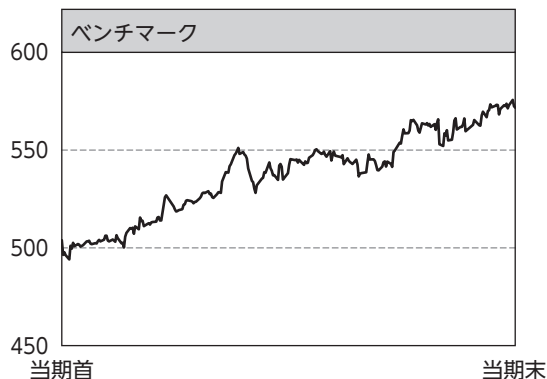


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2023年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月下旬にかけて、堅調な米経済指標やインフレ圧力を受けて、FRB(米連邦準備理事会)が政策金利を長期的に高水準に維持するとの見方が広がったことから、大幅に上昇推移となりました。11月以降は、労働需給の軟化やインフレ鈍化を示す指標が続き、米国の利上げ局面の終了が意識されたことから、上昇幅を縮小しました。

外国為替市場では、2023年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に概ね円安推移となりました。その後は、主要国の長期金利低下を背景に日本と欧米の長期金利差が縮小したことから円買戻しの流れとなり、円は下落率を縮小しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、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。

【「外国債券マザーファンド」の運用経過】

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。キャッシュ部分はヘッジ目的で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。

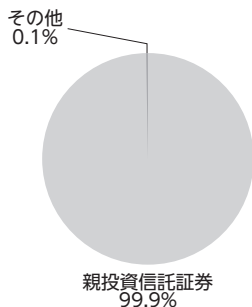
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

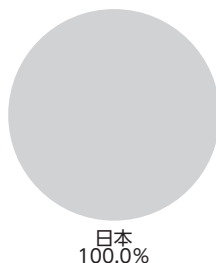
	当期末
	2024年2月7日
外国債券マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

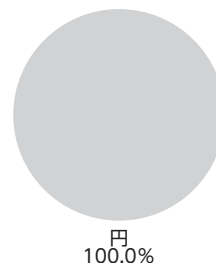
○資産別配分



○国別配分



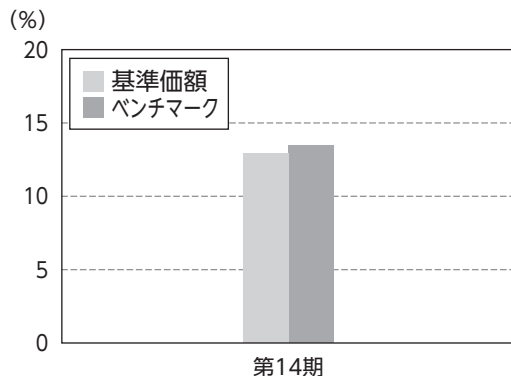
○通貨別配分



(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(分配金込み)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、信託報酬(マイナス要因)等です。

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14期	
	2023年2月8日～2024年2月7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)	7,242	

(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

公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと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
	(2023年2月8日～2024年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	87円	0.550%	(a) 信託報酬 = $\frac{[\text{期中の平均基準価額}] \times \text{信託報酬率}}{[\text{期中の平均基準価額}]}$ 期中の平均基準価額は15,820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。
(投信会社)	(33)	(0.209)	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
(販売会社)	(47)	(0.297)	
(受託会社)	(7)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(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)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(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	4	0.022	(d) 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)	(3)	(0.017)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・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
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	91	0.572	

(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。

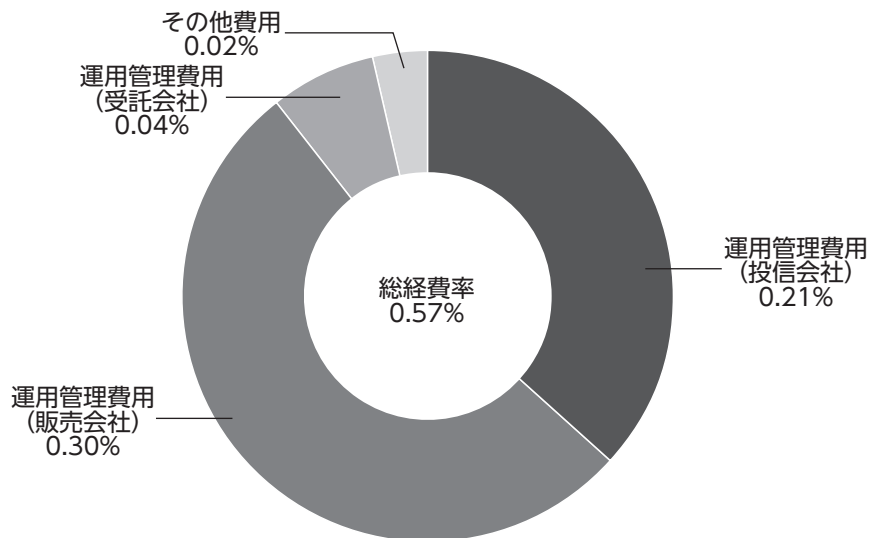
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

<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0.57%です。



(注1)各費用は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)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

<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
外国債券マザーファンド	千口 11,779	千円 32,243	千口 81,867	千円 234,593

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	百万円 0.053507	百万円 0.053507	% 100.0	百万円 0.053507	百万円 0.053507	% 100.0
コール・ローン	1,453	135	9.3	1,452	136	9.4

(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。

<外国債券マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 23,668	百万円 23,668	% 100.0	百万円 24,224	百万円 24,224	% 100.0
為替直物取引	13,024	12,946	99.4	8,644	8,541	98.8
金 銭 信 託	10	10	100.0	10	10	100.0
コール・ローン	267,973	25,593	9.6	268,332	25,770	9.6

<平均保有割合 1.7%>

(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

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 1,033,375	千口 963,287	千円 2,865,875

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、59,041,902千口です。

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	2,865,875	99.5
コール・ローン等、その他	14,642	0.5
投資信託財産総額	2,880,517	100.0

(注1)外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(174,717,408千円)の投資信託財産総額(175,759,776千円)に対する比率は99.4%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=147.88円	1カナダドル=109.63円	1メキシコペソ=8.6851円
1ユーロ=159.12円	1イギリスポンド=186.34円	1スウェーデンクローナ=14.08円
1ノルウェークローネ=13.97円	1デンマーククローネ=21.33円	1ポーランドズロチ=36.5867円
1オーストラリアドル=96.54円	1ニュージーランドドル=90.18円	1シンガポールドル=110.05円
1マレーシアリングギット=31.0522円	1オフショア人民元=20.5449円	1イスラエルシェケル=40.5878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 2024年2月7日現在
(A) 資 産	2,880,517,254円
コール・ローン等	10,105,905
外国債券マザーファンド(評価額)	2,865,875,668
未 収 入 金	4,535,681
(B) 負 債	13,205,956
未 払 解 約 金	5,096,588
未 払 信 託 報 酬	8,029,140
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	80,227
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,867,311,298
元 本	1,717,396,379
次 期 繰 越 損 益 金	1,149,914,919
(D) 受 益 権 総 口 数	1,717,396,379口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,696円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年2月8日 至 2024年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	△2,178円
受 取 利 息	17
支 払 利 息	△2,195
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	337,858,068
売 買 益	362,337,556
売 買 損	△24,479,488
(C) 信 託 報 酬 等	△15,793,390
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	322,062,500
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	240,036,043
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	587,816,376
(配 当 等 相 当 額)	(681,559,030)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△93,742,654)
(G) 計	1,149,914,919
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,149,914,919
追 加 信 託 差 損 益 金	587,816,376
(配 当 等 相 当 額)	(681,733,517)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△93,917,141)
分 配 準 備 積 立 金	562,098,543

(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せん。

(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1,831,886,214円、期中追加設定元本額は74,462,255円、期中一部解約元本額は188,952,090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)	60,244,779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)	88,870,219円
(C) 収益調整金額	681,733,517円
(D) 分配準備積立金額	412,983,545円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,243,832,060円
(F) 期末残存口数	1,717,396,379口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	7,242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

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2023年11月8日)

外国債券マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2024年2月7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2001年2月22日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指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	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、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		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第19期(2020年2月7日)	24,866	6.6	477,531	6.8	97.4	1.3	141,275
第20期(2021年2月8日)	25,857	4.0	496,296	3.9	97.7	1.5	144,346
第21期(2022年2月7日)	26,350	1.9	505,817	1.9	97.9	1.4	150,121
第22期(2023年2月7日)	26,193	△0.6	503,924	△0.4	98.3	0.8	151,005
第23期(2024年2月7日)	29,751	13.6	571,679	13.4	98.4	0.5	175,654

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2023年 2月7日	26,193	—	503,924	—	98.3	0.8
2月末	26,266	0.3	503,372	△0.1	97.8	1.2
3月末	26,598	1.5	507,635	0.7	98.2	0.7
4月末	26,793	2.3	513,970	2.0	98.4	0.6
5月末	27,487	4.9	527,860	4.7	98.3	0.5
6月末	28,584	9.1	548,017	8.8	98.1	0.9
7月末	27,969	6.8	534,743	6.1	98.1	0.8
8月末	28,732	9.7	550,428	9.2	98.3	0.6
9月末	28,307	8.1	542,874	7.7	98.2	0.6
10月末	28,275	7.9	541,404	7.4	98.1	0.6
11月末	29,265	11.7	563,373	11.8	98.3	0.4
12月末	29,299	11.9	559,659	11.1	98.4	0.4
2024年 1月末	29,820	13.8	573,726	13.9	98.2	0.5
(当期末) 2024年 2月7日	29,751	13.6	571,679	13.4	98.4	0.5

(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。

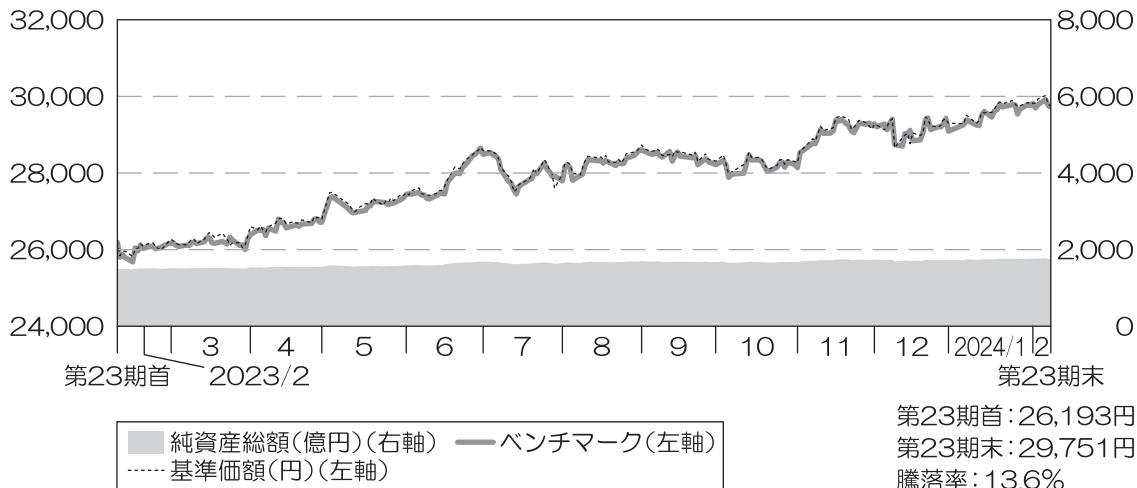
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

【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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

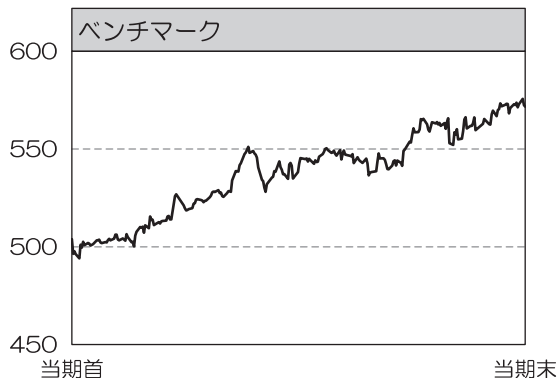


(注)ベンチマークは、2023年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月下旬にかけて、堅調な米経済指標やインフレ圧力を受けて、FRB(米連邦準備理事会)が政策金利を長期的に高水準に維持するとの見方が広がったことから、大幅に上昇推移となりました。11月以降は、労働需給の軟化やインフレ鈍化を示す指標が続き、米国の利上げ局面の終了が意識されたことから、上昇幅を縮小しました。

外国為替市場では、2023年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に概ね円安推移となりました。その後は、主要国の長期金利低下を背景に日本と欧米の長期金利差が縮小したことから円買戻しの流れとなり、円は下落率を縮小しました。

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。キャッシュ部分はヘッジ目的で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

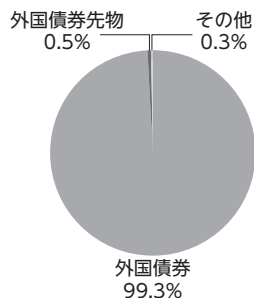
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.8%
2	T 2.875% 08/15/28	アメリカ	0.8%
3	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	0.7%
4	T 0.375% 04/30/25	アメリカ	0.6%
5	CGB 1.99% 04/09/25	中国	0.6%
6	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.6%

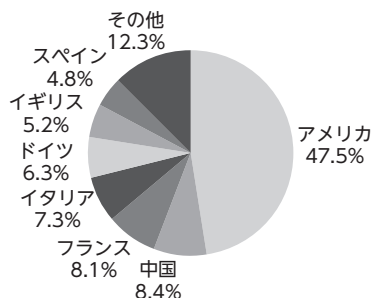
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 3.125% 11/15/28	アメリカ	0.6%
8	T 1.25% 04/30/28	アメリカ	0.6%
9	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
10	T 1.125% 10/31/26	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		856	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

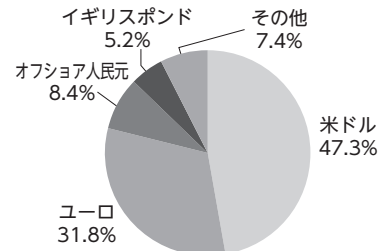
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

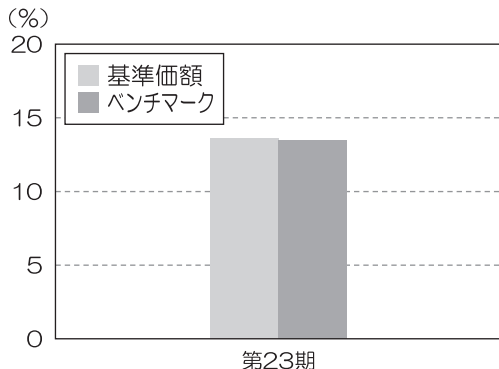


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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0.5%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^(※)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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと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
	(2023年2月8日～2024年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	$(a) \text{ 売買委託手数料} = \frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	$(b) \text{ 有価証券取引税} = \frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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	5	0.017	$(c) \text{ その他費用} = \frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(5)	(0.017)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.017	

(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(28,116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 133,792	千米ドル 130,290
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 11,067	千カナダドル 10,412
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 39,352	千メキシコペソ 41,831
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 14,216	千ユーロ 14,564
	イ タ リ ア	国 債 証 券	14,740	16,219
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	11,403	13,119
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	1,735	1,894
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	8,826	9,083
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	1,954	2,730
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	2,096	1,817
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	1,227	1,005
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	355	991
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 10,759	千イギリスポンド 5,378
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 2,165	千スウェーデンクローナ 851
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 3,551	千ノルウェークローネ 4,584
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 2,651	千デンマーククローネ 6,598
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 5,670	千ポーランドズロチ 4,685
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 2,021	千オーストラリアドル 3,433
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 1,156	千ニュージーランドドル 485
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,078	千シンガポールドル 1,537
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 4,128	千マレーシアリンギット 3,832
	中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 414,750	千オフショア人民元 54,330
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 3,243	千イスラエルシェケル 2,276

(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 13,514	百万円 13,989	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 先 物 取 引	百万円 23,668	百万円 23,668	100.0	百万円 24,224	百万円 24,224	100.0
為 替 直 物 取 引	13,024	12,946	99.4	8,644	8,541	98.8
金 銭 信 託	10	10	100.0	10	10	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	267,973	25,593	9.6	268,332	25,770	9.6

(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80%以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	625,940	556,306	82,266,563	46.8	—	20.0	18.1	8.8
カ ナ ダ	千カナダドル 34,070	千カナダドル 31,714	3,476,816	2.0	—	1.1	0.4	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 187,480	千メキシコペソ 172,142	1,495,074	0.9	—	0.5	0.3	0.0
ド イ ツ	千ユーロ 72,740	千ユーロ 68,242	10,858,791	6.2	—	3.4	2.0	0.7
イ タ リ ア	83,400	79,088	12,584,510	7.2	—	4.1	2.0	1.1
フ ラ ン ス	94,970	87,789	13,969,120	8.0	—	4.8	2.5	0.7
オ ラ ン ダ	17,270	15,837	2,520,063	1.4	—	0.8	0.5	0.1
ス ペ イ ン	55,500	52,487	8,351,745	4.8	—	2.6	1.5	0.7
ペ ル ギ ー	20,260	18,766	2,986,137	1.7	—	1.2	0.4	0.1
オ ー ス ト リ ア	14,380	12,886	2,050,429	1.2	—	0.7	0.3	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	6,390	5,595	890,316	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ア イ ル ラ ン ド	6,960	6,203	987,177	0.6	—	0.4	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 57,980	千イギリスポンド 48,389	9,016,960	5.1	—	3.5	1.1	0.6
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 25,680	千スウェーデンクローナ 24,748	348,453	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 23,250	千ノルウェークローネ 21,521	300,653	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 23,050	千デンマーククローネ 21,838	465,820	0.3	—	0.2	0.0	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 27,260	千ポーランドズロチ 24,766	906,125	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 27,040	千オーストラリアドル 24,290	2,345,025	1.3	—	0.9	0.3	0.1
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 5,190	千ニューージーランドドル 4,543	409,754	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 6,660	千シンガポールドル 6,417	706,257	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 26,950	千マレーシアリンギット 27,760	862,039	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 688,530	千オフショア人民元 707,333	14,532,100	8.3	—	3.7	3.2	1.3
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシケル 15,250	千イスラエルシケル 13,900	564,186	0.3	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	172,894,124	98.4	—	49.4	33.8	15.3

(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割合です。

(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

当 期 末					当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	
		外貨建金額	邦貨換算金額				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					T 1.625% 05/15/31	1.625	4,290	3,639	538,203	2031/5/15
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,180	1,114	164,805	2025/5/31	1.625	1,760	1,553	229,778	2029/8/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	4,310	4,058	600,204	2025/6/30	1.625	2,150	2,011	297,499	2026/9/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	2,065	305,383	2025/7/31	1.625	3,100	1,758	260,005	2050/11/15
T 0.25% 09/30/25	0.25	3,290	3,069	453,922	2025/9/30	1.625	3,030	2,825	417,813	2026/11/30
T 0.375% 01/31/26	0.375	1,700	1,571	232,398	2026/1/31	1.75	2,500	2,242	331,560	2029/1/31
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,590	1,122,524	2025/4/30	1.75	5,500	5,322	787,160	2025/3/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	4,000	3,518	520,283	2027/7/31	1.75	4,800	3,249	480,503	2041/8/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	4,000	3,499	517,441	2027/9/30	1.75	2,220	1,966	290,757	2029/11/15
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,770	3,504	518,253	2025/11/30	1.75	4,300	4,017	594,092	2026/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	3,500	3,235	478,468	2026/2/28	1.875	6,200	5,269	779,220	2032/2/15
T 0.5% 03/31/25	0.5	4,000	3,812	563,792	2025/3/31	1.875	4,750	3,318	490,781	2041/2/15
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,000	1,781	263,445	2027/4/30	1.875	4,500	2,721	402,512	2051/2/15
T 0.5% 05/31/27	0.5	300	266	39,408	2027/5/31	1.875	3,000	2,803	414,604	2027/2/28
T 0.5% 06/30/27	0.5	2,500	2,215	327,646	2026/6/30	1.875	1,900	1,712	253,209	2029/2/28
T 0.5% 08/31/27	0.5	1,100	969	143,370	2027/8/31	1.875	3,980	3,767	557,203	2026/6/30
T 0.5% 10/31/27	0.5	1,580	1,384	204,758	2027/10/31	1.875	1,800	1,699	251,387	2026/7/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	3,400	3,048	450,882	2027/3/31	1.875	3,400	2,045	302,470	2051/11/15
T 0.625% 05/15/30	0.625	7,400	5,998	887,076	2030/5/15	2.0	6,050	5,878	869,344	2025/2/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	4,000	3,661	541,471	2026/7/31	2.0	3,370	2,120	313,594	2050/2/15
T 0.625% 08/15/30	0.625	9,130	7,341	1,085,653	2030/8/15	2.0	3,750	3,611	534,003	2025/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	3,700	3,250	480,653	2027/11/30	2.0	6,690	4,163	615,676	2051/8/15
T 0.625% 12/31/27	0.625	3,000	2,627	388,618	2027/12/31	2.0	2,700	2,544	376,348	2026/11/15
T 0.75% 01/31/28	0.75	3,500	3,074	454,611	2028/1/31	2.0	4,140	2,915	441,198	2041/11/15
T 0.75% 03/31/26	0.75	2,750	2,551	377,265	2026/3/31	2.125	3,850	3,730	551,701	2025/5/15
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,500	3,237	478,761	2026/4/30	2.25	3,900	3,689	545,586	2027/2/15
T 0.75% 08/31/26	0.75	3,000	2,748	406,381	2026/8/31	2.25	2,410	1,592	235,559	2025/2/15
T 0.875% 09/30/26	0.875	5,000	4,587	678,471	2026/9/30	2.25	1,500	1,436	212,461	2026/3/31
T 0.875% 11/15/30	0.875	6,160	5,015	741,651	2030/11/15	2.25	1,600	1,185	175,270	2041/5/15
T 1% 07/31/28	1.0	2,500	2,188	323,646	2028/7/31	2.25	1,820	1,709	252,756	2027/8/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	5,600	4,624	683,820	2031/2/15	2.25	2,180	1,500	221,905	2046/8/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	3,880	3,453	510,726	2028/2/29	2.25	2,110	1,413	209,027	2049/8/15
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,550	969	143,361	2040/5/15	2.25	5,000	5,293	782,839	2025/11/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	3,600	2,230	329,849	2040/8/15	2.25	5,260	4,921	727,820	2027/11/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	4,000	3,514	519,740	2028/8/31	2.375	1,350	1,008	149,178	2042/2/15
T 1.125% 10/31/26	1.125	6,850	6,309	933,067	2026/10/31	2.375	1,400	1,291	190,954	2029/3/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,300	4,731	699,693	2028/3/31	2.375	1,820	1,745	258,155	2026/4/30
T 1.25% 04/30/28	1.25	7,800	6,949	1,027,686	2028/4/30	2.375	3,600	3,406	503,711	2025/5/15
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,120	2,625	388,303	2050/5/15	2.375	1,390	1,280	189,301	2029/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,334	788,934	2028/5/31	2.375	1,980	1,350	199,666	2051/5/15
T 1.25% 06/30/28	1.25	1,000	887	131,220	2028/6/30	2.375	2,010	1,383	204,595	2049/11/15
T 1.25% 08/15/31	1.25	6,550	5,364	793,336	2031/8/15	2.5	4,000	3,910	578,353	2025/1/31
T 1.25% 09/30/28	1.25	3,800	3,350	495,487	2028/9/30	2.5	1,750	1,287	190,463	2045/2/15
T 1.25% 11/30/26	1.25	3,000	2,767	409,223	2026/11/30	2.5	1,250	909	134,474	2046/2/15
T 1.25% 12/31/26	1.25	5,500	5,065	749,067	2026/12/31	2.5	650	626	92,607	2026/2/28
T 1.375% 08/15/50	1.375	2,300	1,219	180,265	2050/8/15	2.5	1,810	1,313	194,207	2046/5/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	1,700	1,504	222,559	2028/10/31	2.625	1,350	1,305	193,040	2026/1/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	12,110	9,946	1,470,926	2031/11/15	2.625	6,900	6,454	954,486	2029/2/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	4,650	2,995	443,032	2040/11/15	2.625	2,500	2,441	361,035	2025/3/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	5,800	5,369	794,012	2027/1/31	2.625	2,900	2,764	408,766	2027/5/31
T 1.5% 02/15/25	1.5	3,000	2,900	428,931	2025/2/15	2.625	4,500	4,354	643,988	2025/12/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	1,820	1,572	232,528	2030/2/15	2.75	4,670	4,439	656,460	2028/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	5,300	4,953	732,482	2026/8/15	2.75	6,000	5,626	832,015	2029/5/31
T 1.5% 11/30/28	1.5	5,550	4,933	729,603	2028/11/30	2.75	2,000	1,950	288,469	2025/6/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	5,446	805,403	2026/2/15	2.75	5,000	4,777	706,430	2027/7/31
T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,089	752,572	2026/5/15	2.75	3,180	2,874	425,087	2032/8/15

当 期 末					当 期 末								
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額				千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額	
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,330	1,841	272,310	2042/8/15	T 4% 06/30/28	4.0	2,000	1,994	294,933	2028/6/30		
T 2.75% 08/15/47	2.75	1,150	865	128,054	2047/8/15	T 4% 07/31/30	4.0	800	796	117,761	2030/7/31		
T 2.75% 08/31/25	2.75	5,000	4,865	719,470	2025/8/31	T 4% 11/15/52	4.0	3,500	3,313	490,063	2052/11/15		
T 2.75% 11/15/42	2.75	1,650	1,300	192,265	2042/11/15	T 4% 12/15/25	4.0	5,000	4,960	733,580	2025/12/15		
T 2.75% 11/15/47	2.75	1,400	1,052	155,621	2047/11/15	T 4.125% 08/15/53	4.125	1,200	1,162	171,952	2053/8/15		
T 2.875% 04/30/25	2.875	8,370	8,189	1,211,066	2025/4/30	T 4.125% 08/31/30	4.125	3,400	3,407	503,872	2030/8/31		
T 2.875% 04/30/29	2.875	4,170	3,938	582,369	2029/4/30	T 4.125% 11/15/32	4.125	5,690	5,702	843,343	2032/11/15		
T 2.875% 05/15/28	2.875	4,460	4,250	628,589	2028/5/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	850	852	126,088	2039/5/15		
T 2.875% 05/15/32	2.875	6,750	6,177	913,499	2032/5/15	T 4.25% 10/15/25	4.25	680	677	100,140	2025/10/15		
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,050	840	124,252	2043/5/15	T 4.25% 11/15/40	4.25	650	644	95,350	2040/11/15		
T 2.875% 05/15/49	2.875	4,100	3,134	463,565	2049/5/15	T 4.375% 02/15/38	4.375	500	512	75,857	2038/2/15		
T 2.875% 05/15/52	2.875	4,300	3,272	483,942	2052/5/15	T 4.375% 05/15/40	4.375	750	758	112,097	2040/5/15		
T 2.875% 07/31/25	2.875	500	487	72,160	2025/7/31	T 4.375% 05/15/41	4.375	550	552	81,646	2041/5/15		
T 2.875% 08/15/28	2.875	10,200	9,699	1,434,400	2028/8/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	650	659	97,469	2039/11/15		
T 2.875% 08/15/45	2.875	1,880	1,473	217,861	2045/8/15	T 4.375% 11/30/30	4.375	3,170	3,223	476,763	2030/11/30		
T 3% 02/15/47	3.0	2,100	1,662	245,860	2047/2/15	T 4.5% 02/15/36	4.5	600	628	92,942	2036/2/15		
T 3% 02/15/48	3.0	2,700	2,124	314,164	2048/2/15	T 4.5% 05/15/38	4.5	250	259	38,335	2038/5/15		
T 3% 02/15/49	3.0	1,940	1,520	224,842	2049/2/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	750	772	114,269	2039/8/15		
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	906	134,086	2042/5/15	T 4.5% 11/15/25	4.5	4,350	4,351	643,516	2025/11/15		
T 3% 05/15/45	3.0	600	481	71,188	2045/5/15	T 4.5% 11/15/33	4.5	2,300	2,375	351,257	2033/11/15		
T 3% 05/15/47	3.0	1,300	1,027	151,891	2047/5/15	T 4.625% 02/15/40	4.625	700	729	107,872	2040/2/15		
T 3% 07/15/25	3.0	6,100	5,967	882,458	2025/7/15	T 4.625% 03/15/26	4.625	2,170	2,181	322,610	2026/3/15		
T 3% 08/15/48	3.0	2,360	1,852	273,948	2048/8/15	T 4.625% 09/30/28	4.625	2,950	3,018	446,436	2028/9/30		
T 3% 08/15/52	3.0	2,570	2,008	297,041	2052/8/15	T 4.625% 11/15/26	4.625	3,600	3,637	537,962	2026/11/15		
T 3% 09/30/25	3.0	3,660	3,572	528,322	2025/9/30	T 4.75% 02/15/41	4.75	750	789	116,743	2041/2/15		
T 3% 10/31/25	3.0	1,000	975	144,243	2025/10/31	T 4.75% 11/15/53	4.75	2,500	2,689	397,774	2053/11/15		
T 3% 11/15/44	3.0	1,550	1,249	184,705	2044/11/15	T 5.0% 05/15/37	5.0	300	328	48,530	2037/5/15		
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,000	842	124,612	2042/2/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	900	946	139,918	2028/11/15		
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,600	3,001	443,841	2043/2/15	T 5.375% 02/15/31	5.375	750	813	120,298	2031/2/15		
T 3.125% 05/15/48	3.125	1,400	1,126	166,523	2048/5/15	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	618	91,518	2026/2/15		
T 3.125% 08/15/25	3.125	2,500	2,447	361,944	2025/8/15	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,850	1,978	292,578	2027/11/15		
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,550	1,278	189,025	2044/8/15	T 6.25% 05/15/30	6.25	2,920	3,267	483,205	2030/5/15		
T 3.125% 08/31/29	3.125	4,300	4,099	606,275	2029/8/31								
T 3.125% 11/15/28	3.125	7,460	7,161	1,058,992	2028/11/15	小 計					82,266,563		
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	735	108,759	2041/11/15	(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル				
T 3.25% 05/15/42	3.25	1,500	1,281	189,517	2042/5/15	CAN 0.25% 03/01/26	0.25	1,130	1,047	114,803	2026/3/1		
T 3.25% 06/30/27	3.25	4,850	4,715	697,312	2027/6/30	CAN 0.5% 09/01/25	0.5	1,590	1,500	164,481	2025/9/1		
T 3.375% 05/15/33	3.375	2,310	2,182	322,814	2033/5/15	CAN 0.5% 12/01/30	0.5	1,570	1,295	141,984	2030/12/1		
T 3.375% 05/15/44	3.375	400	343	50,847	2044/5/15	CAN 1% 06/01/27	1.0	640	588	64,508	2027/6/1		
T 3.375% 08/15/42	3.375	1,200	1,042	154,230	2042/8/15	CAN 1% 09/01/26	1.0	1,060	986	108,200	2026/9/1		
T 3.375% 11/15/48	3.375	1,900	1,596	236,120	2048/11/15	CAN 1.25% 03/01/25	1.25	500	482	52,941	2025/3/1		
T 3.5% 02/15/33	3.5	6,000	5,732	847,664	2033/2/15	CAN 1.25% 03/01/27	1.25	640	594	65,170	2027/3/1		
T 3.5% 02/15/39	3.5	900	830	122,798	2039/2/15	CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,940	1,702	186,654	2030/6/1		
T 3.625% 02/15/44	3.625	1,600	1,430	211,477	2044/2/15	CAN 1.5% 04/01/25	1.5	1,210	1,168	128,151	2025/4/1		
T 3.625% 02/15/53	3.625	2,870	2,537	375,309	2053/2/15	CAN 1.5% 06/01/26	1.5	740	700	76,822	2026/6/1		
T 3.625% 05/15/53	3.625	1,650	1,460	215,979	2053/5/15	CAN 1.5% 06/01/31	1.5	2,010	1,760	193,038	2031/6/1		
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,700	2,419	357,780	2043/8/15	CAN 1.5% 12/01/31	1.5	1,230	1,068	117,091	2031/12/1		
T 3.75% 04/15/26	3.75	5,800	5,730	847,367	2026/4/15	CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,520	1,069	117,275	2053/12/1		
T 3.75% 06/30/30	3.75	2,500	2,453	362,840	2030/6/30	CAN 2% 06/01/28	2.0	500	470	51,575	2028/6/1		
T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,018	150,582	2041/8/15	CAN 2% 06/01/32	2.0	1,190	1,067	117,045	2032/6/1		
T 3.75% 11/15/43	3.75	1,800	1,640	242,549	2043/11/15	CAN 2% 12/01/51	2.0	2,400	1,816	199,191	2051/12/1		
T 3.875% 02/15/43	3.875	830	772	114,218	2043/2/15	CAN 2.25% 06/01/25	2.25	670	651	71,430	2025/6/1		
T 3.875% 08/15/33	3.875	4,000	3,932	581,538	2033/8/15	CAN 2.25% 06/01/29	2.25	390	368	40,381	2029/6/1		
T 3.875% 08/15/40	3.875	680	645	95,434	2040/8/15	CAN 2.25% 12/01/29	2.25	240	225	24,758	2029/12/1		
T 3.875% 09/30/29	3.875	1,050	1,039	153,690	2029/9/30	CAN 2.5% 12/01/32	2.5	940	873	95,815	2032/12/1		
T 3.875% 11/30/29	3.875	3,880	3,840	567,879	2029/11/30	CAN 2.75% 06/01/33	2.75	510	482	52,932	2033/6/1		
T 4% 02/28/30	4.0	2,400	2,389	353,352	2030/2/28	CAN 2.75% 09/01/27	2.75	710	689	75,548	2027/9/1		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千カナダドル	千カナダドル	千カナダドル	千円				千ユーロ	千ユーロ	千円	千円	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	520	467	51,222	2048/12/1	DBR 1.25% 08/15/48	1.25	1,880	1,450	230,854	2048/8/15		
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	280	249	27,305	2055/12/1	DBR 1.7% 08/15/32	1.7	1,310	1,257	200,162	2032/8/15		
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	350	308	33,810	2064/12/1	DBR 1.8% 08/15/53	1.8	1,580	1,346	214,287	2053/8/15		
CAN 3% 10/01/25	3.0	1,880	1,842	201,950	2025/10/1	DBR 2.1% 11/15/29	2.1	450	447	71,161	2029/11/15		
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	1,010	998	109,477	2028/9/1	DBR 2.3% 02/15/33	2.3	2,120	2,130	338,989	2033/2/15		
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	780	777	85,272	2028/3/1	DBR 2.4% 11/15/30	2.4	300	303	48,254	2030/11/15		
CAN 3.5% 08/01/25	3.5	1,940	1,916	210,083	2025/8/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,520	1,509	240,115	2044/7/4		
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	490	498	54,681	2045/12/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,680	1,672	266,065	2046/8/15		
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	420	452	49,599	2041/6/1	DBR 2.6% 08/15/33	2.6	1,160	1,192	189,743	2039/8/15		
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	489	53,611	2037/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	930	1,025	163,154	2042/7/4		
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	480	533	58,510	2029/6/1	DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,570	1,840	292,820	2037/1/4		
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	2,170	2,567	281,487	2033/6/1	DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,090	1,329	211,611	2035/7/4		
小 計				3,476,816		DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,180	1,302	207,245	2028/7/4		
(メキシコ) 国債証券		千メキシコ コペソ	千メキシコ コペソ			DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,240	1,515	241,117	2034/7/4		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,000	6,329	54,975	2036/11/20	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,100	1,426	227,037	2040/7/4		
MBONO 5% 03/06/25	5.0	6,400	6,066	52,689	2025/3/6	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,090	1,316	209,507	2031/1/4		
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	14,220	12,679	110,124	2027/3/4	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	1,685	268,233	2028/1/4		
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	28,180	25,935	225,256	2026/3/5	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	744	118,506	2030/1/4		
MBONO 7% 09/03/26	7.0	3,040	2,842	24,689	2026/9/3	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,270	1,440	229,189	2027/7/4		
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	11,360	10,120	87,901	2033/5/26	OBL 0% 04/10/26	-	1,500	1,420	226,077	2026/4/10		
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	21,620	20,412	177,281	2027/6/3	OBL 0% 04/11/25	-	1,050	1,013	161,287	2025/4/11		
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	22,210	20,506	178,104	2031/5/29	OBL 0% 04/16/27	-	1,210	1,124	178,931	2027/4/16		
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	13,980	11,976	104,014	2042/11/13	OBL 0% 10/09/26	-	1,360	1,276	203,048	2026/10/9		
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,970	4,457	38,718	2034/11/23	OBL 0% 10/10/25	-	1,970	1,883	299,672	2025/10/10		
MBONO 8% 07/31/53	8.0	9,730	8,358	72,594	2053/7/31	OBL 1.3% 10/15/27	1.3	2,620	2,531	402,868	2027/10/15		
MBONO 8% 11/07/47	8.0	14,310	12,423	107,901	2047/11/7	OBL 2.2% 04/13/28	2.2	900	897	142,865	2028/4/13		
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	17,740	17,227	149,625	2029/5/31	OBL 2.4% 10/19/28	2.4	1,210	1,218	193,922	2028/10/19		
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	13,720	12,803	111,196	2038/11/18	(イタリア) 国債証券							
小 計				1,495,074		BTPS 0% 04/01/26	-	2,700	2,530	402,581	2026/4/1		
(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ			BTPS 0% 08/01/26	-	1,330	1,234	196,458	2026/8/1		
BKO 2.5% 03/13/25	2.5	1,900	1,887	300,331	2025/3/13	BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,250	1,113	177,151	2028/3/15		
BKO 3.1% 09/18/25	3.1	1,000	1,004	159,801	2025/9/18	BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	590	572	91,155	2025/2/1		
DBR 0% 02/15/30	-	1,660	1,458	232,025	2030/2/15	BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	1,710	1,491	237,381	2029/2/15		
DBR 0% 02/15/31	-	1,380	1,186	188,746	2031/2/15	BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,500	1,425	226,872	2026/2/1		
DBR 0% 02/15/32	-	2,080	1,746	277,971	2032/2/15	BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	730	650	103,568	2028/7/15		
DBR 0% 05/15/35	-	1,280	983	156,529	2035/5/15	BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,300	1,052	167,543	2031/8/1		
DBR 0% 05/15/36	-	1,320	985	156,874	2036/5/15	BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	1,000	939	149,540	2027/1/15		
DBR 0% 08/15/26	-	1,950	1,835	292,064	2026/8/15	BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	1,300	1,089	173,357	2031/4/1		
DBR 0% 08/15/29	-	2,430	2,157	343,364	2029/8/15	BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	600	414	65,978	2037/3/1		
DBR 0% 08/15/30	-	1,880	1,634	260,071	2030/8/15	BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	1,290	1,046	166,574	2032/6/1		
DBR 0% 08/15/30	-	400	348	55,406	2030/8/15	BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	1,030	883	140,546	2030/8/1		
DBR 0% 08/15/31	-	2,310	1,964	312,524	2031/8/15	BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,000	928	147,758	2027/9/15		
DBR 0% 08/15/50	-	2,530	1,319	210,025	2050/8/15	BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	1,120	923	146,868	2031/12/1		
DBR 0% 08/15/52	-	1,630	809	128,868	2052/8/15	BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	1,400	1,319	209,911	2027/4/1		
DBR 0% 11/15/27	-	1,230	1,130	179,920	2027/11/15	BTPS 1.2% 08/15/25	1.2	940	912	145,196	2025/8/15		
DBR 0% 11/15/28	-	1,250	1,127	179,352	2028/11/15	BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,170	1,115	177,418	2026/12/1		
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	230	216	34,396	2027/2/15	BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,510	1,341	213,505	2030/4/1		
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,750	1,590	253,154	2029/2/15	BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	830	630	100,312	2036/3/1		
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	1,300	1,192	189,683	2028/8/15	BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	1,070	1,046	166,476	2025/5/15		
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	1,290	1,255	199,835	2025/2/15	BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	650	402	64,002	2045/4/30		
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	1,990	1,909	303,761	2026/2/15	BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,500	1,466	233,331	2025/6/1		
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,510	1,410	224,500	2028/2/15	BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,307	208,028	2026/6/1		
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	940	884	140,748	2027/8/15	BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	1,300	1,126	179,220	2032/3/1		
DBR 1% 05/15/38	1.0	970	799	127,155	2038/5/15	BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	820	730	116,228	2030/12/1		
DBR 1% 08/15/25	1.0	1,130	1,099	174,945	2025/8/15	BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	750	447	71,139	2051/9/1		
						BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	890	630	100,266	2041/3/1		

当 期		末				当 期		末					
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	820	804	128,033	2025/7/1	FRTR 0% 05/25/32	—	1,850	1,485	236,326	2032/5/25		
BTPS 2% 02/01/28	2.0	930	892	142,000	2028/2/1	FRTR 0% 11/25/29	—	2,460	2,126	338,289	2029/11/25		
BTPS 2% 12/01/25	2.0	1,050	1,030	163,905	2025/12/1	FRTR 0% 11/25/30	—	3,230	2,713	431,834	2030/11/25		
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,040	1,005	160,071	2027/8/1	FRTR 0% 11/25/31	—	3,590	2,928	466,051	2031/11/25		
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	260	153	24,468	2072/3/1	FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	1,800	1,687	268,583	2026/11/25		
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	510	331	52,696	2052/9/1	FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	2,500	2,420	385,177	2025/5/25		
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,110	1,080	172,003	2027/6/1	FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	2,710	2,581	410,815	2026/5/25		
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,190	985	156,748	2036/9/1	FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	2,830	2,546	405,143	2029/5/25		
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	1,360	1,221	194,378	2033/9/1	FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	1,460	970	154,423	2040/5/25		
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	970	690	109,804	2050/9/1	FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	640	243	38,778	2072/5/25		
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	660	653	103,972	2025/11/15	FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	700	418	66,585	2044/6/25		
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	960	877	139,603	2032/12/1	FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	1,970	1,835	292,128	2028/2/25		
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	770	758	120,636	2027/12/1	FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	3,250	3,016	480,049	2028/5/25		
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	940	725	115,426	2047/3/1	FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,930	1,038	165,170	2052/5/25		
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	500	356	56,712	2067/3/1	FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	1,750	920	146,475	2053/5/25		
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	700	683	108,710	2029/6/15	FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	3,190	2,935	467,133	2028/11/25		
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,260	1,238	197,131	2028/12/1	FRTR 1% 05/25/27	1.0	2,850	2,711	431,447	2027/5/25		
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	850	741	117,956	2038/9/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	1,340	1,298	206,605	2025/11/25		
BTPS 3% 08/01/29	3.0	670	660	105,089	2029/8/1	FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	2,200	1,891	301,001	2034/5/25		
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	670	583	92,842	2040/3/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,570	2,118	337,167	2036/5/25		
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	270	245	39,005	2038/3/1	FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	600	473	75,385	2038/5/25		
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	880	748	119,071	2046/9/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	2,410	2,234	355,571	2031/5/25		
BTPS 3.35% 03/01/43	3.35	1,390	1,318	209,779	2035/3/1	FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	1,860	1,279	203,601	2050/5/25		
BTPS 3.4% 03/28/25	3.4	140	140	22,289	2025/3/28	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	568	90,458	2066/5/25		
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	1,050	1,060	168,779	2028/4/1	FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	1,660	1,392	221,585	2039/6/25		
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,040	909	144,651	2048/3/1	FRTR 2% 05/25/48	2.0	1,580	1,244	198,038	2048/5/25		
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	1,490	1,261	238,869	2026/1/15	FRTR 2% 11/25/32	2.0	1,960	1,851	294,580	2032/11/25		
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,870	1,885	300,099	2030/3/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,520	3,506	557,879	2030/5/25		
BTPS 3.6% 09/29/25	3.6	920	925	147,316	2025/9/29	FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	510	455	72,539	2043/5/25		
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	840	777	123,748	2049/9/1	FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	1,670	1,664	264,834	2026/9/25		
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	1,250	1,282	204,036	2029/12/15	FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	760	766	121,959	2029/2/25		
BTPS 4% 02/01/37	4.0	1,800	1,801	286,600	2037/2/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	3,080	3,100	493,402	2027/10/25		
BTPS 4% 04/30/35	4.0	620	625	99,503	2035/4/30	FRTR 3% 05/25/33	3.0	2,110	2,151	342,308	2033/5/25		
BTPS 4% 10/30/31	4.0	440	453	72,182	2031/10/30	FRTR 3% 05/25/54	3.0	970	903	143,820	2054/5/25		
BTPS 4% 11/15/30	4.0	1,050	1,083	172,437	2030/11/15	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,800	1,799	286,294	2045/5/25		
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	1,540	1,611	256,423	2033/11/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,120	3,174	505,116	2026/4/25		
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	240	252	40,236	2033/5/1	FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	700	741	117,942	2033/11/25		
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	440	446	71,029	2043/9/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,070	1,201	191,254	2055/4/25		
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	930	956	152,152	2026/3/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,020	1,161	184,750	2060/4/25		
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	570	575	91,644	2053/10/1	FRTR 4% 10/25/38	4.0	1,420	1,577	250,958	2038/10/25		
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	1,260	1,343	213,730	2028/9/1	FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,090	2,459	391,408	2041/4/25		
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,030	1,087	173,052	2044/9/1	FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	1,590	1,868	297,238	2035/4/25		
BTPS 5% 03/01/25	5.0	1,290	1,311	208,662	2025/3/1	FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,500	2,851	453,718	2029/4/25		
BTPS 5% 08/01/34	5.0	1,620	1,778	283,012	2034/8/1	FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,150	2,646	421,115	2032/10/25		
BTPS 5% 09/01/40	5.0	1,220	1,328	211,356	2040/9/1	FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,450	1,525	242,687	2025/10/25		
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,440	1,569	249,684	2039/8/1	(オランダ)							
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	1,770	1,950	310,410	2029/11/1	国債証券							
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	1,410	1,629	259,230	2033/2/1	NETHER 0% 01/15/26	—	870	826	131,493	2026/1/15		
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,320	1,534	244,114	2031/5/1	NETHER 0% 01/15/27	—	750	698	111,080	2027/1/15		
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,070	2,319	369,015	2027/11/1	NETHER 0% 01/15/29	—	1,040	923	147,020	2029/1/15		
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	388	61,813	2026/11/1	NETHER 0% 01/15/38	—	930	362	57,658	2038/1/15		
(フランス)						NETHER 0% 01/15/52	—	970	466	74,306	2052/1/15		
国債証券						NETHER 0% 07/15/30	—	850	727	115,803	2030/7/15		
FRTR 0% 02/25/25	—	880	851	135,460	2025/2/25	NETHER 0% 07/15/31	—	930	775	123,447	2031/7/15		
FRTR 0% 02/25/26	—	2,790	2,642	420,460	2026/2/25	NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	720	693	110,346	2025/7/15		
FRTR 0% 02/25/27	—	2,140	1,980	315,214	2027/2/25	NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	540	481	76,552	2029/7/15		
FRTR 0% 03/25/25	—	1,890	1,824	290,346	2025/3/25	NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	780	556	88,478	2040/1/15		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,050	999	159,069	2026/7/15	SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,410	1,441	229,442	2025/7/30		
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	650	551	87,714	2032/7/15	SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,240	1,405	223,685	2041/7/30		
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	850	135,382	2027/7/15	SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,080	1,244	198,099	2040/7/30		
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,010	939	149,527	2028/7/15	SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	1,100	1,212	192,983	2028/10/31		
NETHER 2% 01/15/54	2.0	400	341	54,304	2054/1/15	SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	790	948	150,975	2044/10/31		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	820	817	130,099	2033/1/15	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,250	1,498	238,469	2032/7/30		
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	500	496	79,033	2033/7/15	SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,360	1,457	231,952	2026/7/30		
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,050	1,051	167,344	2047/1/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,350	2,694	428,773	2029/1/31		
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	170	182	28,986	2044/1/15								
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,010	1,146	182,490	2042/1/15	(ベルギー)							
NETHER 4% 01/15/37	4.0	950	1,079	171,828	2037/1/15	国債証券							
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	780	867	138,094	2028/1/15	BGB 0% 10/22/27	-	530	482	76,839	2027/10/22		
(スペイン)						BGB 0% 10/22/31	-	730	594	94,558	2031/10/22		
国債証券						BGB 0.1% 06/22/30	0.1	660	563	89,740	2030/6/22		
SPGB 0% 01/31/25	-	480	464	73,933	2025/1/31	BGB 0.35% 06/22/32	0.35	860	706	112,409	2032/6/22		
SPGB 0% 01/31/26	-	1,070	1,011	160,912	2026/1/31	BGB 0.4% 06/22/40	0.4	400	257	40,993	2040/6/22		
SPGB 0% 01/31/27	-	1,080	994	158,300	2027/1/31	BGB 0.65% 06/22/71	0.65	340	139	22,217	2071/6/22		
SPGB 0% 01/31/28	-	1,280	1,147	182,587	2028/1/31	BGB 0.8% 06/22/25	0.8	940	912	145,189	2025/6/22		
SPGB 0% 05/31/25	-	1,520	1,459	232,224	2025/5/31	BGB 0.8% 06/22/27	0.8	920	868	138,198	2027/6/22		
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	1,370	1,117	177,775	2031/4/30	BGB 0.8% 06/22/28	0.8	810	753	119,839	2028/6/22		
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	1,420	1,228	195,509	2030/4/30	BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,100	1,009	160,683	2029/6/22		
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,180	977	155,596	2031/10/31	BGB 1% 06/22/26	1.0	1,000	962	153,166	2026/6/22		
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	970	855	136,140	2029/10/31	BGB 1% 06/22/31	1.0	910	808	128,636	2031/6/22		
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	930	772	122,913	2032/4/30	BGB 1.25% 04/22/33	1.25	550	483	76,931	2033/4/22		
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	1,190	1,112	177,089	2027/7/30	BGB 1.4% 06/22/53	1.4	520	329	52,449	2053/6/22		
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	880	789	125,592	2029/7/30	BGB 1.45% 06/22/37	1.45	400	328	52,307	2037/6/22		
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	640	459	73,108	2037/7/30	BGB 1.6% 06/22/47	1.6	640	460	73,254	2047/6/22		
SPGB 1% 07/30/42	1.0	480	308	49,113	2042/7/30	BGB 1.7% 06/22/50	1.7	610	433	68,905	2050/6/22		
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,130	603	95,992	2050/10/31	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	480	411	65,522	2038/6/22		
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	950	660	105,092	2040/10/31	BGB 2.15% 06/22/66	2.15	450	333	53,069	2066/6/22		
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,200	1,077	171,404	2030/10/31	BGB 2.25% 06/22/57	2.25	270	208	33,204	2057/6/22		
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,460	1,403	223,350	2026/10/31	BGB 2.75% 04/22/39	2.75	140	132	21,157	2039/4/22		
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,240	1,172	186,507	2028/4/30	BGB 2.85% 10/22/34	2.85	200	198	31,602	2034/10/22		
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	1,630	1,535	244,403	2028/7/30	BGB 3% 06/22/33	3.0	750	760	120,975	2033/6/22		
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	750	700	111,471	2029/4/30	BGB 3% 06/22/34	3.0	350	353	56,179	2034/6/22		
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,330	1,268	201,773	2027/10/31	BGB 3.3% 06/22/54	3.3	580	564	89,757	2054/6/22		
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	260	124	19,798	2071/10/31	BGB 3.45% 06/22/43	3.45	280	285	45,448	2043/6/22		
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,290	1,239	197,231	2027/4/30	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	450	479	76,296	2045/6/22		
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,226	195,134	2025/4/30	BGB 4% 03/28/32	4.0	620	677	107,730	2032/3/28		
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,190	1,023	162,823	2035/7/30	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	980	1,110	176,668	2041/3/28		
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,050	691	110,098	2052/10/31	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	510	528	84,132	2026/3/28		
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,340	1,314	209,101	2026/4/30	BGB 5% 03/28/35	5.0	1,110	1,322	210,508	2035/3/28		
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,520	1,434	228,292	2030/7/30	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,170	1,304	207,561	2028/3/28		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,650	1,629	259,250	2025/10/31	(オーストリア)							
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,160	1,083	172,379	2033/7/30	国債証券							
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	1,480	1,417	225,612	2032/10/31	RAGB 0% 02/20/30	-	930	796	126,801	2030/2/20		
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	970	799	127,232	2048/10/31	RAGB 0% 02/20/31	-	850	706	112,342	2031/2/20		
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	330	329	52,440	2026/5/31	RAGB 0% 04/20/25	-	370	356	56,779	2025/4/20		
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,020	885	140,903	2046/10/31	RAGB 0% 10/20/28	-	420	372	59,320	2028/10/20		
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	980	978	155,742	2033/4/30	RAGB 0% 10/20/40	-	330	199	31,753	2040/10/20		
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	540	539	85,800	2034/4/30	RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	360	256	40,878	2036/10/20		
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	580	559	88,327	2043/7/30	RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	810	731	116,407	2029/2/20		
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	900	803	127,840	2066/7/30	RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	650	609	96,930	2027/4/20		
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	150	154	24,623	2029/5/31	RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	200	88	14,160	2071/4/20		
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	1,360	1,366	217,496	2033/10/31	RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	720	671	106,795	2028/2/20		
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	540	556	88,565	2039/7/30	RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	460	266	42,328	2051/3/20		
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,210	1,306	207,875	2037/1/31	RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	900	857	136,375	2026/10/20		
						RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	200	87	13,877	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	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	800	694	110,586	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	680	662	105,354	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	530	390	62,195	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	200	118	18,851	2086/11/2
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	390	304	48,502	2049/5/23
RAGB 2% 07/15/26	2.0	260	256	40,738	2026/7/15
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	280	206	32,896	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	460	441	70,312	2034/5/23
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	520	524	83,427	2033/2/20
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	240	241	38,377	2034/2/20
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	420	421	67,081	2044/6/20
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	190	190	30,260	2053/10/20
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	150	157	25,006	2030/10/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	210	240	38,228	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	840	941	149,768	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	470	490	77,982	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	540	604	96,108	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/30	-	330	277	44,183	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	270	192	30,592	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	240	111	17,666	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	290	239	38,098	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	210	133	21,293	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	500	477	75,959	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	180	113	17,992	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	380	353	56,228	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	290	264	42,048	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	290	258	41,133	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	320	280	44,611	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	380	368	58,643	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	310	263	41,896	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	140	134	21,462	2027/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	330	239	38,085	2047/4/15
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	260	235	37,452	2032/9/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	350	328	52,199	2042/7/4
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	170	164	26,117	2038/4/15
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	380	383	60,947	2028/7/4
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	130	131	20,947	2029/4/15
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	110	107	17,107	2055/4/15
RFGB 3% 09/15/33	3.0	290	294	46,893	2033/9/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	240	243	38,753	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	-	530	437	69,595	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	410	381	60,680	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	380	326	52,020	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	170	140	22,390	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	310	240	38,308	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	250	169	26,970	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	440	413	65,761	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	670	647	102,999	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	550	513	81,692	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	310	276	43,994	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	240	222	35,372	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	460	332	52,907	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	420	366	58,302	2037/5/15

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	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	620	522	83,171	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	440	437	69,656	2030/5/15
IRISH 3% 10/18/43	3.0	170	171	27,279	2043/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	590	603	96,073	2025/3/13
小 計				55,198,292	
(イギリス)					
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	780	720	134,345	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	880	759	141,517	2028/1/31
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,270	1,217	226,790	2025/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	1,730	1,328	247,465	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,170	1,060	197,700	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,450	1,158	215,802	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,180	1,003	186,917	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,050	312	58,223	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,160	1,102	205,523	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	1,140	779	145,215	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	640	257	48,047	2050/10/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	510	253	47,260	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	1,500	1,135	211,516	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	820	698	130,129	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	1,880	1,510	281,484	2032/1/31
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	1,320	855	159,369	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	480	175	32,718	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	740	676	126,078	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	1,170	572	106,771	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	1,190	730	136,129	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,180	1,110	207,009	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,010	571	106,410	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	680	348	64,888	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	480	435	81,098	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	720	377	70,390	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	710	329	61,361	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	600	352	65,763	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	980	522	97,346	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,110	826	153,969	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,300	1,252	233,436	2025/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	860	548	102,289	2065/7/22
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,240	1,035	192,985	2044/1/22
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	1,610	1,526	284,404	2033/1/31
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,130	974	181,609	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	800	659	122,875	2068/7/22
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	490	482	89,877	2025/10/22
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	1,060	1,000	186,400	2038/1/29
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	900	787	146,828	2052/7/22
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	1,370	1,193	222,334	2053/10/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	710	650	121,136	2060/1/22
UKT 4% 10/22/63	4.0	560	510	95,161	2063/10/22
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	1,870	1,871	348,823	2027/1/29
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	850	858	160,020	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	770	791	147,486	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	670	661	123,303	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,100	1,111	207,197	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	920	903	168,399	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,060	1,017	189,613	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	810	773	144,218	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,100	1,048	195,423	2055/12/7

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	邦貨換算金額				外貨建金額	邦貨換算金額			
	%	千イギリ スポンド	千イギリ スポンド	千円		%	千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ	千円		
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	150	145	27,106	2054/7/31	POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	2,010	1,855	67,880	2027/7/25
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	720	735	137,118	2028/6/7	POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	3,870	3,543	129,647	2028/4/25
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	840	871	162,461	2034/9/7	POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	4,370	3,872	141,675	2029/10/25
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	850	854	159,235	2042/12/7	POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	2,940	2,867	104,898	2025/7/25
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	570	598	111,478	2034/1/31	POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	300	288	10,572	2027/5/25
UKT 4.75% 10/22/43	4.75	420	433	80,844	2043/10/22	POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	900	923	33,775	2029/4/25
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	760	802	149,493	2030/12/7	POLGB 6% 10/25/33	6.0	920	968	35,417	2033/10/25
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	810	848	158,106	2038/12/7	POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	320	349	12,800	2028/7/25
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,080	1,083	201,861	2025/3/7	小 計				906,125	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,070	1,170	218,179	2028/12/7	(オーストラリア) 国債証券		千オースト リアドル	千オースト リアドル		
小 計				9,016,960		ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	1,190	1,117	107,927	2025/11/21
(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデ ンクローナ	千スウェーデ ンクローナ			ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	1,030	948	91,587	2026/9/21
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	3,010	2,586	36,415	2031/5/12	ACGB 1% 11/21/31	1.0	1,990	1,591	153,658	2031/11/21
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,240	3,040	42,815	2028/5/12	ACGB 1% 12/21/30	1.0	1,480	1,221	117,883	2030/12/21
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	4,430	4,082	57,479	2029/11/12	ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,140	916	88,504	2032/5/21
SGB 1% 11/12/26	1.0	4,120	3,958	55,732	2026/11/12	ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	1,190	1,003	96,865	2031/6/21
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	1,780	1,701	23,952	2033/11/11	ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,060	604	58,341	2051/6/21
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	2,560	2,557	36,004	2032/6/1	ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	1,380	1,143	110,402	2032/11/21
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	4,200	4,170	58,719	2025/5/12	ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	630	593	57,326	2028/5/21
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	2,340	2,651	37,335	2039/3/30	ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	620	572	55,299	2030/5/21
小 計				348,453		ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	750	599	57,901	2041/5/21
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ			ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	630	548	52,984	2035/6/21
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	2,370	2,003	27,992	2031/9/17	ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,160	1,121	108,285	2027/11/21
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	3,280	2,865	40,035	2030/8/19	ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	770	736	71,147	2028/11/21
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	2,620	2,505	35,002	2026/2/19	ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,080	1,020	98,499	2029/11/21
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,420	2,291	32,016	2027/2/17	ACGB 3% 03/21/47	3.0	780	613	59,210	2047/3/21
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	2,960	2,884	40,293	2025/3/13	ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,120	1,019	98,409	2033/11/21
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	2,310	2,102	29,377	2029/9/6	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	1,040	1,031	99,591	2025/4/21
NGB 2% 04/26/28	2.0	2,510	2,357	32,936	2028/4/26	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,030	1,004	96,986	2029/4/21
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	1,630	1,458	20,381	2032/5/18	ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	580	509	49,166	2039/6/21
NGB 3% 08/15/33	3.0	1,950	1,849	25,832	2033/8/15	ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	820	772	74,615	2034/12/21
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	1,200	1,201	16,785	2042/10/6	ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	780	739	71,438	2037/4/21
小 計				300,653		ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	970	938	90,634	2034/5/21
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク クローネ	千デンマーク クローネ			ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,200	1,212	117,100	2026/4/21
DGB 0% 11/15/31	-	3,330	2,781	59,338	2031/11/15	ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,210	1,246	120,353	2033/4/21
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	2,880	1,540	32,864	2052/11/15	ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,080	1,114	107,598	2027/4/21
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	3,770	3,519	75,073	2027/11/15	ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	330	345	33,306	2054/6/21
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	3,400	3,069	65,462	2029/11/15	小 計				2,345,025	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	2,610	2,567	54,770	2025/11/15	(ニュージーランド) 国債証券		千ニュージ ーランドドル	千ニュージ ーランドドル		
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	1,670	1,643	35,054	2033/11/15	NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	490	410	37,026	2028/5/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	5,390	6,716	143,255	2039/11/15	NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	360	327	29,568	2026/5/15
小 計				465,820		NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	460	373	33,710	2031/5/15
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ			NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	260	164	14,835	2041/5/15
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	1,220	1,077	39,436	2026/10/25	NZGB 2% 05/15/32	2.0	350	288	25,973	2032/5/15
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	1,830	1,740	63,693	2025/4/25	NZGB 2.75% 04/15/25	2.75	490	476	42,975	2025/4/15
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	2,040	1,602	58,628	2030/10/25	NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	350	279	25,214	2037/4/15
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	2,940	2,276	83,298	2032/4/25	NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	350	236	21,298	2051/5/15
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	3,600	3,400	124,400	2026/7/25	NZGB 3% 04/20/29	3.0	450	420	37,882	2029/4/20
						NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	640	586	52,885	2033/4/14
						NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	270	260	23,509	2034/5/15
						NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	460	459	41,424	2027/4/15
						NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	260	260	23,449	2030/5/15
						小 計				409,754	

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	評価額 邦貨換算金額				外貨建金額	評価額 邦貨換算金額			
(シンガポール) 国債証券	%	千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル	千円	千オフショア 人民元	千オフショア 人民元	千円				
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	320	305	33,621	2025/11/1	CGB 2.22% 09/25/25	2.22	12,250	12,259	251,870	2025/9/25
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	90	85	9,445	2026/11/1	CGB 2.24% 05/25/25	2.24	23,400	23,459	481,973	2025/5/25
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	390	355	39,068	2031/7/1	CGB 2.28% 11/25/25	2.28	23,020	23,080	474,185	2025/11/25
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	360	290	31,928	2050/3/1	CGB 2.3% 05/15/26	2.3	12,000	12,019	246,939	2026/5/15
SIGB 1.875% 01/01/51	1.875	270	221	24,347	2051/10/1	CGB 2.37% 01/20/27	2.37	19,900	20,025	411,421	2027/1/20
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	670	655	72,165	2026/6/1	CGB 2.39% 11/15/26	2.39	14,500	14,591	299,774	2026/11/15
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	330	304	33,485	2036/8/1	CGB 2.4% 07/15/28	2.4	17,600	17,665	362,940	2028/7/15
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	430	424	46,728	2025/6/1	CGB 2.44% 10/15/27	2.44	7,000	7,034	144,521	2027/10/15
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	230	212	23,431	2039/7/1	CGB 2.48% 04/15/27	2.48	18,380	18,503	380,153	2027/4/15
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	280	276	30,441	2028/5/1	CGB 2.48% 09/25/28	2.48	10,800	10,896	223,873	2028/9/25
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	180	175	19,271	2032/8/1	CGB 2.5% 07/25/27	2.5	26,400	26,569	545,874	2027/7/25
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	410	394	43,386	2046/3/1	CGB 2.52% 08/25/33	2.52	13,400	13,457	276,472	2033/8/25
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	300	291	32,091	2042/4/1	CGB 2.54% 12/25/30	2.54	10,000	10,060	206,697	2030/12/25
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	530	527	58,077	2029/7/1	CGB 2.55% 10/15/28	2.55	13,800	13,972	287,069	2028/10/15
SIGB 2.875% 08/01/28	2.875	80	79	8,798	2028/8/1	CGB 2.6% 09/01/32	2.6	14,750	14,851	305,120	2032/9/1
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	80	79	8,784	2027/9/1	CGB 2.6% 09/15/30	2.6	12,500	12,610	259,089	2030/9/15
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	460	457	50,314	2030/9/1	CGB 2.62% 06/25/30	2.62	13,000	13,126	269,691	2030/6/25
SIGB 3% 08/01/72	3.0	270	270	30,620	2027/8/1	CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,000	20,269	416,428	2029/9/25
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	400	413	45,457	2033/9/1	CGB 2.67% 05/25/33	2.67	6,400	6,482	133,185	2033/5/25
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	580	588	64,791	2027/3/1	CGB 2.67% 11/25/33	2.67	12,000	12,237	251,416	2033/11/25
小 計				706,257		CGB 2.68% 05/21/30	2.68	21,550	21,907	450,080	2030/5/21
(マレーシア) 国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット			CGB 2.69% 08/12/26	2.69	28,920	29,303	602,043	2026/8/12
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	790	735	22,828	2031/4/15	CGB 2.69% 08/15/32	2.69	12,700	12,902	265,073	2032/8/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	920	921	28,614	2027/5/31	CGB 2.75% 06/15/29	2.75	12,000	12,236	251,406	2029/6/15
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	320	314	9,772	2032/7/15	CGB 2.79% 12/15/29	2.79	9,740	9,954	204,517	2029/12/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,180	1,187	36,872	2028/6/15	CGB 2.8% 03/24/29	2.8	15,770	16,121	331,219	2029/3/24
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,110	1,072	33,314	2040/5/22	CGB 2.8% 03/25/30	2.8	5,000	5,110	105,002	2030/3/25
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	250	250	7,788	2034/7/5	CGB 2.8% 11/15/32	2.8	6,000	6,139	126,129	2032/11/15
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	861	26,764	2033/4/15	CGB 2.85% 06/04/27	2.85	11,760	12,001	246,565	2027/6/4
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,240	1,247	38,743	2025/3/14	CGB 2.88% 02/25/33	2.88	5,100	5,259	108,061	2033/2/25
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,890	1,915	59,479	2029/8/15	CGB 2.89% 11/18/31	2.89	22,500	23,156	475,742	2031/11/18
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	300	303	9,425	2027/3/15	CGB 2.91% 10/14/28	2.91	20,300	20,873	428,847	2028/10/14
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,820	1,844	57,290	2027/11/16	CGB 3% 10/15/53	3.0	5,500	5,899	121,208	2053/10/15
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,140	1,154	35,850	2026/11/30	CGB 3.01% 05/13/28	3.01	15,960	16,438	337,717	2028/5/13
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	750	758	23,556	2026/7/15	CGB 3.02% 05/27/31	3.02	14,720	15,270	313,738	2031/5/27
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,100	1,109	34,457	2025/9/15	CGB 3.03% 03/11/26	3.03	22,150	22,590	464,113	2026/3/11
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	1,340	1,320	41,010	2050/6/15	CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,200	8,827	181,367	2052/10/25
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	1,330	1,374	42,668	2031/6/30	CGB 3.19% 04/15/53	3.19	4,600	5,106	104,913	2053/4/15
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,480	1,526	47,409	2035/5/31	CGB 3.27% 11/19/30	3.27	5,930	6,256	128,545	2030/11/19
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	380	387	12,031	2026/4/15	CGB 3.28% 12/03/27	3.28	11,140	11,615	238,633	2027/12/3
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	490	510	15,842	2053/3/31	CGB 3.32% 04/15/52	3.32	4,390	4,901	100,693	2052/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,040	1,083	33,651	2030/4/15	CGB 3.39% 03/16/50	3.39	11,760	13,253	272,290	2050/3/16
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,160	1,237	38,424	2033/11/7	CGB 3.53% 10/18/51	3.53	6,510	7,547	155,068	2051/10/18
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	780	843	26,190	2042/10/15	CGB 3.72% 04/12/51	3.72	6,850	8,144	167,319	2051/4/12
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	640	695	21,584	2046/3/15	CGB 3.81% 09/14/50	3.81	8,230	9,959	204,619	2050/9/14
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,254	38,939	2037/4/7	CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,810	7,052	144,895	2049/7/22
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,490	1,634	50,766	2038/6/8	CGB 4.08% 10/22/48	4.08	8,080	10,121	207,954	2048/10/22
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,170	1,304	40,506	2048/7/6	小 計				14,532,100	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	820	909	28,254	2043/9/30	(イスラエル) 国債証券		千イスラエ ルシェケル	千イスラエ ルシェケル		
小 計				862,039		ILGVO 0.5% 02/27/26	0.5	350	327	13,311	2026/2/27
(中国オフショア) 国債証券		千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			ILGVO 0.5% 04/30/25	0.5	1,240	1,191	48,379	2025/4/30
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	53,260	53,205	1,093,097	2025/4/9	ILGVO 1% 03/31/30	1.0	2,160	1,813	73,587	2030/3/31
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	23,000	23,000	472,534	2026/8/15	ILGVO 1.3% 04/30/32	1.3	1,310	1,051	42,696	2032/4/30
						ILGVO 1.5% 05/31/37	1.5	1,230	865	35,142	2037/5/31

銘柄	利率	当 期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	評価額	額	
(イスラエル) 国債証券	%	千イスラエルシエケル	千イスラエルシエケル	千円		
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,290	1,250	50,760	2025/8/31	
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,290	1,224	49,685	2027/3/31	
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	1,320	1,231	49,974	2028/9/28	
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	440	304	12,366	2052/11/29	
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	570	566	22,976	2029/2/28	
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	1,440	1,245	50,552	2047/3/31	
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,060	1,177	47,809	2042/1/31	
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,550	1,649	66,943	2026/10/30	
小 計				564,186		
合 計				172,894,124		

(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	売 建 額
	百万円	百万円
外 国		
EURO-SCHATZ	67	—
US 5YR NOTE	175	—
EURO-BOBL FU	112	—
EURO-BUND	213	—
US 10YR NOTE	115	—
US LONG BOND	125	—

(注) 外貨建の評価額は、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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
172,894,124	98.4	
コーポレートローン等、その他	2,865,652	1.6
投資信託財産総額	175,759,776	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(174,717,408千円)の投資信託財産総額(175,759,776千円)に対する比率は99.4%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=147.88円	1カナダドル=109.63円	1メキシコペソ=8.6851円
1ユーロ=159.12円	1イギリスポンド=186.34円	1スウェーデンクローナ=14.08円
1ノルウェークローネ=13.97円	1デンマーククローネ=21.33円	1ポーランドズロチ=36.5867円
1オーストラリアドル=96.54円	1ニュージーランドドル=90.18円	1シンガポールドル=110.05円
1マレーシアリングット=31.0522円	1オフショア人民元=20.5449円	1イスラエルシエケル=40.5878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 2024年2月7日現在
(A) 資 産	176,656,712,791円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,283,998,633
公 社 債(評価額)	172,894,124,454
未 収 入 金	906,129,506
未 収 利 息	1,395,257,281
前 払 費 用	77,369,359
差 入 委 託 証 拠 金	99,833,558
(B) 負 債	1,002,515,602
未 払 金	904,665,627
未 払 解 約 金	97,849,785
未 払 利 息	190
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	175,654,197,189
元 本	59,041,902,236
次 期 繰 越 損 益 金	116,612,294,953
(D) 受 益 権 総 口 数	59,041,902,236口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,751円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年2月8日 至 2024年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	3,963,317,240円
受 取 利 息	3,960,364,287
そ の 他 収 益 金	3,422,574
支 払 利 息	△469,621
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	16,926,789,813
売 買 益	19,981,251,035
売 買 損	△3,054,461,222
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△28,272,761
取 引 益	83,015,458
取 引 損	△111,288,219
(D) そ の 他 費 用	△27,833,919
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	20,834,000,373
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	93,355,518,501
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,566,823,614
(H) 解 約 差 損 益 金	△11,144,047,535
(I) 計 (E+F+G+H)	116,612,294,953
次 期 繰 越 損 益 金(I)	116,612,294,953

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(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57,650,368,316円、期中追加設定元本額は7,552,064,306円、期中一部解約元本額は6,160,530,386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。

DC外国債券インデックスファンドL	14,415,637,816円
インデックスコレクション (外国債券)	9,882,709,617円
私募外国債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	6,027,378,488円
インデックスコレクション (バランス株式30)	5,407,710,919円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	5,120,462,663円
外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	3,381,182,666円
外国債券インデックスファンド	1,859,735,392円
DC外国債券インデックスファンド	1,826,359,771円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	1,254,570,311円
インデックスコレクション (バランス株式50)	1,147,279,769円
DCバランスファンド50	1,144,520,034円
DCバランスファンド30	1,004,951,839円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	964,784,157円
外国債券インデックスe	963,287,173円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	892,007,200円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	495,219,563円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	472,443,844円
インデックスコレクション (バランス株式70)	370,896,208円

バランスVA50 (適格機関投資家専用)	316,320,751円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	298,385,957円
外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	289,733,609円
DCバランスファンド70	240,598,088円
VAバランスファンド(株25/100) (適格機関投資家専用)	211,208,899円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	178,081,773円
VAバランスファンド(株50/100) (適格機関投資家専用)	167,375,574円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	156,590,229円
VAバランスファンド(株40/100) (適格機関投資家専用)	139,542,354円
VAバランスファンド(株60/100) (適格機関投資家専用)	75,442,683円
VAバランスファンド2(株40/100) (適格機関投資家専用)	67,405,339円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	59,268,485円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	57,311,675円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	52,263,881円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	45,948,321円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	38,375,441円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	16,911,747円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2023年9月13日)