

○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、委託者が基準準額水準、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20期運用報告書(全体版)
(決算日2022年2月21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、2022年2月21日に第20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
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
20期('22年 2月21日)	20,457	0	1.0	23,499	1.6	99.6	-	16,487

(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	%		%	%	%
'21年 2月22日	20,259	-	23,125	-	99.0	-
2月末	20,197	△ 0.3	23,056	△ 0.3	99.1	-
3月末	20,630	1.8	23,568	1.9	99.1	-
4月末	20,612	1.7	23,566	1.9	98.7	-
5月末	20,871	3.0	23,870	3.2	99.1	-
6月末	20,834	2.8	23,843	3.1	99.2	-
7月末	20,967	3.5	24,004	3.8	98.9	-
8月末	20,953	3.4	24,001	3.8	99.0	-
9月末	20,796	2.7	23,836	3.1	99.0	-
10月末	21,236	4.8	24,344	5.3	99.1	-
11月末	20,989	3.6	24,075	4.1	98.9	-
12月末	21,109	4.2	24,226	4.8	99.1	-
'22年 1月末	20,737	2.4	23,812	3.0	99.1	-
(期末)						
'22年 2月21日	20,457	1.0	23,499	1.6	99.6	-

(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。

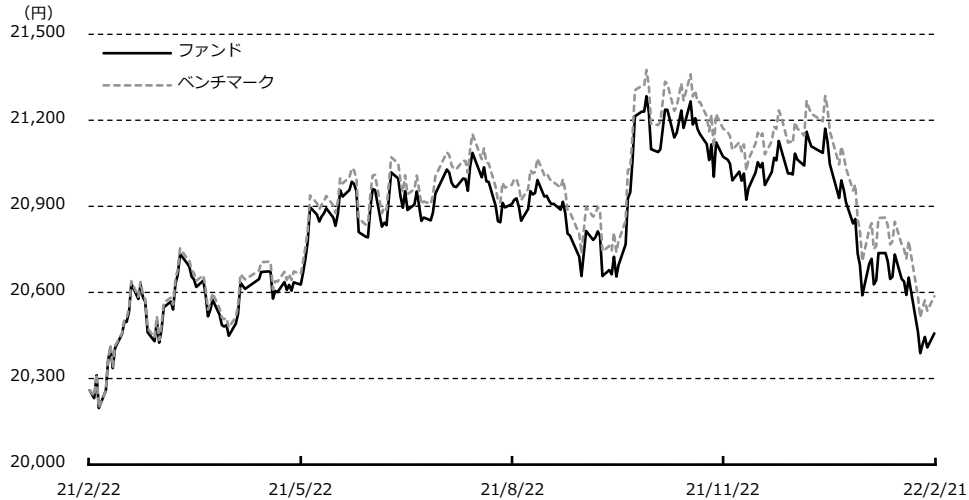
(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(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

(2021年2月23日から2022年2月21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20期	20,259円	20,457円	0円	+1.0%	+1.6%

当期末の基準価額は20,457円となり、前期末の20,259円に比べて198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】

- 期前半にパウエル米連邦準備制度理事会(FRB)議長が足元のインフレ率の上昇は一時的なものとの見方を示したことが債券の買い材料となり基準価額の上昇に寄与しました。
- 期後半にFRBが金融緩和策の段階的縮小や早期利上げを実施するとの見方を背景に米国債の利回りが上昇し、日米金利差から円安ドル高となったことが基準価額の上昇に寄与しました。

【マイナスの要因】

- 世界的にインフレ上昇圧力が懸念される中、各国中央銀行が金融政策正常化へ向かうとの観測が債券利回りの上昇(債券価格の下落)につなが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+1.0%となり、ベンチマークの騰落率(+1.6%)を0.6%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

(2021年2月23日から2022年2月21日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、期前半は7月に発表された消費者物価指数(CPI)が事前予想を上回りましたが、パウエルFRB議長が足元のインフレ率の上昇は一時的なものとの見方を示したことが債券の買い材料となりました。期後半は継続的にCPIが上昇したことでインフレ懸念の広がりから金融政策の引き締め加速に対する警戒感が強まり債券が売られました。米国10年債利回りは前期末の1.37%から1.93%へ上昇しました。

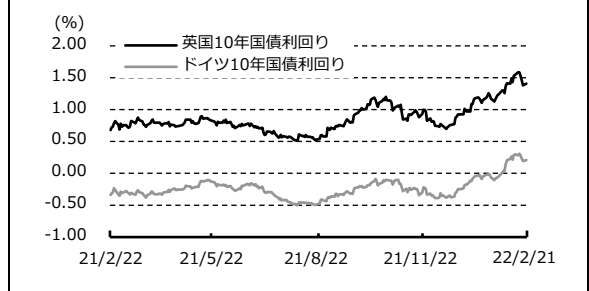
米国10年国債利回りの推移



欧州債券市場

欧州債券市場は、期前半は5月にユーロ圏小売売上高が事前予想を上回る上昇となるなど、堅調な経済指標を背景に独国債が売られ独10年国債利回りがおよそ2年ぶり高水準となりました。その後は利回りの水準感から独国債が買われました。期後半は9月に欧州中央銀行(ECB)がパンデミック緊急購入プログラムの購入ペースの低減を決定したことを背景に独国債が売られました。その後も資源価格高騰を受けたインフレ懸念が強まる中、ECBによる金融政策の正常化前倒し観測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-0.34%から上昇し0.21%で期末を迎えました。英国債券市場は、9月にイングランド銀行(BOE)が金融政策決定会合においてインフレ率が4%を超えるとの見通しを示すと早期利上げ観測の高まりから債券が売られました。BOEは12月と2月にそれぞれ0.15%と0.25%の利上げを実施しました。英10年債利回りは前期末の0.68%から上昇し1.41%となりました。

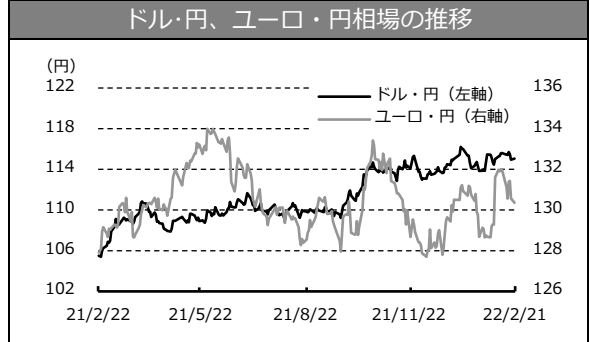
英独10年国債利回りの推移



為替市況

米ドル・円相場は、期前半はレンジ内での動きに留まりましたが、期後半、米国の金融緩和策の段階的縮小や早期利上げ期待を背景に米ドルが買われました。期末にかけては米国長期金利の上昇を背景とした円安ドル高とウクライナ情勢の緊迫化によるリスク回避の円買いの動きが交錯し方向感に欠ける展開となりました。前期末に105円台であった米ドル・円は115円台への円安ドル高となりました。

ユーロ・円相場は、期前半、独国債利回りが上昇したことに伴いユーロが円に対して強含みとなりましたが、その後は独国債利回りが低下へ転じるとユーロも円に対して売られる展開となりました。期後半は、ECBによる金融政策の正常化前倒し観測を背景に一時ユーロが対円で上昇したものの、上昇トレンドには至らずに売り戻されレンジ内での動きとなりました。前期末に127円台であったユーロ・円は130円台への円安ユーロ高となり当期末を迎えました。



運用の概況

(2021年2月23日から2022年2月21日まで)

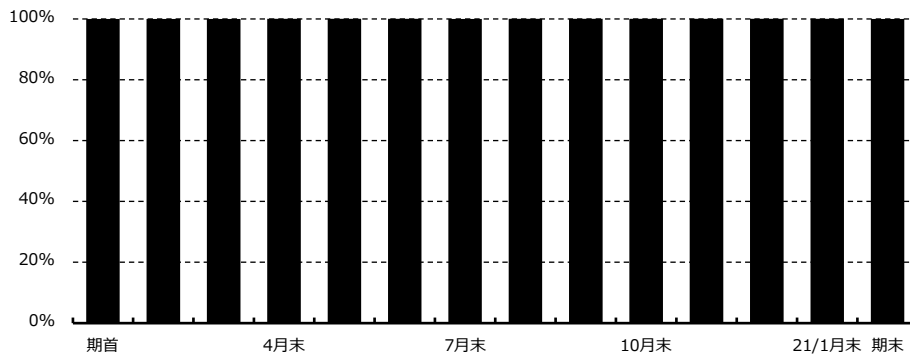
当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券(以下、マザーファンドといいます)を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ち、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

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

当期末、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 (2021年2月23日~2022年2月21日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	20,827円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	126円	0.603%	(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）	（ 46）	（0.219）	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	（ 69）	（0.329）	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	12	0.059	(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）	（ 7）	（0.032）	・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）	（ 5）	（0.026）	・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）	（0.001）	・その他は、LEI支払手数料、金銭信託手数料及び信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	138円	0.662%	

(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。

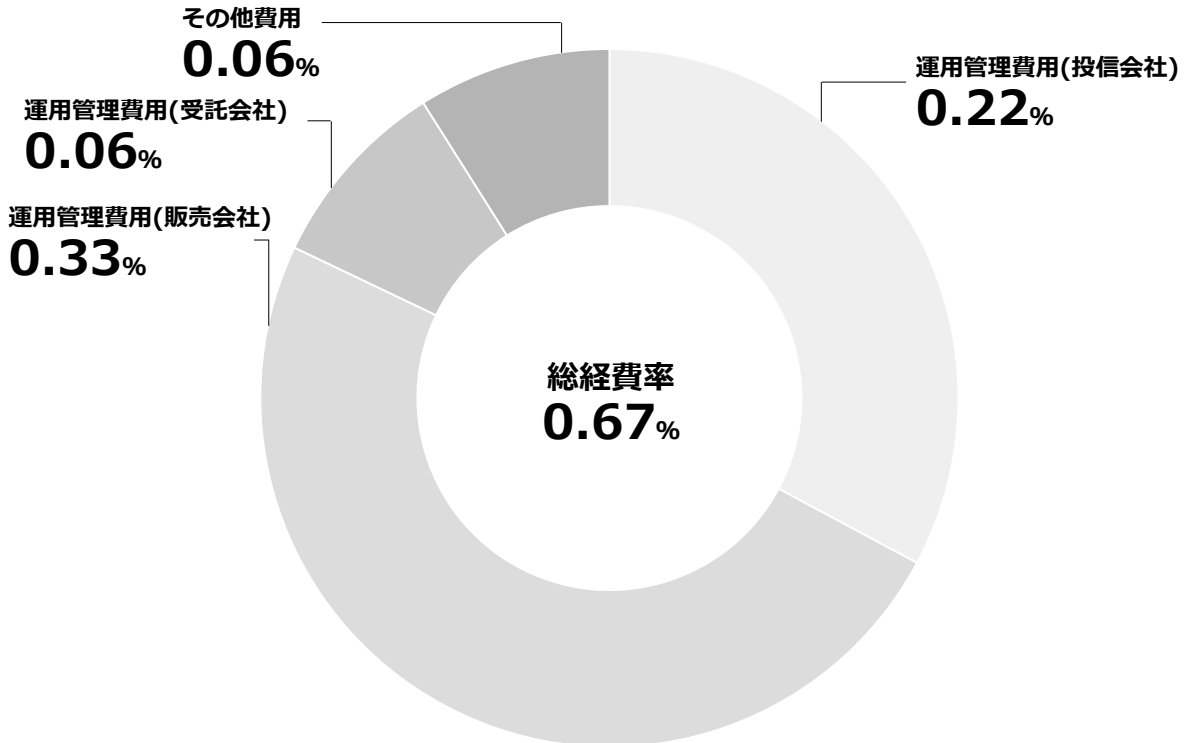
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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**0.67%**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('21年2月23日から'22年2月21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	464,693	1,191,091	391,790	1,003,970

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('21年2月23日から'22年2月21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% 23/3/31(アメリカ)	1,229,917	US TREASURY N/B 1.625% 22/11/15(アメリカ)	1,160,522
US TREASURY N/B 0.875% 26/6/30(アメリカ)	1,195,705	US TREASURY N/B 2% 22/11/30(アメリカ)	1,087,736
US TREASURY N/B 2.125% 24/3/31(アメリカ)	938,686	US TREASURY N/B 2% 22/2/15(アメリカ)	867,951
US TREASURY N/B 1.25% 31/8/15(アメリカ)	764,967	US TREASURY N/B 2.125% 24/3/31(アメリカ)	863,079
US TREASURY N/B 1.125% 31/2/15(アメリカ)	739,615	US TREASURY N/B 2% 25/2/15(アメリカ)	838,324
US TREASURY N/B 0.75% 26/3/31(アメリカ)	734,794	US TREASURY N/B 1.625% 22/8/31(アメリカ)	795,107
US TREASURY N/B 1.625% 31/5/15(アメリカ)	710,111	US TREASURY N/B 0.875% 26/6/30(アメリカ)	755,817
US TREASURY N/B 1.25% 28/5/31(アメリカ)	677,095	US TREASURY N/B 1.5% 23/3/31(アメリカ)	695,420
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.69% 26/8/12(中国)	636,241	US TREASURY N/B 2.375% 22/3/15(アメリカ)	645,466
US TREASURY N/B 2.375% 51/5/15(アメリカ)	596,569	US TREASURY N/B 0.75% 26/3/31(アメリカ)	627,856

(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('21年2月23日から'22年2月21日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 当決算時より利害関係人との為替取引における集計方法を変更しています。

※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('22年2月21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
	千口	千口	千円
外国債券インデックス・マザー・ファンド	6,452,831	6,525,734	16,486,616

(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44,829,220千口です。

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('22年2月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス・マザー・ファンド	16,486,616	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	76,628	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	16,563,244	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=115.06円、1カナダドル=90.31円、1メキシコペソ=5.6782円、1ユーロ=130.36円、1英ポンド=156.56円、1スウェーデンクローナ=12.24円、1ノルウェークローネ=12.83円、1デンマーククローネ=17.53円、1ポーランドズロチ=28.7749円、1オーストラリアドル=82.72円、1シンガポールドル=85.55円、1マレーシアリンギット=27.4718円、1人民元=18.1996円、1イスラエルシェケル=35.8992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(113,378,568千円)の投資信託財産総額(114,088,893千円)に対する比率は99.4%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

(’22年2月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	16,563,244,265
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	64,824,360
外国債券インデックス・マザー・ファンド(評価額)	16,486,616,873
未 収 入 金	11,803,032
(B) 負 債	75,855,535
未 払 解 約 金	22,848,229
未 払 信 託 報 酬	50,807,119
未 払 利 息	174
そ の 他 未 払 費 用	2,200,013
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	16,487,388,730
元 本	8,059,568,172
次 期 繰 越 損 益 金	8,427,820,558
(D) 受 益 権 総 口 数	8,059,568,172口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	20,457円

(注) 期首元本額	7,920,445,602円
期中追加設定元本額	1,281,320,451円
期中一部解約元本額	1,142,197,881円

◎損益の状況

当期(自’21年2月23日 至’22年2月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 36,518
支 払 利 息	△ 36,518
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	195,325,747
売 買 益	258,866,967
売 買 損	△ 63,541,220
(C) 信 託 報 酬 等	△ 104,587,040
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	90,702,189
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,796,332,124
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,540,786,245
(配 当 等 相 当 額)	(7,827,320,838)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,286,534,593)
(G) 計 (D+E+F)	8,427,820,558
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	8,427,820,558
追 加 信 託 差 損 益 金	6,540,786,245
(配 当 等 相 当 額)	(7,832,126,125)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,291,339,880)
分 配 準 備 積 立 金	2,672,829,296
繰 越 損 益 金	△ 785,794,983

- (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	252,635,792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	7,832,126,125円
D	分配準備積立金	2,420,193,504円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	10,504,955,421円
F	分配対象収益(1万口当たり)	13,034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20期 (2021年2月23日～ 2022年2月21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	13,034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21期 運用報告書 (決算日2022年2月21日)

外国債券インデックス・マザー・ファンドの第21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			
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
21期('22年 2月21日)	25,264	1.6	25,509	1.6	99.6	-	113,258

(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) '21年 2月22日	24,865	-	25,103	-	99.0	-
2月末	24,791	△ 0.3	25,028	△ 0.3	99.1	-
3月末	25,337	1.9	25,584	1.9	99.1	-
4月末	25,329	1.9	25,581	1.9	98.7	-
5月末	25,661	3.2	25,911	3.2	99.1	-
6月末	25,628	3.1	25,882	3.1	99.2	-
7月末	25,804	3.8	26,057	3.8	98.9	-
8月末	25,801	3.8	26,053	3.8	99.0	-
9月末	25,621	3.0	25,875	3.1	99.0	-
10月末	26,177	5.3	26,426	5.3	99.1	-
11月末	25,886	4.1	26,134	4.1	98.9	-
12月末	26,047	4.8	26,298	4.8	99.1	-
'22年 1月末	25,601	3.0	25,848	3.0	99.1	-
(期末) '22年 2月21日	25,264	1.6	25,509	1.6	99.6	-

(注1) 騰落率は期首比です。

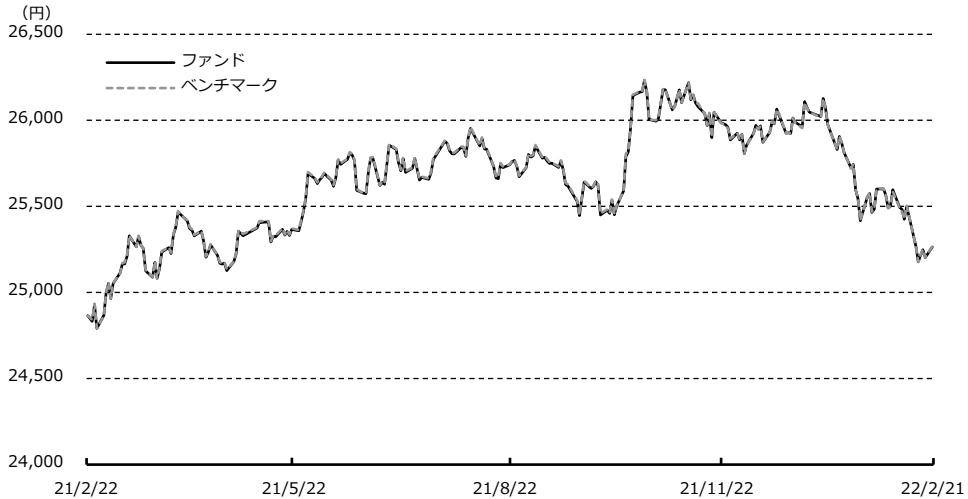
(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算および合成して指数化しています。円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

当期の運用実績

(2021年2月23日から2022年2月21日まで)

基準価額とベンチマークの推移



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

当期末の基準価額は25,264円となり、前期末の24,865円に比べて399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】

- 期前半にパウエル米連邦準備制度理事会(FRB)議長が足元のインフレ率の上昇は一時的なものとの見方を示したことが債券の買い材料となり基準価額の上昇に寄与しました。
- 期後半にFRBが金融緩和策の段階的縮小や早期利上げを実施するとの見方を背景に米国債の利回りが上昇し、日米金利差から円安ドル高となったことが基準価額の上昇に寄与しました。

【マイナスの要因】

- 世界的にインフレ上昇圧力が懸念される中、各国中央銀行が金融政策正常化へ向かうとの観測が債券利回りの上昇(債券価格の下落)につなが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+1.6%となり、ベンチマークの騰落率(+1.6%)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

(2021年2月23日から2022年2月21日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、期前半は7月に発表された消費者物価指数(CPI)が事前予想を上回りましたが、パウエルFRB議長が足元のインフレ率の上昇は一時的なものとの見方を示したことが債券の買い材料となりました。期後半は継続的にCPIが上昇したことでインフレ懸念の広がりから金融政策の引き締め加速に対する警戒感が強まり債券が売られました。米国10年債利回りは前期末の1.37%から1.93%へ上昇しました。

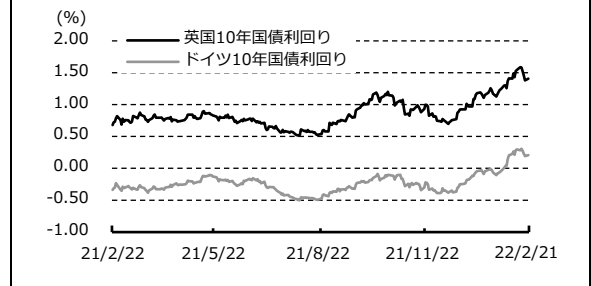
米国10年国債利回りの推移



欧州債券市場

欧州債券市場は、期前半は5月にユーロ圏小売売上高が事前予想を上回る上昇となるなど、堅調な経済指標を背景に独国債が売られ独10年国債利回りがおよそ2年ぶり高水準となりました。その後は利回りの水準感から独国債が買われました。期後半は9月に欧州中央銀行(ECB)がパンデミック緊急購入プログラムの購入ペースの低減を決定したことを背景に独国債が売られました。その後も資源価格高騰を受けたインフレ懸念が強まる中、ECBによる金融政策の正常化前倒し観測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-0.34%から上昇し0.21%で期末を迎えました。英国債券市場は、9月にイングランド銀行(BOE)が金融政策決定会合においてインフレ率が4%を超えるとの見通しを示すと早期利上げ観測の高まりから債券が売られました。BOEは12月と2月にそれぞれ0.15%と0.25%の利上げを実施しました。英10年債利回りは前期末の0.68%から上昇し1.41%となりました。

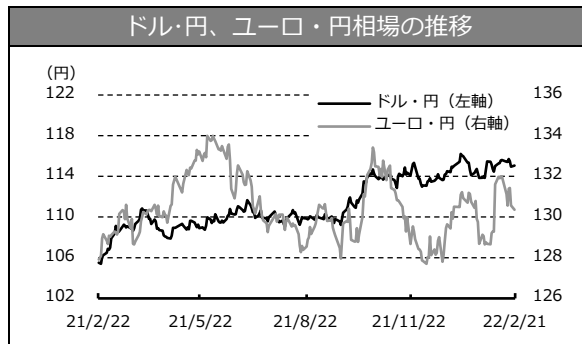
英独10年国債利回りの推移



為替市況

米ドル・円相場は、期前半はレンジ内での動きに留まりましたが、期後半、米国の金融緩和策の段階的縮小や早期利上げ期待を背景に米ドルが買われました。期末にかけては米国長期金利の上昇を背景とした円安ドル高とウクライナ情勢の緊迫化によるリスク回避の円買いの動きが交錯し方向感に欠ける展開となりました。前期末に105円台であった米ドル・円は115円台への円安ドル高となりました。

ユーロ・円相場は、期前半、独国内債利回りが上昇したことに伴いユーロが円に対して強含みとなりましたが、その後は独国内債利回りが低下へ転じるとユーロも円に対して売られる展開となりました。期後半は、ECBによる金融政策の正常化前倒し観測を背景に一時ユーロが対円で上昇したものの、上昇トレンドには至らずに売り戻されレンジ内での動きとなりました。前期末に127円台であったユーロ・円は130円台への円安ユーロ高となり当期末を迎えました。



運用の概況

(2021年2月23日から2022年2月21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入に対応した取引や、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 (2021年2月23日~2022年2月21日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	25,640円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (保管費用)	8円 (8)	0.032% (0.031)	(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)	(0.001)	・ その他は、LEI支払手数料、金銭信託手数料及び信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	8円	0.032%	

(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('21年2月23日から'22年2月21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 174,803	千米ドル 243,646
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 10,947	千カナダドル 17,173
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 13,921	千メキシコペソ 60,229
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	15,135	30,905
	イ タ リ ア	国 債 証 券	15,689	38,088
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	14,872	38,805
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	2,868	6,346
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	9,201	21,839
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	2,696	8,952
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	2,708	5,782
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	794	2,259
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	733	2,968
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 6,645	千英ポンド 24,384
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 4,288	千スウェーデンクローナ 14,166
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 2,683	千ノルウェークローネ 5,115
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 2,568	千デンマーククローネ 14,879
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 7,903	千ポーランドズロチ 18,504
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 2,232	千オーストラリアドル 25,774
シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,488	千シンガポールドル 3,865	
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングット 3,512	千マレーシアリングット 7,594	
中 国	国 債 証 券	千人民元 55,184	千人民元 -	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 2,085	千イスラエルシェケル 7,685	

(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(‘21年2月23日から’22年2月21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% 23/3/31(アメリカ)	1,229,917	US TREASURY N/B 1.625% 22/11/15(アメリカ)	1,160,522
US TREASURY N/B 0.875% 26/6/30(アメリカ)	1,195,705	US TREASURY N/B 2% 22/11/30(アメリカ)	1,087,736
US TREASURY N/B 2.125% 24/3/31(アメリカ)	938,686	US TREASURY N/B 2% 22/2/15(アメリカ)	867,951
US TREASURY N/B 1.25% 31/8/15(アメリカ)	764,967	US TREASURY N/B 2.125% 24/3/31(アメリカ)	863,079
US TREASURY N/B 1.125% 31/2/15(アメリカ)	739,615	US TREASURY N/B 2% 25/2/15(アメリカ)	838,324
US TREASURY N/B 0.75% 26/3/31(アメリカ)	734,794	US TREASURY N/B 1.625% 22/8/31(アメリカ)	795,107
US TREASURY N/B 1.625% 31/5/15(アメリカ)	710,111	US TREASURY N/B 0.875% 26/6/30(アメリカ)	755,817
US TREASURY N/B 1.25% 28/5/31(アメリカ)	677,095	US TREASURY N/B 1.5% 23/3/31(アメリカ)	695,420
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.69% 26/8/12(中国)	636,241	US TREASURY N/B 2.375% 22/3/15(アメリカ)	645,466
US TREASURY N/B 2.375% 51/5/15(アメリカ)	596,569	US TREASURY N/B 0.75% 26/3/31(アメリカ)	627,856

(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(‘21年2月23日から’22年2月21日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 当決算時より利害関係人との為替取引における集計方法を変更しています。

※ 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('22年2月21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
		千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	千米ドル 466,190	千米ドル 470,126	千円 54,092,784	47.8	—	21.7	16.6	9.5
カ ナ ダ	千カナダドル 24,100	千カナダドル 24,989	2,256,823	2.0	—	0.9	0.8	0.3
メ キ シ コ	千メキシコペソ 143,100	千メキシコペソ 146,337	830,932	0.7	—	0.5	0.1	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	54,600	62,823	8,189,646	7.2	—	4.4	1.7	1.1
イ タ リ ア	66,850	74,450	9,705,344	8.6	—	5.1	2.6	0.8
フ ラ ン ス	74,130	85,071	11,089,984	9.8	—	6.2	2.6	1.0
オ ラ ン ダ	13,850	15,775	2,056,512	1.8	—	1.3	0.4	0.1
ス ペ イ ン	43,480	49,486	6,451,090	5.7	—	3.5	1.5	0.7
ベルギー	16,270	19,131	2,493,926	2.2	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	10,720	12,191	1,589,261	1.4	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	4,830	5,077	661,879	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	6,210	6,704	874,035	0.8	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千英ポンド 33,630	千英ポンド 42,256	6,615,727	5.8	—	4.7	0.8	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 24,350	千スウェーデンクローナ 26,483	324,156	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 22,200	千ノルウェークローネ 22,009	282,379	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 23,350	千デンマーククローネ 27,647	484,652	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 18,000	千ポーランドズロチ 17,892	514,852	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 20,660	千オーストラリアドル 21,056	1,741,768	1.5	—	1.2	0.3	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 5,560	千シンガポールドル 5,844	500,038	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 20,270	千マレーシアリンギット 20,671	567,876	0.5	—	0.2	0.2	0.1
中 国	千人民元 54,800	千人民元 55,283	1,006,130	0.9	—	0.3	0.6	—
イスラエル	千イスラエルシェケル 12,470	千イスラエルシェケル 13,518	485,306	0.4	—	0.3	0.1	0.1
合 計	—	—	112,815,109	99.6	—	54.8	30.1	14.7

(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	1.625	6,300	6,329	728,219	2023/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,550	4,585	527,572	2026/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	1,450	1,793	206,369	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,000	2,051	236,061	2046/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	500	654	75,308	2036/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	900	1,198	137,848	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	4,900	4,931	567,405	2023/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	6,000	6,054	696,589	2023/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	8,000	8,122	934,538	2023/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	9,000	9,032	1,039,261	2023/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	5,800	5,835	671,466	2023/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,500	2,501	287,863	2023/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,000	4,080	469,534	2023/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	1,200	1,286	148,060	2023/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	5,500	5,593	643,632	2023/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,300	1,326	152,645	2023/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	5,000	4,998	575,075	2023/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	5,200	5,322	612,358	2023/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,000	5,015	577,030	2023/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	4,300	4,396	505,812	2023/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	4,000	4,047	465,651	2023/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	4,500	4,563	525,132	2023/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,600	3,652	420,299	2024/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	6,000	6,146	707,268	2024/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	7,000	7,087	815,456	2024/ 2/29
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,000	5,061	582,333	2024/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,500	4,543	522,765	2024/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	6,000	6,123	704,598	2024/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	3,000	3,029	348,550	2024/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	3,000	3,038	349,616	2024/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	8,300	8,453	972,680	2024/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,800	3,824	440,063	2024/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,200	5,265	605,861	2024/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	5,200	5,284	608,011	2024/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,500	2,540	292,301	2024/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,500	2,558	294,358	2025/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	5,000	5,044	580,446	2025/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	3,900	4,019	462,494	2025/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	3,500	3,596	413,847	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,200	5,264	605,697	2025/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,900	2,993	344,466	2025/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,600	4,770	548,855	2025/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,500	4,533	521,673	2025/ 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	0.25	3,000	2,843	327,125	2025/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	4,300	4,483	515,862	2025/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	5,900	5,996	689,938	2025/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,800	4,989	574,055	2025/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,500	2,577	296,549	2025/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	3,500	3,607	415,058	2026/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,000	4,964	571,232	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	3,000	3,078	354,173	2026/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	4,500	4,574	526,386	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.75	1,200	1,149	132,203	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	5,200	5,158	593,590	2026/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	4,000	3,840	441,884	2026/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	3,500	3,451	397,078	2026/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,500	3,431	394,876	2026/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,964	456,105	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	1,800	1,723	198,346	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,000	3,895	448,194	2026/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	2,000	1,969	226,614	2027/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,500	3,569	410,748	2027/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,200	4,310	495,937	2027/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,862	214,263	2027/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,500	3,232	371,956	2027/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,000	2,040	234,821	2027/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	4,200	3,866	444,856	2027/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	4,900	4,536	521,927	2027/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,400	3,467	398,997	2027/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,000	1,862	214,263	2027/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	3,300	3,068	353,104	2027/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	5,000	5,241	603,053	2028/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,700	4,522	520,397	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,200	4,438	510,642	2028/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,700	4,516	519,636	2028/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	5,000	4,800	552,355	2028/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	5,000	5,291	608,784	2028/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,000	1,931	222,191	2028/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,200	3,442	396,094	2028/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,850	1,799	207,107	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,500	4,342	499,648	2028/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,500	2,615	300,987	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,500	2,578	296,672	2029/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,500	2,452	282,189	2029/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	2,100	2,077	239,077	2029/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,500	1,454	167,405	2030/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	4,200	3,788	435,908	2030/ 5/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	4,000	3,595	413,658	2030/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	6,500	5,954	685,108	2030/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	6,000	5,604	644,893	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,500	4,383	504,401	2031/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	5,100	4,798	552,147	2031/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	5,000	4,750	546,534	2031/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	500	663	76,350	2038/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	600	712	81,958	2039/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	700	908	104,540	2039/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	750	988	113,717	2039/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,500	1,982	228,115	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	2,000	1,644	189,174	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	900	1,117	128,629	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	4,550	3,725	428,634	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,000	1,300	149,609	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,000	2,562	294,832	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,800	2,488	286,310	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	2,300	2,138	246,009	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,050	2,022	232,675	2041/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	800	981	112,934	2041/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	950	1,071	123,230	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,000	1,895	218,110	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	900	1,016	117,011	2042/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,400	1,491	171,629	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	700	789	90,823	2043/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,700	1,845	212,319	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,400	1,699	195,584	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,500	1,826	210,121	2044/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,000	1,132	130,345	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	2,000	2,045	235,297	2045/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,400	1,558	179,375	2045/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,000	2,186	251,576	2045/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	1,117	128,584	2045/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,200	1,175	135,267	2046/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,400	1,538	177,047	2046/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	1,125	129,442	2047/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,400	1,579	181,704	2047/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,500	1,622	186,734	2047/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,900	2,056	236,581	2047/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	550	624	71,870	2048/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	2,300	2,675	307,848	2048/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,700	3,073	353,645	2048/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	2,500	3,045	350,404	2048/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,800	3,202	368,517	2049/ 2/15

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	3,000	3,360	386,628	2049/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,000	992	114,228	2049/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	2,900	2,958	340,399	2049/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,840	2,672	307,508	2050/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	3,600	2,819	324,447	2050/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,500	3,637	418,503	2050/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	800	688	79,161	2050/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,850	4,430	509,779	2051/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,700	4,808	553,308	2051/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	564	64,990	2051/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,700	1,556	179,098	2051/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	400	523	60,210	2038/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	500	692	79,654	2037/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.0	2,000	2,325	267,532	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.375	500	644	74,123	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.125	300	369	42,504	2027/11/15
小計					54,092,784	
(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	1,144	103,317	2029/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	650	891	80,533	2037/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	630	622	56,205	2023/ 5/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,200	3,207	289,686	2023/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,400	1,420	128,316	2024/ 3/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,600	2,655	239,854	2024/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	3,400	3,468	313,272	2025/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,900	1,886	170,397	2026/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	300	289	26,128	2027/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	700	711	64,226	2028/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,000	1,915	173,000	2030/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,900	1,839	166,115	2031/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	600	747	67,468	2045/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	700	782	70,694	2048/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,000	1,932	174,478	2051/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	150	134	12,188	2053/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	570	651	58,811	2064/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	500	687	62,124	2033/ 6/ 1
小計					2,256,823	
(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	11,000	10,964	62,259	2031/ 5/29
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	34,500	34,646	196,729	2023/12/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	15,000	15,837	89,926	2024/12/ 5
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	23,600	23,355	132,615	2027/ 6/ 3
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	19,000	19,802	112,444	2029/ 5/31
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	7,500	7,435	42,218	2034/11/23

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	10.0	9,000	10,646	60,454	2036/11/20
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	10,000	10,467	59,436	2038/11/18
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	8,500	8,225	46,703	2042/11/13
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	5,000	4,956	28,142	2047/11/ 7
小計					830,932	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,700	2,769	361,013	2025/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,650	2,766	360,608	2025/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,400	1,424	185,746	2027/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,500	1,545	201,515	2027/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,000	1,581	206,116	2042/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,550	2,332	304,053	2046/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	350	357	46,613	2023/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,300	2,360	307,773	2023/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	4,800	4,989	650,465	2023/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	550	574	74,855	2024/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,150	2,225	290,153	2024/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	3,100	3,185	415,293	2026/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,200	1,220	159,059	2028/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,500	1,524	198,777	2029/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,595	207,937	2029/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,193	155,597	2030/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,493	194,686	2030/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,300	1,284	167,484	2031/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,250	1,230	160,395	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,439	187,604	2035/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,100	1,617	210,921	2044/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,300	1,573	205,080	2048/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,900	1,673	218,168	2050/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	250	216	28,193	2052/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,400	1,831	238,780	2028/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.625	2,000	2,676	348,934	2028/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,850	2,865	373,501	2037/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	900	1,504	196,150	2039/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,000	1,561	203,496	2034/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,000	1,797	234,330	2040/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,300	1,930	251,631	2031/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	1,450	1,637	213,468	2024/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	850	1,269	165,529	2030/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5	1,000	1,356	176,877	2027/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,200	2,215	288,828	2026/ 8/15
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,500	1,723	224,655	2026/ 3/ 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	4.0	1,800	2,249	293,181	2037/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,200	1,610	209,966	2034/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.25	800	1,034	134,849	2026/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0	1,700	1,958	255,372	2023/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,000	1,411	184,017	2039/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.25	1,800	2,306	300,704	2029/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,200	1,671	217,911	2033/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	1,500	2,060	268,603	2031/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.95	1,500	1,520	198,247	2023/ 3/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	2,800	2,998	390,929	2023/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	700	708	92,321	2023/10/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	2,000	2,176	283,666	2024/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	2,250	2,330	303,825	2024/ 5/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	1,800	1,954	254,734	2024/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	1,700	1,693	220,725	2025/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	2,000	2,269	295,909	2025/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,300	2,369	308,882	2025/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,700	2,831	369,117	2025/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	2,600	2,684	349,903	2026/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,500	1,523	198,581	2026/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	1,700	1,800	234,766	2027/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.05	300	315	41,080	2027/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	3,600	3,769	491,412	2028/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,900	2,312	301,401	2028/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,100	1,206	157,231	2028/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	800	889	115,920	2029/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	1,700	1,959	255,411	2030/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	1,000	984	128,395	2030/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,700	1,697	221,224	2030/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	1,050	977	127,409	2031/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,000	900	117,448	2031/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,600	1,585	206,638	2032/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	1,000	1,060	138,292	2033/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.35	800	925	120,605	2035/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,400	1,436	187,287	2036/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	900	1,002	130,747	2038/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,400	1,996	260,264	2040/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	970	900	117,370	2041/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,350	1,931	251,794	2044/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	900	1,049	136,750	2046/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	600	637	83,127	2047/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	800	962	125,474	2048/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	750	962	125,513	2049/ 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	2.45	900	898	117,096	2050/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	580	490	63,992	2051/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	700	710	92,579	2067/ 3/ 1
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,800	2,916	380,140	2041/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,310	2,391	311,801	2060/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	350	352	45,936	2023/ 3/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	2,800	2,882	375,733	2023/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	300	302	39,396	2024/ 3/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	2,400	2,540	331,189	2024/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,900	2,959	385,841	2025/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,720	3,118	406,486	2026/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,800	2,854	372,111	2026/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	3,850	4,413	575,377	2027/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,500	2,575	335,793	2028/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,400	2,469	321,965	2028/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,200	2,220	289,487	2029/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,300	2,223	289,915	2029/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,200	2,568	334,887	2030/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,500	2,384	310,796	2030/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,300	1,222	159,309	2031/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,500	1,580	206,013	2034/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,350	2,469	321,982	2036/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,500	1,714	223,538	2039/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,100	1,011	131,902	2040/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,400	1,679	218,898	2048/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,400	1,507	196,520	2050/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	100	86	11,317	2053/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,700	2,550	332,444	2035/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,800	2,461	320,871	2029/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	2,100	3,213	418,890	2032/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	2,400	2,943	383,692	2025/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,300	2,389	311,496	2025/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	2,500	2,711	353,493	2031/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,800	2,606	339,811	2045/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	800	1,189	155,088	2038/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	1,200	1,327	173,107	2023/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,400	2,456	320,192	2055/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	3,700	3,995	520,788	2023/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,000	3,166	412,738	2024/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,400	2,416	315,023	2026/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,050	1,196	156,001	2066/ 5/25

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	800	1,288	167,995	2042/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	850	1,276	166,400	2037/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	900	929	121,226	2023/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,400	1,480	192,938	2024/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	800	811	105,823	2025/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,500	1,536	200,347	2026/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,100	1,142	148,875	2027/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	850	883	115,236	2028/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	450	451	58,832	2029/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	488	63,668	2030/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	650	628	81,956	2031/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	800	977	127,398	2033/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	366	47,727	2038/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	520	518	67,583	2040/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	900	1,366	178,183	2047/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	530	441	57,504	2052/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	900	1,187	154,811	2028/ 1/15
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	1,500	1,583	206,487	2023/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4	2,000	2,159	281,493	2023/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8	1,800	1,975	257,474	2024/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	400	434	56,659	2024/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,600	2,795	364,391	2024/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	1,650	1,728	225,332	2025/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.65	1,600	1,842	240,127	2025/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	2,100	2,186	285,037	2026/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,900	1,993	259,917	2027/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	600	628	81,867	2027/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,400	1,462	190,688	2028/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,400	1,461	190,569	2028/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,200	1,255	163,618	2029/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,200	1,178	153,650	2029/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,050	1,017	132,680	2030/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	1,500	1,624	211,719	2030/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	2,000	1,834	239,161	2031/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	1,160	1,298	169,266	2033/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	1,300	1,374	179,134	2035/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7	1,300	1,983	258,631	2041/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	250	222	29,046	2042/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	650	1,082	141,060	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	900	1,076	140,348	2048/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	820	666	86,884	2050/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	250	189	24,739	2071/10/31

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	2.15	1,600	1,711	223,082	2025/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	750	927	120,847	2046/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	1,400	1,930	251,682	2037/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9	1,400	2,165	282,330	2040/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9	1,800	2,238	291,798	2026/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	1,100	1,418	184,877	2028/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	700	942	122,881	2066/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	1,100	1,494	194,783	2029/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,100	1,601	208,820	2032/ 7/30
(ベルギー)						
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	600	622	81,094	2023/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	1,200	1,282	167,125	2024/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	1,270	1,309	170,688	2025/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,000	1,188	154,926	2026/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	800	827	107,923	2027/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	550	569	74,243	2028/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	750	779	101,645	2029/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	790	766	99,914	2030/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,050	1,092	142,431	2031/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	700	935	121,987	2032/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	280	298	38,943	2033/ 4/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	450	568	74,154	2034/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	400	430	56,094	2037/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	400	459	59,878	2038/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	240	214	27,999	2040/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	850	1,322	172,375	2041/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	470	725	94,545	2045/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	550	599	78,135	2047/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	550	609	79,501	2050/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	410	517	67,523	2057/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	300	379	49,442	2066/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	160	116	15,122	2071/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,500	1,990	259,516	2028/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	1,000	1,524	198,710	2035/ 3/28
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	600	622	81,103	2023/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,300	1,368	178,373	2024/10/21
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2	950	995	129,815	2025/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.85	450	541	70,605	2026/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,000	1,033	134,682	2026/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	750	774	100,911	2028/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	500	505	65,926	2029/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	482	62,916	2030/ 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	-	480	457	59,662	2031/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	450	543	70,840	2034/ 5/23
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	-	250	212	27,741	2040/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	300	443	57,866	2044/ 6/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	480	547	71,320	2047/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	200	189	24,711	2051/ 3/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	220	416	54,356	2062/ 1/26
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	200	223	29,091	2086/11/ 2
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1	280	375	48,956	2117/ 9/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.85	170	124	16,237	2120/ 6/30
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.15	900	1,344	175,239	2037/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	740	988	128,900	2027/ 7/15
(フィンランド)						
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	190	194	25,363	2023/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	280	294	38,428	2024/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	403	52,566	2024/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	430	439	57,296	2026/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	120	122	15,986	2027/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	400	465	60,655	2028/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	150	152	19,845	2028/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	220	222	29,028	2029/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	300	288	37,568	2030/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	280	286	37,389	2031/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	150	144	18,808	2031/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.125	300	317	41,361	2034/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	280	257	33,507	2036/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	150	135	17,705	2040/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.625	265	360	46,946	2042/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	160	182	23,744	2047/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	155	125	16,336	2052/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	600	685	89,339	2025/ 7/ 4
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.55	70	63	8,341	2041/ 4/22
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	500	585	76,296	2025/ 3/13
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	300	332	43,315	2037/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	120	125	16,381	2023/ 3/20
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	93	12,180	2031/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	300	281	36,642	2035/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	520	541	70,540	2028/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	900	937	122,147	2026/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1	500	523	68,296	2029/ 5/15

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	350	368	48,064	2033/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	650	696	90,784	2031/ 3/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	380	405	52,864	2050/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	420	501	65,318	2045/ 2/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	800	926	120,721	2030/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4	300	323	42,138	2024/ 3/18
小計					43,111,681	
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド		
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,230	1,995	312,429	2049/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,000	1,527	239,109	2042/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	1,100	1,476	231,203	2034/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	650	923	144,530	2039/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.0	800	1,423	222,832	2060/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	5.0	1,500	1,666	260,917	2025/ 3/ 7
UK GILT BOND	国債証券	2.25	2,300	2,334	365,551	2023/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	2.0	800	820	128,515	2025/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.5	1,200	1,214	190,131	2026/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	1,226	191,995	2040/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	1,300	1,790	280,263	2045/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	3.75	1,120	1,741	272,578	2052/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,000	1,345	210,679	2036/ 3/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	1,400	1,799	281,778	2030/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	6.0	500	654	102,433	2028/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	0.375	300	276	43,355	2030/10/22
UK GILT BOND	国債証券	0.875	900	873	136,790	2029/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	1,300	1,332	208,645	2028/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	650	743	116,385	2071/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.0	1,050	1,044	163,585	2024/ 4/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	800	843	132,119	2049/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	1,100	1,202	188,227	2057/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.5	780	1,086	170,168	2065/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.75	1,200	1,244	194,783	2024/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	700	1,233	193,177	2068/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,500	2,335	365,705	2046/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,500	1,905	298,375	2032/ 6/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,400	1,633	255,816	2027/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	800	1,399	219,094	2055/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	700	1,035	162,156	2038/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	0.25	650	585	91,603	2031/ 7/31
UK GILT BOND	国債証券	1.75	950	976	152,816	2037/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.125	600	561	87,969	2039/ 1/31
小計					6,615,727	

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	
(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	千円	
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	5,000	5,124	62,722	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	8,100	8,309	101,711	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	250	267	3,276	2025/ 5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	4,200	4,257	52,109	2028/ 5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	3,000	3,041	37,225	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	3,800	5,482	67,111	2039/ 3/30
小計					324,156	
(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		
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	3,000	2,949	37,844	2026/ 2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	4,000	4,103	52,650	2024/ 3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,900	3,856	49,473	2027/ 2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	5,300	5,188	66,564	2029/ 9/ 6
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	2,200	2,081	26,708	2030/ 8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	3,800	3,829	49,138	2023/ 5/24
小計					282,379	
(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	1.5	2,000	2,065	36,214	2023/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	4,100	4,364	76,508	2025/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	4,000	4,064	71,244	2027/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	5,200	5,267	92,333	2029/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	6,100	10,135	177,675	2039/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,950	1,749	30,676	2052/11/15
小計					484,652	
(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	5,000	5,037	144,946	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	3,400	3,347	96,337	2025/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	3,000	2,846	81,896	2026/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	4,200	4,705	135,411	2029/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,400	1,955	56,260	2030/10/25
小計					514,852	
(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	5.5	200	211	17,459	2023/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,000	2,065	170,897	2024/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,200	1,259	104,161	2025/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,150	1,261	104,344	2026/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,800	2,048	169,425	2027/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	300	312	25,815	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	1,000	1,011	83,650	2028/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	900	937	77,539	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	450	483	40,025	2029/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,200	2,253	186,415	2030/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,350	2,123	175,621	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	710	633	52,411	2031/11/21

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	
(オーストラリア)		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,100	1,909	157,930	2032/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,250	1,525	126,158	2033/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	400	415	34,398	2035/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	450	488	40,391	2039/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	550	552	45,698	2041/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	550	568	47,027	2047/ 3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	750	591	48,897	2051/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	350	404	33,496	2037/ 4/21
小計					1,741,768	
(シンガポール)			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	880	951	81,442	2027/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	1,000	1,022	87,485	2023/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	1,200	1,235	105,698	2025/ 6/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	700	749	64,076	2030/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	350	396	33,879	2033/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	320	330	28,279	2039/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	350	385	32,952	2042/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	360	398	34,124	2046/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	400	375	32,098	2050/ 3/ 1
小計					500,038	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.502	1,000	1,003	27,565	2027/ 5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.065	2,700	2,545	69,940	2050/ 6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.48	4,200	4,266	117,195	2023/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.955	5,000	5,158	141,705	2025/ 9/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	2,500	2,565	70,482	2026/11/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.498	1,100	1,160	31,878	2030/ 4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.935	1,500	1,615	44,379	2043/ 9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.736	1,550	1,596	43,857	2046/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.921	720	759	20,871	2048/ 7/ 6
小計					567,876	
(中国)			千人民元	千人民元		
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.69	35,100	35,368	643,692	2026/ 8/12
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.02	9,200	9,331	169,820	2031/ 5/27
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.89	10,500	10,583	192,616	2031/11/18
小計					1,006,130	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	2,800	2,856	102,538	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,800	1,871	67,170	2025/ 8/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	2,400	2,553	91,685	2027/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,700	1,829	65,666	2028/ 9/28
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,800	1,749	62,809	2030/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	850	1,274	45,754	2042/ 1/31

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	
(イスラエル) ISRAEL FIXED BOND	国債証券	% -	千イスラエルシケル 1,120	千イスラエルシケル 1,383	千円 49,681	2047/ 3/31
小計					485,306	
合計					112,815,109	

(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('22年2月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 112,815,109	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,273,784	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	114,088,893	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=115.06円、1カナダドル=90.31円、1メキシコペソ=5.6782円、1ユーロ=130.36円、1英ポンド=156.56円、1スウェーデンクローナ=12.24円、1ノルウェークローネ=12.83円、1デンマーククローネ=17.53円、1ポーランドズロチ=28.7749円、1オーストラリアドル=82.72円、1シンガポールドル=85.55円、1マレーシアリンギット=27.4718円、1人民元=18.1996円、1イスラエルシケル=35.8992円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(113,378,568千円)の投資信託財産総額(114,088,893千円)に対する比率は99.4%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

('22年2月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	114,964,042,095
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	509,282,832
公 社 債 (評 価 額)	112,815,109,040
未 収 入 金	875,299,060
未 収 利 息	745,402,426
前 払 費 用	18,948,737
(B) 負 債	1,705,920,723
未 払 金	1,481,384,572
未 払 解 約 金 息	224,535,783
そ の 他 未 払 費 用	281
そ の 他 未 払 費 用	87
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	113,258,121,372
元 本	44,829,220,968
次 期 繰 越 損 益 金	68,428,900,404
(D) 受 益 権 総 口 数	44,829,220,968口
1万口当たり基準価額 (C / D × 10,000)	25,264円

- (注1) 期首元本額 56,125,021,105円
 期中追加設定元本額 7,492,685,110円
 期中一部解約元本額 18,788,485,247円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。

ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,525,734,988円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	6,334,376,233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 (高倍ヘッジあり)	5,435,093,427円
世界国債タムスブレッド・プレミア戦略ファンド/高倍ヘッジ付<適格機関投資家限定>	3,896,322,199円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	3,408,874,554円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き (年金1)<適格機関投資家限定>	2,727,903,184円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	2,375,871,421円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,140,003,570円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,464,119,127円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,128,658,937円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	990,434,150円
外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	945,432,342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>	916,323,583円
AMC/ステート・ストリートリスクバジェット型/オープン (ステイブル)	864,844,189円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	838,619,218円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	796,702,791円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	696,774,062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>	600,045,110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>	565,394,934円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	560,225,202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>	278,379,509円
TaDRISKバジェット型マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) 年金<適格機関投資家限定>	193,067,286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>	159,210,423円

◎損益の状況

当期 (自 '21年2月23日 至 '22年2月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	2,851,886,362
受 取 利 息	2,853,776,451
支 払 利 息	△ 1,890,089
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 140,735,864
売 買 益	7,337,617,061
売 買 損	△ 7,478,352,925
(C) そ の 他 費 用	△ 43,263,299
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,667,887,199
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	83,432,267,004
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,638,863,456
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 29,310,117,255
(H) 計 (D + E + F + G)	68,428,900,404
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	68,428,900,404

- (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。

バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	131,144,952円
TaDRISKバジェット型マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) <適格機関投資家限定>	127,780,936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	103,024,464円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	93,357,417円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	85,830,664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>	78,290,488円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	74,144,512円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	63,125,976円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	56,178,677円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	40,736,429円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	29,466,570円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	27,752,805円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	25,724,700円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	19,489,997円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	12,858,043円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	5,901,645円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	4,039,197円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,022,530円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,874,506円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	1,522,649円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	1,477,413円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	984,013円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	81,946円