

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。 ・ 主として、外国債券インデックス・マザー・ファンド受益証券に投資し、組入比率は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。 	
主要運用対象	ヘビィ ファンド	外国債券インデックス・マザー・ ファンド受益証券
	マザー ファンド	日本を除く世界主要国の国債、政府 機関債など
組入制限	ヘビィ ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・ マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 ・ 公社債への実質投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザー ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・ 公社債への投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、繰越分を含めた利子等収益と売却益(評価益を含みます)等の合計から経費を控除した額の範囲内とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

STATE STREET GLOBAL
ADVISORS

ステート・ストリート DC外国債券 インデックス・オープン

第19期運用報告書(全体版)
(決算日2021年2月22日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン」は、2021年2月22日に第19期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
15期('17年 2月20日)	18,118	0	△ 3.9	20,138	△ 3.2	98.8	-	12,752
16期('18年 2月20日)	18,543	0	2.3	20,746	3.0	98.8	-	13,575
17期('19年 2月20日)	18,816	0	1.5	21,185	2.1	98.9	-	14,033
18期('20年 2月20日)	19,961	0	6.1	22,616	6.8	98.5	-	15,370
19期('21年 2月22日)	20,259	0	1.5	23,125	2.3	99.0	-	16,045

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

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

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

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
'20年 2月20日	19,961	-	22,616	-	98.5	-
2月末	19,953	△ 0.0	22,601	△ 0.1	95.7	-
3月末	19,956	△ 0.0	22,612	△ 0.0	99.0	-
4月末	19,564	△ 2.0	22,215	△ 1.8	98.6	-
5月末	19,839	△ 0.6	22,534	△ 0.4	99.2	-
6月末	20,144	0.9	22,904	1.3	98.6	-
7月末	20,337	1.9	23,134	2.3	98.3	-
8月末	20,304	1.7	23,106	2.2	99.1	-
9月末	20,387	2.1	23,218	2.7	98.7	-
10月末	20,072	0.6	22,869	1.1	98.7	-
11月末	20,267	1.5	23,100	2.1	99.0	-
12月末	20,425	2.3	23,298	3.0	98.7	-
'21年 1月末	20,388	2.1	23,269	2.9	99.0	-
(期末)						
'21年 2月22日	20,259	1.5	23,125	2.3	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

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

当期の運用実績

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

基準価額とベンチマークの推移



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

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第19期	19,961円	20,259円	0円	+1.5%	+2.3%

当期末の基準価額は20,259円となり、前期末の19,961円に比べて298円の上昇となりました。当期の運用実績はベンチマークにほぼ連動した結果となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 期前半に米連邦準備制度理事会(FRB)が積極的な利下げを実施したことが米国債の利回り低下となり基準価額の上昇に寄与しました。
- 欧州委員会が欧州連合(EU)復興基金や欧州中央銀行(ECB)による積極的な緩和姿勢が好感され通貨ユーロが上昇したことが外貨建て資産の円貨評価額の上昇となり基準価額の上昇に寄与しました。

【マイナスの要因】

- 新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり対米ドルで円高が継続したことが外貨建て資産の円貨評価額の下落となり基準価額の下落に寄与しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+1.5%となり、ベンチマークの騰落率(+2.3%)を0.8%下回りました。主な要因は、以下の通りです。

【マイナスの要因】

- 信託報酬等の費用控除がマイナスに寄与しました。

収益分配金

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

投資環境

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、期前半、新型コロナウイルスが経済へ与える影響が懸念されたことが債券の買い材料となりました。FRBは2020年3月に2回の利下げを実施し、月間で合計1.50%の利下げを行ないました。期後半に入ると雇用統計をはじめとする経済指標に底堅さが見られることや新型コロナウイルスに対するワクチン開発の進展を背景に債券が売られました。期末にかけては財政支出の拡大見通しも債券の売り材料となりました。米国10年債利回りは、前期末の1.52%から1.37%への低下となりました。

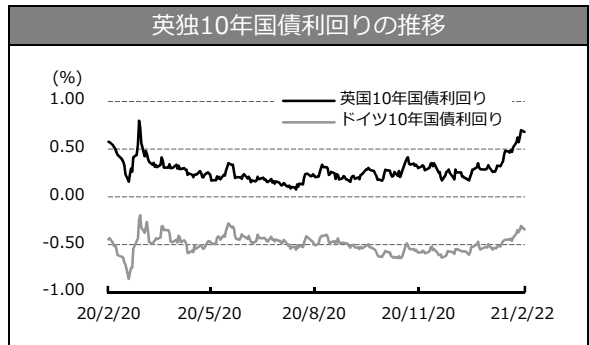
米国10年国債利回りの推移



欧州債券市場

欧州債券市場は、期前半、新型コロナウイルスを巡る懸念が独国債の買い材料となり、3月に独10年国債利回りが過去最低水準を更新しました。その後はECBが大型の緩和策の導入を決定した一方で利下げを見送ったことから債券利回りが反転上昇しました。期後半は、新型コロナウイルス感染拡大による厳格な都市封鎖による景気減速懸念が独国債の買い材料となりました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及を受け世界的に景気回復期待が高まったことを背景に独国債が売られました。独10年債利回りは前期末の-0.44%から上昇し-0.34%で期末を迎えました。英国債券市場は、期前半、欧州債に連動して利回りが大きく上下する展開となりました。期後半は、英国のEU離脱後の通商関係を巡る交渉が難航していることや新型コロナウイルス感染再拡大による制限措置に対する懸念の高まりが英国債の買い材料となりました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及への期待感と景気回復期待の高まりから債券が軟調となりました。英10年債利回りは前期末の0.58%から上昇し0.68%となりました。

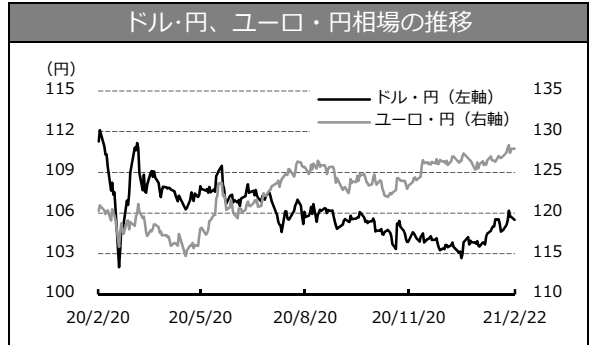
英独10年国債利回りの推移



為替市況

米ドル・円相場は、期前半、新型コロナウイルスを巡る懸念を背景に日本円が急上昇し、3月上旬には102円台まで円高が進みました。その後は急速な円高が調整となりました。期後半は、新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり円高基調が継続しました。前期末に111円台であった米ドル・円は105円台への円高ドル安となりました。

ユーロ・円相場は、期前半、新型コロナウイルスの影響に対する経済支援策として欧州委員会がEU復興基金案を公表したことが好感され、ユーロ高となりました。期後半も堅調な経済指標に加え、ECBの積極的な金融緩和が好感されてユーロ高となりました。前期末に120円台であったユーロ・円は127円台で当期末を迎えました。



運用の概況

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

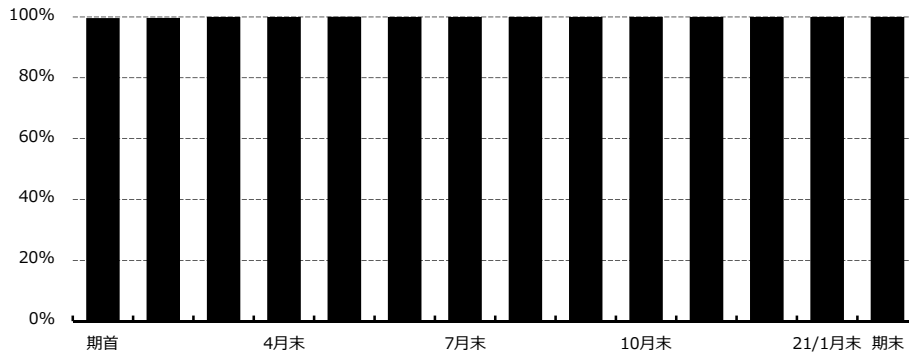
当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券(以下、マザーファンドといいます)を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ち、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

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

マザーファンドの組入状況

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

マザーファンド組入比率の推移



今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2020年2月21日~2021年2月22日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	20,136円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	122円	0.608%	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(45)	(0.221)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(67)	(0.332)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受託会社)	(11)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	13	0.065	(b)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(8)	(0.037)	・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び 資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(6)	(0.028)	・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	・その他は、LEI支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	135円	0.673%	

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

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

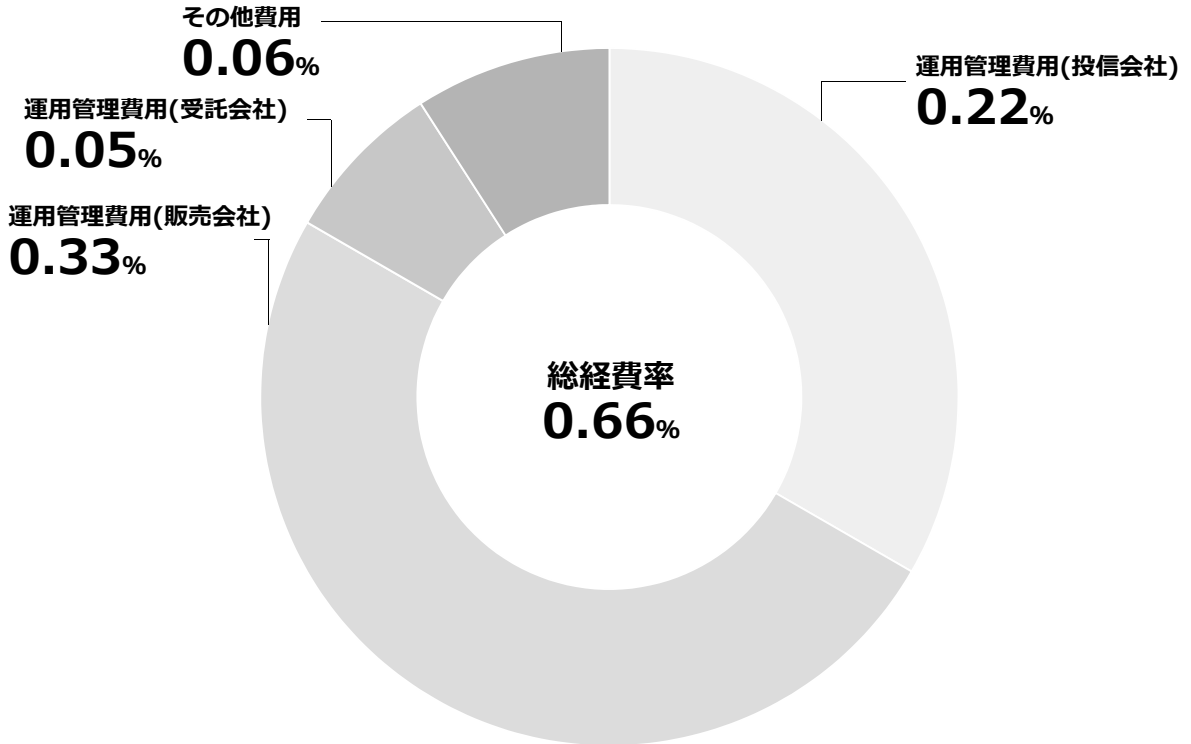
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した**総経費率(年率)は0.66%です。**



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

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

◎売買および取引の状況('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス・マザー・ファンド	663,248	1,631,968	501,520	1,229,550

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○公社債(外国債券インデックス・マザー・ファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 1.5% 27/1/31(アメリカ)	851,176	US TREASURY N/B 1.125% 21/6/30(アメリカ)	1,188,595
US TREASURY N/B 0.625% 30/8/15(アメリカ)	832,860	US TREASURY N/B 1.125% 21/7/31(アメリカ)	1,186,132
US TREASURY N/B 0.875% 30/11/15(アメリカ)	736,416	US TREASURY N/B 2.25% 21/3/31(アメリカ)	995,310
US TREASURY N/B 2% 25/2/15(アメリカ)	715,167	US TREASURY N/B 2.625% 21/6/15(アメリカ)	955,604
US TREASURY N/B 2.125% 24/7/31(アメリカ)	629,549	US TREASURY N/B 2% 21/2/28(アメリカ)	933,366
US TREASURY N/B 0.375% 27/9/30(アメリカ)	623,652	US TREASURY N/B 2% 21/5/31(アメリカ)	887,834
US TREASURY N/B 2.5% 23/8/15(アメリカ)	598,115	US TREASURY N/B 2% 21/11/15(アメリカ)	868,506
US TREASURY N/B 1.625% 50/11/15(アメリカ)	595,241	US TREASURY N/B 1.875% 26/7/31(アメリカ)	867,844
US TREASURY N/B 2.125% 25/5/15(アメリカ)	594,386	US TREASURY N/B 2.125% 21/8/15(アメリカ)	860,473
US TREASURY N/B 0.5% 27/6/30(アメリカ)	581,112	US TREASURY N/B 3.625% 21/2/15(アメリカ)	839,159

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○当期中の利害関係人との取引状況

外国債券インデックス・マザー・ファンド

決 算 期	当 期			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 取 引	百万円 37,077	百万円 472	% 1.3	百万円 78,574	百万円 472	% 0.6

平均保有割合 11.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(注1) 当期中における当該ベビーファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

○当期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	- 千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	- 千円
(B) / (A)	- %

(注) 売買委託手数料総額は、この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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、STATE STREET BANK AND TRUST COMPANYです。

◎組入資産の明細('21年2月22日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評価額
外国債券インデックス・マザー・ファンド	千口 6,291,104	千口 6,452,831	千円 16,044,966

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における外国債券インデックス・マザー・ファンド全体の口数は56,125,021千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('21年2月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス・マザー・ファンド	千円 16,044,966	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	73,906	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	16,118,872	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=105.50円、1カナダドル=83.72円、1メキシコペソ=5.15円、1ユーロ=127.91円、1英ポンド=147.98円、1スウェーデンクローナ=12.76円、1ノルウェークローネ=12.49円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=28.53円、1オーストラリアドル=83.19円、1シンガポールドル=79.75円、1マレーシアリンギット=26.12円、1イスラエルシエケル=32.23円です。

(注2) 外国債券インデックス・マザー・ファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(139,756,221千円)の投資信託財産総額(139,820,560千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('21年2月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	16,118,872,559
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	66,252,710
外国債券インデックス・マザー・ファンド(評価額)	16,044,966,131
未 収 入 金	7,653,718
(B) 負 債	73,133,960
未 払 解 約 金	22,186,116
未 払 信 託 報 酬	48,747,664
未 払 利 息	180
そ の 他 未 払 費 用	2,200,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	16,045,738,599
元 本	7,920,445,602
次 期 繰 越 損 益 金	8,125,292,997
(D) 受 益 権 総 口 数	7,920,445,602口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	20,259円

(注) 期首元本額	7,700,150,460円
期中追加設定元本額	1,585,559,825円
期中一部解約元本額	1,365,264,683円

◎損益の状況

当期(自'20年2月21日 至'21年2月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 37,068
支 払 利 息	△ 37,068
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	311,447,994
売 買 益	353,545,547
売 買 損	△ 42,097,553
(C) 信 託 報 酬 等	△ 99,116,314
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	212,294,612
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,856,768,889
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,056,229,496
(配 当 等 相 当 額)	(7,274,279,154)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,218,049,658)
(G) 計 (D+E+F)	8,125,292,997
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	8,125,292,997
追 加 信 託 差 損 益 金	6,056,229,496
(配 当 等 相 当 額)	(7,280,336,398)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,224,106,902)
分 配 準 備 積 立 金	2,788,368,990
繰 越 損 益 金	△ 719,305,489

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

(注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	250,904,279円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	収益調整金	7,280,336,398円
D	分配準備積立金	2,537,464,711円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	10,068,705,388円
F	分配対象収益(1万口当たり)	12,712円
G	分配金	0円
H	分配金(1万口当たり)	0円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第19期 (2020年2月21日～ 2021年2月22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	12,712円

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

第20期 運用報告書 (決算日2021年2月22日)

外国債券インデックス・マザー・ファンドの第20期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
16期('17年 2月20日)	21,692	△ 3.3	21,860	△ 3.2	98.8	-	168,254
17期('18年 2月20日)	22,339	3.0	22,520	3.0	98.8	-	172,418
18期('19年 2月20日)	22,809	2.1	22,997	2.1	98.9	-	145,994
19期('20年 2月20日)	24,348	6.7	24,550	6.8	98.8	-	178,554
20期('21年 2月22日)	24,865	2.1	25,103	2.3	99.0	-	139,557

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

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '20年 2月20日	24,348	-	24,550	-	98.8	-
2月末	24,342	△ 0.0	24,534	△ 0.1	96.1	-
3月末	24,358	0.0	24,546	△ 0.0	99.0	-
4月末	23,893	△ 1.9	24,114	△ 1.8	98.6	-
5月末	24,240	△ 0.4	24,461	△ 0.4	99.2	-
6月末	24,626	1.1	24,863	1.3	98.6	-
7月末	24,874	2.2	25,112	2.3	98.3	-
8月末	24,847	2.0	25,082	2.2	99.1	-
9月末	24,962	2.5	25,204	2.7	98.7	-
10月末	24,589	1.0	24,825	1.1	98.7	-
11月末	24,841	2.0	25,076	2.1	99.0	-
12月末	25,048	2.9	25,290	3.0	98.7	-
'21年 1月末	25,014	2.7	25,259	2.9	99.0	-
(期末) '21年 2月22日	24,865	2.1	25,103	2.3	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

当期の運用実績

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

基準価額とベンチマークの推移



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

当期末の基準価額は24,865円となり、前期末の24,348円に比べて517円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 期前半に米連邦準備制度理事会(FRB)が積極的な利下げを実施したことが米国債の利回り低下となり基準価額の上昇に寄与しました。
- 欧州委員会が欧州連合(EU)復興基金や欧州中央銀行(ECB)による積極的な緩和姿勢が好感され通貨ユーロが上昇したことが外貨建て資産の円貨評価額の上昇となり基準価額の上昇に寄与しました。

【マイナスの要因】

- 新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり対米ドルで円高が継続したことが外貨建て資産の円貨評価額の下落となり基準価額の下落に寄与しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+2.1%となり、ベンチマークの騰落率(+2.3%)とほぼ同水準となりました。主な要因は以下の通りです。

【プラスの要因】

- 設定解約に伴う信託財産留保金要因がプラスに寄与しました。設定解約に伴う債券の取引コストをカバーするという当初の目的が適正に機能したといえます。

【マイナスの要因】

- カストディフィー(保管費用等)の費用控除や債券の取引コストがマイナスに寄与しました。取引コストのマイナスは信託財産留保金により適正にカバーされています。

投資環境

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、期前半、新型コロナウイルスが経済へ与える影響が懸念されたことが債券の買い材料となりました。FRBは2020年3月に2回の利下げを実施し、月間で合計1.50%の利下げを行ないました。期後半に入ると雇用統計をはじめとする経済指標に底堅さが見られることや新型コロナウイルスに対するワクチン開発の進展を背景に債券が売られました。期末にかけては財政支出の拡大見通しも債券の売り材料となりました。米国10年債利回りは、前期末の1.52%から1.37%への低下となりました。

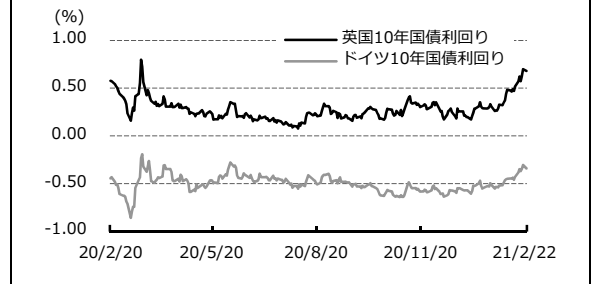
米国10年国債利回りの推移



欧州債券市場

欧州債券市場は、期前半、新型コロナウイルスを巡る懸念が独国債の買い材料となり、3月に独10年国債利回りが過去最低水準を更新しました。その後はECBが大型の緩和策の導入を決定した一方で利下げを見送ったことから債券利回りが反転上昇しました。期後半は、新型コロナウイルス感染拡大による厳格な都市封鎖による景気減速懸念が独国債の買い材料となりました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及を受け世界的に景気回復期待が高まったことを背景に独国債が売られました。独10年債利回りは前期末の-0.44%から上昇し-0.34%で期末を迎えました。英国債券市場は、期前半、欧州債に連動して利回りが大きく上下する展開となりました。期後半は、英国のEU離脱後の通商関係を巡る交渉が難航していることや新型コロナウイルス感染再拡大による制限措置に対する懸念の高まりが英国債の買い材料となりました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及への期待感と景気回復期待の高まりから債券が軟調となりました。英10年債利回りは前期末の0.58%から上昇し0.68%となりました。

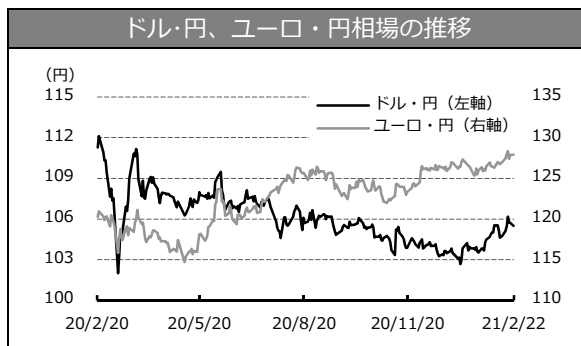
英独10年国債利回りの推移



為替市況

米ドル・円相場は、期前半、新型コロナウイルスを巡る懸念を背景に日本円が急上昇し、3月上旬には102円台まで円高が進みました。その後は急速な円高が調整となりました。期後半は、新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり円高基調が継続しました。前期末に111円台であった米ドル・円は105円台への円高ドル安となりました。

ユーロ・円相場は、期前半、新型コロナウイルスの影響に対する経済支援策として欧州委員会がEU復興基金案を公表したことが好感され、ユーロ高となりました。期後半も堅調な経済指標に加え、ECBの積極的な金融緩和が好感されてユーロ高となりました。前期末に120円台であったユーロ・円は127円台で当期末を迎えました。



運用の概況

(2020年2月21日から2021年2月22日まで)

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

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

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

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

今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2020年2月21日~2021年2月22日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	24,636円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (保管費用)	9円 (9)	0.037% (0.037)	(a)その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 ・ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ その他は、LEI支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	9円	0.037%	

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

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

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券 千米ドル 191,849	千米ドル 419,481
	カナダ	国債証券 千カナダドル 13,228	千カナダドル 21,040
	メキシコ	国債証券 千メキシコペソ 65,049	千メキシコペソ 129,463
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 42,863	47,279
	イタリア	国債証券 31,694	57,029
	フランス	国債証券 38,167	61,296
	オランダ	国債証券 5,269	10,705
	スペイン	国債証券 20,701	34,397
	ベルギー	国債証券 8,194	14,363
	オーストリア	国債証券 4,608	7,653
	フィンランド	国債証券 1,661	2,527
	アイルランド	国債証券 2,172	2,817
	イギリス	国債証券 千英ポンド 20,990	千英ポンド 34,609
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 4,948	千スウェーデンクローナ 9,561
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 5,893	千ノルウェークローネ 14,902
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 11,323	千デンマーククローネ 21,195
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 14,287	千ポーランドズロチ 18,288
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 17,637	千オーストラリアドル 15,086
国	シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 911	千シンガポールドル 2,241
	マレーシア	国債証券 千マレーシアリングギット 5,743	千マレーシアリングギット 11,847
	イスラエル	国債証券 千イスラエルシゲル 21,441	千イスラエルシゲル 1,109
	南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 2,245	千南アフリカランド 121,257

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。ただし、ユーロ建ての外国公社債は発行体の国籍によって区分しています。以下同じです。

(注4) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 1.5% 27/1/31(アメリカ)	851,176	US TREASURY N/B 1.125% 21/6/30(アメリカ)	1,188,595
US TREASURY N/B 0.625% 30/8/15(アメリカ)	832,860	US TREASURY N/B 1.125% 21/7/31(アメリカ)	1,186,132
US TREASURY N/B 0.875% 30/11/15(アメリカ)	736,416	US TREASURY N/B 2.25% 21/3/31(アメリカ)	995,310
US TREASURY N/B 2% 25/2/15(アメリカ)	715,167	US TREASURY N/B 2.625% 21/6/15(アメリカ)	955,604
US TREASURY N/B 2.125% 24/7/31(アメリカ)	629,549	US TREASURY N/B 2% 21/2/28(アメリカ)	933,366
US TREASURY N/B 0.375% 27/9/30(アメリカ)	623,652	US TREASURY N/B 2% 21/5/31(アメリカ)	887,834
US TREASURY N/B 2.5% 23/8/15(アメリカ)	598,115	US TREASURY N/B 2% 21/11/15(アメリカ)	868,506
US TREASURY N/B 1.625% 50/11/15(アメリカ)	595,241	US TREASURY N/B 1.875% 26/7/31(アメリカ)	867,844
US TREASURY N/B 2.125% 25/5/15(アメリカ)	594,386	US TREASURY N/B 2.125% 21/8/15(アメリカ)	860,473
US TREASURY N/B 0.5% 27/6/30(アメリカ)	581,112	US TREASURY N/B 3.625% 21/2/15(アメリカ)	839,159

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('20年2月21日から'21年2月22日まで)

○当期中の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 取 引	百万円 37,077	百万円 472	% 1.3	百万円 78,574	百万円 472	% 0.6

(注) 単位未満は切り捨てています。

○当期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	- 千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	- 千円
(B) / (A)	- %

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、STATE STREET BANK AND TRUST COMPANYです。

◎組入資産の明細('21年2月22日現在)

○外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 率	うちBB格 以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年 以上	2年 以上	2年 未満
ア メ リ カ	千米ドル 529,370	千米ドル 563,437	千円 59,442,621	% 42.6	% -	% 18.3	% 16.2	% 8.1
カ ナ ダ	千カナダドル 29,860	千カナダドル 32,738	2,740,870	2.0	-	0.9	0.7	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 187,600	千メキシコペソ 213,664	1,100,370	0.8	-	0.4	0.4	-
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	67,740	81,902	10,476,201	7.5	-	4.5	2.1	0.9
イ タ リ ア	86,130	104,557	13,373,925	9.6	-	6.1	2.4	1.1
フ ラ ン ス	95,010	115,348	14,754,229	10.6	-	7.1	2.8	0.6
オ ラ ン ダ	16,740	20,288	2,595,108	1.9	-	1.3	0.4	0.1
ス ペ イ ン	53,790	66,088	8,453,419	6.1	-	4.1	1.5	0.5
ベルギー	21,590	26,995	3,452,994	2.5	-	1.8	0.5	0.1
オーストリア	13,230	16,306	2,085,827	1.5	-	1.0	0.3	0.1
フィンランド	6,085	6,855	876,890	0.6	-	0.4	0.3	-
アイルランド	8,120	9,449	1,208,644	0.9	-	0.6	0.3	-
イ ギ リ ス	千英ポンド 48,090	千英ポンド 63,075	9,333,863	6.7	-	5.2	1.1	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 33,700	千スウェーデンクローナ 37,312	476,104	0.3	-	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークロネ 24,600	千ノルウェークロネ 25,645	320,312	0.2	-	0.1	0.1	-
デンマーク	千デンマーククロネ 32,950	千デンマーククロネ 41,882	720,381	0.5	-	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 27,500	千ポーランドズロチ 32,026	913,722	0.7	-	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 41,980	千オーストラリアドル 46,677	3,883,090	2.8	-	2.0	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 6,900	千シンガポールドル 7,664	611,211	0.4	-	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 24,250	千マレーシアリンギット 25,711	671,589	0.5	-	0.2	0.2	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 17,540	千イスラエルシェケル 19,799	638,152	0.5	-	0.2	0.1	0.1
合 計	-	-	138,129,530	99.0	-	55.3	30.6	13.1

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

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

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

(注4) 金額の単位未満は切り捨てています。

○外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	5.25	500	659	69,564	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	9,300	9,610	1,013,957	2022/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	6,300	6,511	686,978	2023/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	5,000	5,351	564,589	2026/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	2,400	3,164	333,897	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,000	2,158	227,739	2046/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	900	1,244	131,253	2036/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	900	1,298	136,983	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	7,700	7,844	827,581	2022/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	5,650	5,745	606,180	2022/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	5,800	5,940	626,671	2022/ 3/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	5,500	5,600	590,857	2022/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	5,500	5,616	592,534	2022/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	4,600	4,693	495,195	2022/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,300	3,369	355,439	2022/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,300	4,417	466,054	2022/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	4,500	4,603	485,654	2022/ 7/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,500	4,614	486,841	2022/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,000	5,112	539,368	2022/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	6,900	7,058	744,670	2022/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,000	3,078	324,808	2022/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,500	3,603	380,212	2022/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	10,000	10,260	1,082,487	2022/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,500	4,667	492,404	2022/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	4,900	5,055	533,347	2023/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	6,000	6,222	656,514	2023/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,500	5,776	609,443	2023/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	4,000	4,115	434,165	2023/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	5,800	6,007	633,842	2023/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,500	2,572	271,353	2023/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,000	4,253	448,704	2023/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	1,200	1,381	145,797	2023/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	5,300	5,607	591,628	2023/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	3,640	3,876	409,011	2023/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	5,000	5,157	544,149	2023/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	5,200	5,566	587,259	2023/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,000	5,195	548,105	2023/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,300	4,601	485,440	2023/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,000	4,215	444,715	2023/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,500	2,646	279,204	2023/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,000	3,180	335,514	2024/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	5,000	5,378	567,392	2024/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,000	4,229	446,232	2024/ 2/29

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,300	4,551	480,231	2024/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	3,500	3,694	389,818	2024/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,500	2,681	282,913	2024/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	5,000	5,283	557,377	2024/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	3,000	3,173	334,797	2024/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,500	5,846	616,764	2024/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	6,500	6,969	735,306	2024/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,500	4,747	500,824	2024/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,200	5,536	584,108	2024/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	6,200	6,637	700,295	2024/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	4,500	4,823	508,928	2024/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	4,500	4,873	514,195	2025/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	8,000	8,510	897,870	2025/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	5,100	5,578	588,555	2025/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	6,300	6,866	724,364	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	6,100	6,531	689,050	2025/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,900	5,382	567,857	2025/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,600	5,083	536,351	2025/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,500	4,803	506,721	2025/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.25	5,000	4,942	521,483	2025/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	4,300	4,785	504,915	2025/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	5,900	6,372	672,294	2025/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,800	5,325	561,787	2025/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,500	2,746	289,764	2025/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,600	2,858	301,579	2026/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	3,000	3,152	332,559	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	3,800	4,156	438,547	2026/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,500	3,786	399,511	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,500	4,726	498,654	2026/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	8,000	8,345	880,496	2026/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	2,000	2,082	219,736	2027/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	6,200	6,731	710,209	2027/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	5,500	6,016	634,761	2027/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	5,500	5,374	566,990	2027/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	4,200	4,065	428,906	2027/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,900	4,236	447,001	2027/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	6,000	5,790	610,869	2027/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,900	1,846	194,781	2027/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,400	3,695	389,848	2027/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,000	1,957	206,516	2027/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,800	1,759	185,627	2027/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	5,000	5,605	591,356	2028/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,300	4,862	512,996	2028/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.5	1,100	1,455	153,530	2028/ 8/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,500	3,963	418,117	2028/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,900	4,493	474,035	2028/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,000	5,578	588,574	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,500	2,741	289,238	2029/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,500	2,590	273,341	2029/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,000	3,137	331,051	2029/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	2,440	2,494	263,151	2030/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	5,400	5,092	537,209	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	8,000	7,513	792,700	2030/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	7,100	6,808	718,268	2030/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	500	704	74,334	2038/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,900	2,395	252,770	2039/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,200	1,655	174,668	2039/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,150	1,613	170,276	2039/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,000	1,408	148,598	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	3,200	2,770	292,235	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	900	1,194	125,994	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	3,150	2,716	286,578	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,000	1,391	146,789	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,000	2,704	285,295	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,000	1,479	156,082	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	800	1,047	110,560	2041/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,200	1,441	152,122	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,700	2,044	215,696	2042/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,400	1,587	167,437	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,400	1,586	167,339	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	2,000	2,403	253,579	2043/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,000	3,467	365,817	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,400	1,812	191,265	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	2,600	3,370	355,539	2044/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	2,500	3,005	317,066	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,500	2,702	285,107	2045/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,300	2,711	286,099	2045/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,400	2,772	292,475	2045/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,600	1,889	199,342	2045/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,300	2,366	249,654	2046/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,800	2,080	219,542	2046/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,000	2,367	249,730	2047/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,400	1,658	174,937	2047/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,500	1,698	179,199	2047/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,900	2,151	227,017	2047/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,550	3,024	319,109	2048/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	2,600	3,153	332,738	2048/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,700	3,206	338,303	2048/ 8/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	3,000	3,809	401,917	2048/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,800	3,332	351,537	2049/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,350	3,898	411,256	2049/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,000	3,079	324,907	2049/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,900	3,057	322,597	2049/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,840	2,758	291,005	2050/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	3,600	2,893	305,308	2050/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,500	3,738	394,413	2050/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,000	4,428	467,249	2050/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	400	555	58,593	2038/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	500	734	77,532	2037/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.0	2,000	2,530	266,964	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.375	500	692	73,048	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.125	300	402	42,478	2027/11/15
小計					59,442,621	
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	900	1,237	103,573	2029/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	750	759	63,547	2027/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	650	977	81,799	2037/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	6,700	6,917	579,159	2022/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,850	3,957	331,337	2023/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,100	1,162	97,340	2024/ 3/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,600	2,777	232,523	2024/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	3,300	3,530	295,565	2025/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,550	1,610	134,816	2026/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	700	754	63,173	2028/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	3,000	3,035	254,093	2030/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	950	1,286	107,737	2045/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	1,050	1,277	106,923	2048/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,200	1,262	105,683	2051/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	400	517	43,290	2064/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	500	747	62,617	2033/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	660	927	77,687	2041/ 6/ 1
小計					2,740,870	
(メキシコ)			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	12,500	14,161	72,933	2031/ 5/29
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.75	22,000	23,130	119,121	2023/ 3/ 9
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	39,000	42,823	220,539	2023/12/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	30,000	35,644	183,569	2024/12/ 5
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	19,600	21,977	113,181	2027/ 6/ 3
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	19,000	22,559	116,181	2029/ 5/31
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	6,500	7,352	37,863	2034/11/23
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	9,000	12,060	62,114	2036/11/20
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	10,700	12,638	65,085	2038/11/18

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)			千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	8,500	9,280	47,794	2042/11/13
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	10,800	12,036	61,985	2047/11/ 7
小計					1,100,370	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	3,000	3,143	402,046	2025/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,200	3,441	440,194	2025/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,000	2,102	268,884	2027/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,500	2,675	342,175	2027/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,250	2,114	270,434	2042/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,900	3,041	389,045	2046/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,350	3,461	442,726	2022/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	4,350	4,497	575,229	2022/ 9/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,600	1,670	213,689	2023/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,100	3,253	416,202	2023/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	3,100	3,310	423,429	2023/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,600	2,787	356,500	2024/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,200	3,392	433,873	2024/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,000	2,115	270,544	2026/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,200	2,324	297,365	2028/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,500	1,586	202,929	2029/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,243	159,077	2029/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,656	211,890	2030/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,557	199,179	2030/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,350	1,370	175,301	2035/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,800	2,819	360,606	2044/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,850	2,388	305,516	2048/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	942	120,606	2050/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,800	2,514	321,584	2028/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.625	1,200	1,720	220,108	2028/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,700	2,821	360,930	2037/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,200	2,154	275,537	2039/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,600	2,681	342,952	2034/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,290	2,490	318,599	2040/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	2,100	3,344	427,740	2031/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	1,450	1,742	222,932	2024/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	1,250	2,009	256,992	2030/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5	1,000	1,460	186,803	2027/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,000	2,068	264,568	2026/ 8/15
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,900	2,325	297,474	2026/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,900	2,717	347,595	2037/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	2,100	3,195	408,696	2034/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.25	800	1,124	143,791	2026/11/ 1

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0	1,700	2,125	271,874	2023/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,700	2,784	356,176	2039/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.25	2,000	2,817	360,348	2029/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,200	1,882	240,774	2033/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	2,700	4,132	528,563	2031/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,700	1,793	229,429	2022/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	2,800	2,851	364,684	2022/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	2,800	3,049	390,033	2022/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	3,500	3,844	491,785	2022/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.95	2,500	2,566	328,232	2023/ 3/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	2,500	2,811	359,570	2023/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	2,100	2,151	275,232	2023/10/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	2,000	2,285	292,294	2024/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	1,700	1,812	231,798	2024/ 5/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	2,200	2,502	320,069	2024/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	2,300	2,342	299,578	2025/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	2,500	3,013	385,426	2025/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,800	2,987	382,075	2025/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,800	1,972	252,318	2025/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	2,100	2,269	290,346	2026/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,900	2,023	258,773	2026/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	1,700	1,912	244,643	2027/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.05	2,700	3,015	385,694	2027/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	3,100	3,465	443,310	2028/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,600	2,120	271,236	2028/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,400	1,659	212,318	2028/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,400	3,035	388,270	2030/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	2,500	2,688	343,858	2030/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,250	1,376	176,115	2030/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,840	2,026	259,178	2032/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	1,000	1,192	152,556	2033/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.35	1,000	1,316	168,408	2035/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,400	1,649	211,050	2036/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	1,200	1,547	197,904	2038/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	2,000	3,305	422,821	2040/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	520	567	72,629	2041/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,200	2,015	257,834	2044/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,100	1,529	195,587	2046/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	1,100	1,400	179,130	2047/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	1,050	1,515	193,879	2048/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	850	1,314	168,176	2049/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	900	1,097	140,440	2050/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	120	124	15,935	2051/ 9/ 1

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,000	1,297	165,996	2067/ 3/ 1
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	2,400	4,301	550,236	2041/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,250	2,599	332,468	2060/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	3,000	3,128	400,150	2022/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	3,600	3,775	482,862	2022/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,800	2,837	362,904	2023/ 3/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	2,800	2,951	377,514	2023/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,100	2,138	273,570	2024/ 3/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	3,200	3,499	447,568	2024/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	4,150	4,335	554,522	2025/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	3,200	3,868	494,841	2026/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,800	2,943	376,532	2026/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,300	2,501	319,993	2027/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,900	3,510	449,077	2027/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,500	2,691	344,323	2028/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,500	2,696	344,944	2028/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,000	2,117	270,831	2029/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,000	3,041	388,990	2029/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	3,900	4,857	621,309	2030/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	1,006	128,785	2030/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,200	2,518	322,122	2034/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,350	2,702	345,672	2036/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,460	1,822	233,115	2039/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	650	657	84,100	2040/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,050	2,752	352,058	2048/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,800	2,192	280,381	2050/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,900	3,128	400,159	2035/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	2,600	3,838	490,965	2029/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	2,100	3,511	449,218	2032/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	2,700	3,537	452,426	2025/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,500	2,681	342,934	2025/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,300	3,825	489,268	2031/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,700	2,750	351,763	2045/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,650	2,699	345,270	2038/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	1,200	1,440	184,198	2023/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,750	3,473	444,348	2055/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	3,700	4,188	535,733	2023/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,200	3,481	445,355	2024/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	3,600	3,740	478,447	2026/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,200	1,604	205,257	2066/ 5/25
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	1,080	1,891	241,940	2042/ 1/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,050	1,720	220,115	2037/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	2,000	2,117	270,826	2023/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,500	1,636	209,316	2024/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,100	1,141	145,997	2025/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,200	1,267	162,188	2026/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,100	1,186	151,804	2027/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,000	1,085	138,907	2028/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	900	943	120,676	2029/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	750	767	98,191	2030/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	750	988	126,385	2033/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	600	645	82,506	2040/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	1,050	1,728	221,084	2047/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	440	402	51,513	2052/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	520	564	72,148	2023/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	900	1,275	163,133	2028/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	800	925	118,371	2023/ 1/15
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	1,800	1,819	232,790	2022/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.45	1,500	1,524	194,982	2022/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	1,500	1,671	213,864	2023/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4	2,500	2,829	361,977	2023/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8	1,800	2,079	266,049	2024/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	2,200	2,498	319,541	2024/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,400	2,677	342,435	2024/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	1,650	1,783	228,080	2025/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.65	1,800	2,197	281,108	2025/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	2,000	2,168	277,312	2026/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,900	2,090	267,370	2027/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	2,000	2,198	281,261	2027/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,400	1,539	196,920	2028/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,200	1,322	169,113	2028/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,400	1,551	198,513	2029/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,400	1,452	185,774	2029/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,500	1,537	196,633	2030/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	2,800	3,245	415,153	2030/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	1,400	1,711	218,887	2033/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	1,300	1,515	193,836	2035/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7	1,550	2,645	338,368	2041/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	900	1,682	215,266	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	900	1,233	157,775	2048/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	950	903	115,566	2050/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	2,200	2,451	313,594	2025/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	1,100	1,546	197,832	2046/10/31

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	1,300	1,989	254,534	2037/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9	1,570	2,710	346,684	2040/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9	2,300	3,064	392,008	2026/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	1,400	1,945	248,857	2028/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	870	1,421	181,872	2066/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	1,500	2,201	281,614	2029/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,800	2,875	367,835	2032/ 7/30
(ベルギー)						
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,000	1,079	138,025	2022/ 9/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,600	1,709	218,603	2023/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	1,700	1,883	240,901	2024/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	1,700	1,799	230,233	2025/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,000	1,257	160,849	2026/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,100	1,187	151,850	2026/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	900	967	123,811	2027/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	550	594	76,076	2028/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	900	983	125,827	2029/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	300	306	39,166	2030/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	900	997	127,609	2031/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	700	1,012	129,480	2032/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	500	571	73,102	2033/ 4/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	600	826	105,721	2034/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	400	471	60,370	2037/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	600	755	96,682	2038/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	160	158	20,258	2040/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,200	2,069	264,678	2041/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	620	1,061	135,789	2045/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	750	917	117,421	2047/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	500	629	80,568	2050/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	410	595	76,116	2057/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	430	629	80,503	2066/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	370	388	49,750	2022/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,500	2,129	272,423	2028/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,200	2,010	257,170	2035/ 3/28
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.65	800	839	107,418	2022/ 4/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4	650	696	89,044	2022/11/22
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,300	1,382	176,826	2023/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	950	1,029	131,637	2024/10/21
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2	950	1,028	131,534	2025/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.85	750	957	122,491	2026/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,250	1,337	171,101	2026/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	750	809	103,518	2028/ 2/20

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	800	849	108,706	2029/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	480	487	62,368	2030/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	550	721	92,290	2034/ 5/23
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	450	737	94,312	2044/ 6/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	480	609	77,914	2047/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	220	236	30,260	2051/ 3/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	380	828	105,952	2062/ 1/26
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	230	323	41,379	2086/11/ 2
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1	270	486	62,165	2117/ 9/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.85	170	171	21,910	2120/ 6/30
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.15	950	1,557	199,163	2037/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	850	1,218	155,827	2027/ 7/15
(フィンランド)						
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	520	544	69,637	2023/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	700	758	97,075	2024/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	511	65,379	2024/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	430	452	57,907	2026/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	370	392	50,201	2027/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	500	615	78,776	2028/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	150	159	20,383	2028/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	220	233	29,921	2029/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	380	414	52,981	2031/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.125	500	570	72,919	2034/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	350	348	44,609	2036/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.625	265	394	50,469	2042/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	280	351	45,012	2047/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	920	1,107	141,612	2025/ 7/ 4
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	1,000	1,241	158,860	2025/ 3/13
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	450	549	70,294	2037/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	800	874	111,910	2023/ 3/20
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	190	194	24,925	2035/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	520	564	72,173	2028/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	900	967	123,766	2026/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1	650	718	91,888	2029/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	450	515	65,964	2033/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	650	741	94,831	2031/ 3/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	330	402	51,426	2050/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	580	772	98,850	2045/ 2/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	1,000	1,232	157,627	2030/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4	600	673	86,123	2024/ 3/18
小計					57,277,239	

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,400	2,422	358,448	2049/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,600	2,617	387,354	2042/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,100	1,599	236,764	2034/9/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,000	1,525	225,808	2039/9/7
UK GILT BOND	国債証券	4.0	1,000	1,875	277,498	2060/1/22
UK GILT BOND	国債証券	5.0	1,500	1,791	265,148	2025/3/7
UK GILT BOND	国債証券	2.25	3,100	3,273	484,401	2023/9/7
UK GILT BOND	国債証券	2.0	2,100	2,270	336,043	2025/9/7
UK GILT BOND	国債証券	1.5	1,800	1,918	283,856	2026/7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	950	1,471	217,717	2040/12/7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	1,500	2,206	326,532	2045/1/22
UK GILT BOND	国債証券	3.75	1,400	2,317	343,016	2052/7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,650	2,395	354,530	2036/3/7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	1,500	2,077	307,406	2030/12/7
UK GILT BOND	国債証券	6.0	500	708	104,838	2028/12/7
UK GILT BOND	国債証券	0.375	600	581	86,062	2030/10/22
UK GILT BOND	国債証券	0.875	1,300	1,328	196,574	2029/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.25	1,500	1,581	234,058	2027/7/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	1,550	1,681	248,834	2028/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	790	954	141,299	2071/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.0	1,500	1,543	228,363	2024/4/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	2,650	2,722	402,871	2022/9/7
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,000	1,120	165,835	2049/1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,300	1,507	223,115	2057/7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.5	900	1,313	194,440	2065/7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.75	1,200	1,311	194,139	2024/9/7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	1,000	1,855	274,596	2068/7/22
UK GILT BOND	国債証券	3.25	1,450	2,039	301,869	2044/1/22
UK GILT BOND	国債証券	4.0	800	833	123,342	2022/3/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,600	2,664	394,334	2046/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,700	2,331	344,991	2032/6/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,100	1,383	204,717	2027/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,250	2,322	343,739	2055/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	900	1,435	212,395	2038/12/7
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,900	2,087	308,915	2037/9/7
小計					9,333,863	
(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		
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	6,000	6,362	81,183	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	8,000	8,391	107,076	2022/6/1
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	9,000	9,443	120,500	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	4,200	4,400	56,153	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,200	2,302	29,385	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	4,300	6,410	81,804	2039/3/30
小計					476,104	

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,500	3,612	45,118	2026/ 2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	4,000	4,296	53,657	2024/ 3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	4,500	4,698	58,689	2027/ 2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	5,300	5,525	69,015	2029/ 9/ 6
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	1,500	1,511	18,874	2030/ 8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	5,800	6,001	74,956	2023/ 5/24
小計					320,312	
(デンマーク)			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,600	1,621	27,898	2022/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	6,300	6,657	114,508	2023/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	6,500	7,189	123,660	2025/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	4,000	4,228	72,727	2027/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	4,000	4,248	73,069	2029/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	9,200	16,626	285,974	2039/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,350	1,310	22,542	2052/11/15
小計					720,381	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	3,500	3,855	110,007	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	3,400	3,802	108,497	2025/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,300	2,518	71,849	2026/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	7,400	10,116	288,635	2029/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,600	1,588	45,306	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	9,300	10,144	289,426	2022/ 9/23
小計					913,722	
(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		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	2,250	2,427	201,970	2022/ 7/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	2,700	3,012	250,612	2023/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,400	2,598	216,177	2024/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	3,800	4,254	353,950	2025/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	4,200	4,990	415,131	2026/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,800	2,233	185,773	2027/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	1,800	2,019	167,986	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	2,400	2,612	217,320	2028/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	1,580	1,777	147,828	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	3,200	3,727	310,091	2029/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	4,300	4,748	395,020	2030/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,900	3,760	312,857	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,700	1,651	137,408	2032/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,250	1,658	137,946	2033/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	750	843	70,135	2035/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	700	828	68,939	2039/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	420	461	38,364	2041/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,000	1,136	94,505	2047/ 3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	930	802	66,769	2051/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	900	1,133	94,299	2037/ 4/21
小計					3,883,090	

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.125	2,100	2,190	174,680	2022/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	1,000	1,155	92,128	2027/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	1,250	1,345	107,333	2025/ 6/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	700	806	64,321	2030/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	350	427	34,115	2033/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	250	281	22,446	2039/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	350	418	33,388	2042/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	540	659	52,603	2046/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	360	378	30,195	2050/ 3/ 1
小計					611,211	
(マレーシア)			千マレーシアリングgit	千マレーシアリングgit		
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.502	1,000	1,051	27,473	2027/ 5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.065	2,300	2,247	58,712	2050/ 6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.418	3,000	3,067	80,122	2022/ 8/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.48	5,300	5,466	142,786	2023/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.955	4,400	4,721	123,318	2025/ 9/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	2,000	2,146	56,074	2026/11/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.498	1,700	1,896	49,535	2030/ 4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.935	1,300	1,485	38,813	2043/ 9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.736	1,550	1,708	44,628	2046/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.921	1,700	1,918	50,123	2048/ 7/ 6
小計					671,589	
(イスラエル)			千イスラエルシエケル	千イスラエルシエケル		
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,500	1,582	51,011	2022/ 1/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	2,980	3,049	98,278	2022/11/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	3,250	3,381	108,979	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,600	1,712	55,195	2025/ 8/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	2,800	3,087	99,494	2027/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,200	1,338	43,133	2028/ 9/28
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,300	1,308	42,179	2030/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,350	2,217	71,463	2042/ 1/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	—	1,560	2,122	68,416	2047/ 3/31
小計					638,152	
合計					138,129,530	

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('21年2月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 138,129,530	% 98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,691,030	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	139,820,560	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=105.50円、1カナダドル=83.72円、1メキシコペソ=5.15円、1ユーロ=127.91円、1英ポンド=147.98円、1スウェーデンクローナ=12.76円、1ノルウェークローネ=12.49円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=28.53円、1オーストラリアドル=83.19円、1シンガポールドル=79.75円、1マレーシアリングギット=26.12円、1イスラエルシェケル=32.23円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(139,756,221千円)の投資信託財産総額(139,820,560千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('21年2月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	140,077,833,404
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	325,460,074
公 社 債 (評 価 額)	138,129,530,256
未 収 入 金	648,823,888
未 収 利 息	941,126,587
前 払 費 用	32,892,599
(B) 負 債	520,545,295
未 払 金	257,401,000
未 払 解 約 金	263,144,116
未 払 利 息	175
そ の 他 未 払 費 用	4
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	139,557,288,109
元 本	56,125,021,105
次 期 繰 越 損 益 金	83,432,267,004
(D) 受 益 権 総 口 数	56,125,021,105口
1万口当たり基準価額 (C / D × 10,000)	24,865円

- (注1) 期首元本額 73,334,845,875円
 期中追加設定元本額 13,977,898,071円
 期中一部解約元本額 31,187,722,841円
 (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフアンド別
 内訳は、次の通りです。

ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,452,831,744円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	26,257,605円
AMC/ステート・ストリート・リスクジェット型/ランス・オープン (ステابل)	88,566,395円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き (年金) <適格機関投資家限定>	4,747,875,742円
外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,307,563,720円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	2,175,827円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	183,758,012円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	78,138円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	5,656,170円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	4,384,806円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	6,797,722,184円
外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	91,789,915円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	1,478,376円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,499,101,282円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,220,574,038円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	31,271,771円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	825,024,786円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	3,569,958,212円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	933,979,159円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	2,678,768,938円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	81,154,270円
外国債券インデックス・ファンド (年金) <適格機関投資家限定>	158,208,287円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	97,480,808円

◎損益の状況

当期 (自 '20年2月21日 至 '21年2月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	3,251,067,393
受 取 利 息	3,253,013,020
支 払 利 息	△ 1,945,627
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 777,874,384
売 買 益	7,857,670,536
売 買 損	△ 8,635,544,920
(C) そ の 他 費 用	△ 53,167,446
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,420,025,563
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	105,220,119,554
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	20,365,860,494
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 44,573,738,607
(H) 計 (D + E + F + G)	83,432,267,004
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	83,432,267,004

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

グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	54,679,175円
外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	7,101,345,280円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	44,247,215円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	624,624,601円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,339,798円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,903,450円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	3,486,611,388円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	914,770,303円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,655,521,939円
外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	1,062,611,625円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	33,554,864円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金) <適格機関投資家限定>	292,329,694円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	91,235,383円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	88,152,516円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	3,832,211,540円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	3,702,495,339円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	31,267,872円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	148,264,459円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	2,191,947円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	1,058,247,755円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	74,604,035円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	16,150,742円