

○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">日本を除く世界の主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券に投資することにより、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。外貨建資産およびマザーファンド受益証券組入れに伴う実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	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	ベビーファンド	<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	毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。 ①分配対象額の範囲 経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等の範囲内とします。 ②分配対象収益についての分配方針 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、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用方針 特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

SSGAインデックス・シリーズ・ライト ステート・ストリート・ グローバル債券インデックス・オープン (隔月分配型)

第1作成期 運用報告書(全体版)
第1期 (決算日2024年2月20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・グローバル債券インデックス・オープン(隔月分配型)」は、2024年2月20日に第1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

◎設定以来の運用実績

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、円換算ベース)		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				
第1 作成 期	(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
	'24年 1月11日	10,000	-	-	10,000	-	-	-	1
	1期('24年 2月20日)	10,155	0	1.6	10,160	1.6	98.9	-	1

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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。

◎当作成期の基準価額と市況等の推移

決算期	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、円換算ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
		騰落率	騰落率				
第1期	(設定日)	円	%		%	%	%
	'24年 1月11日	10,000	-	10,000	-	-	-
	1月末	10,079	0.8	10,084	0.8	98.7	-
	(期 末)						
	'24年 2月20日	10,155	1.6	10,160	1.6	98.9	-

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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。

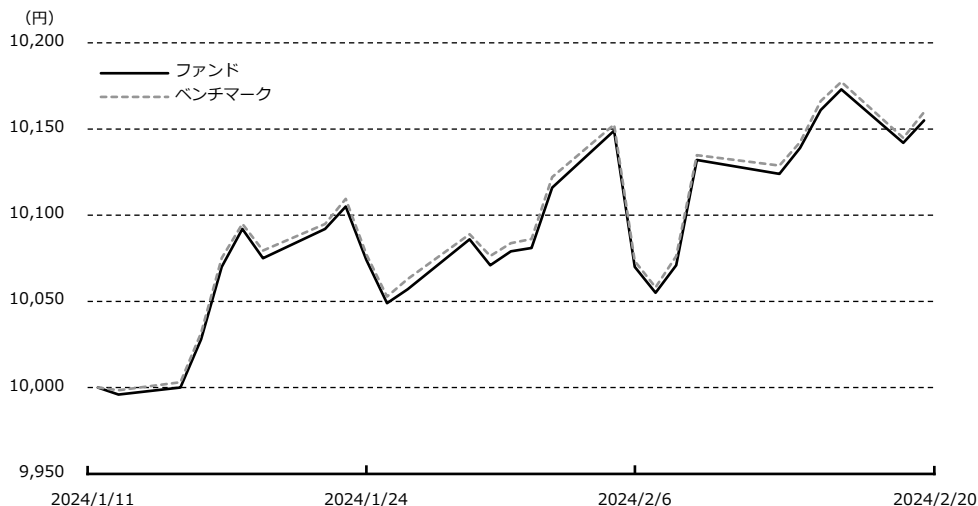
(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(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。

当作成期の運用実績

(2024年1月11日から2024年2月20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、円換算ベース)で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

決算期	当初元本	作成期末 基準価額 (分配落ち)	税込み 分配金累計	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第1作成期	10,000円	10,155円	0円	+1.6%	+1.6%

当作成期末の基準価額は10,155円となり、当初元本の10,000円に比べて155円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

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。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

収益分配金

当作成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、元本部分と同一の運用を行う方針です。

投資環境

(2024年1月11日から2024年2月20日まで)

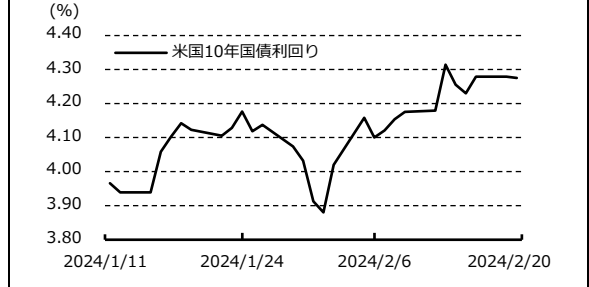
米国債券市場

米国債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

当作成期は、1月末にかけて地政学リスクの高まりや労働需給やインフレ圧力の緩和などを受けて債券が買われる場面がありましたが、堅調な経済指標や予想を上回る物価指標などを受けて債券利回りが上昇する展開となりました。

米国10年国債利回りは期初の3.97%から0.31%上昇の4.28%となりました。

米国10年国債利回りの推移



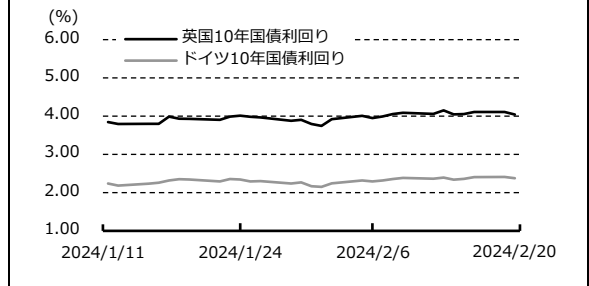
欧州債券市場

欧州債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

当作成期は、1月末にかけて債券が買われる場面がありましたが、堅調な米経済指標や予想を上回る米物価指標などを受けて米国債の利回りが上昇したことや、複数の欧州中央銀行(ECB)高官が早期利下げに慎重な姿勢を示したことなどを受けて債券利回りが上昇する展開となりました。

独10年国債利回りは期初の2.24%から0.13%上昇の2.37%、英10年国債利回りは期初の3.84%から0.20%上昇の4.04%となりました。

英独10年国債利回りの推移

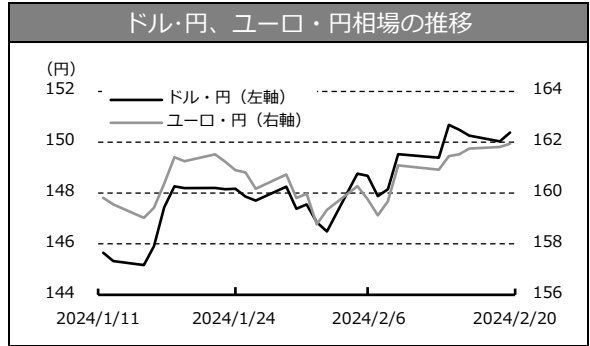


為替市況

ドル・円相場は、円安ドル高となりました。

当作成期は、堅調な米経済指標や予想を上回る米物価指標をなど受けて米利下げ観測が後退する中、日米金利差の拡大を意識した円売り・ドル買いが優勢となりました。円は対米ドルで期初の145台から150円台に下落しました。

ユーロ・円相場は、ドル・円相場と同様に円安が進みました。円は対ユーロで期初の159台から161円台に下落しました。



運用の概況

(2024年1月11日から2024年2月20日まで)

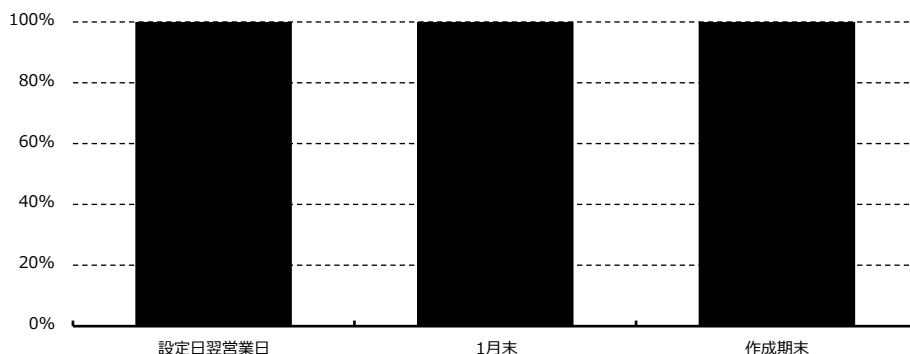
当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券(以下、マザーファンドといいます)を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ち、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

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、円換算ベース)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

当作成期は、設定日翌営業日からマザーファンドの組み入れを開始し、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、円換算ベース)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	当作成期 (2024年1月11日~2024年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	10,079円	-	作成期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	1円	0.007%	(a)信託報酬 = 作成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）	(0)	(0.002)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(0)	(0.002)	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）	(0)	(0.002)	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	1	0.005	(b)その他費用 = 作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(0)	(0.004)	・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）	(0)	(0.000)	・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
（印刷費用等）	(0)	(0.001)	・印刷費用等は、法定書類等の作成、印刷、交付等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	・その他は、金銭信託手数料
合 計	2円	0.012%	

(注1) 作成期中の費用(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)を作成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。

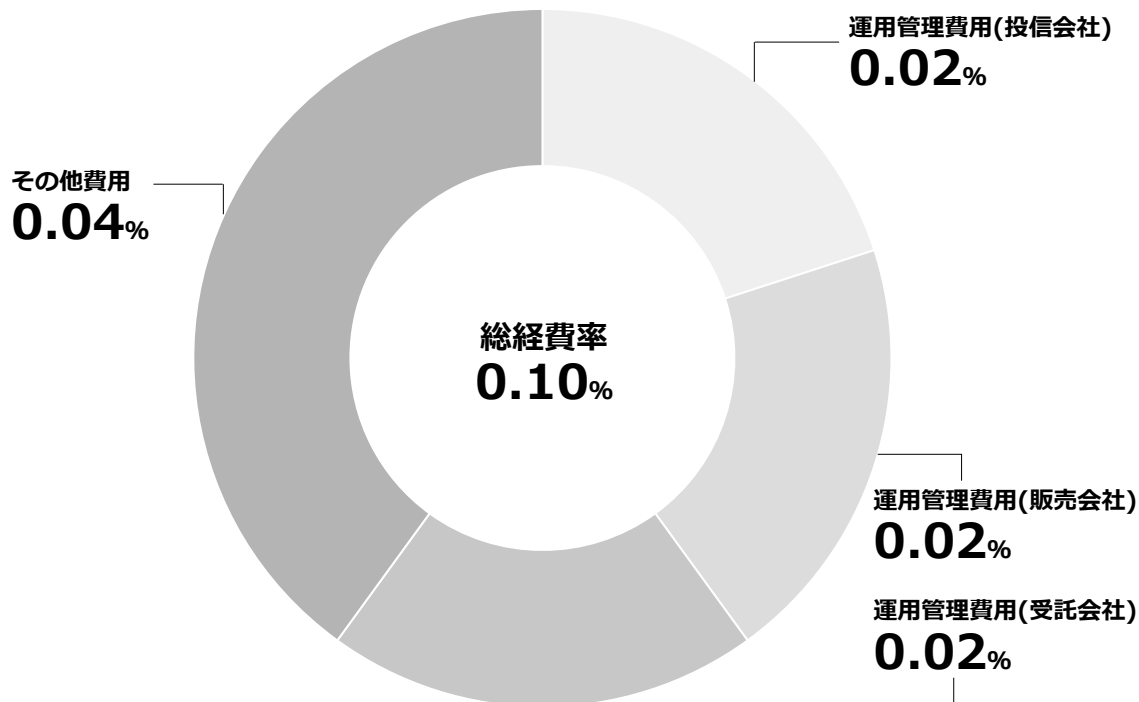
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

当作成期中の運用・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。)を作成期中の平均受益権口数に作成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**0.10%**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('24年1月11日から'24年2月20日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

決算期	当 作 成 期			
	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	349	999	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('24年1月11日から'24年2月20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)

当 作 成 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.37% 29/1/15(中国)	188,597	US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	427,213
US TREASURY N/B 2.625% 29/2/15(アメリカ)	141,733	US TREASURY N/B 2.75% 25/2/28(アメリカ)	395,785
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/4/25(ユーロ・フランス)	134,909	US TREASURY N/B 1.375% 28/12/31(アメリカ)	390,586
US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	71,639	US TREASURY N/B 2.5% 25/1/31(アメリカ)	360,540
US TREASURY N/B 2.375% 29/5/15(アメリカ)	69,248	US TREASURY N/B 0.75% 26/3/31(アメリカ)	273,751
CHINESE GOVERNMENT BOND 3.86% 49/7/22(中国)	50,589	US TREASURY N/B 0.625% 27/11/30(アメリカ)	259,053
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.2% 34/2/15(ユーロ・ドイツ)	48,757	US TREASURY N/B 3.375% 42/8/15(アメリカ)	255,307
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.24% 25/5/25(中国)	41,818	US TREASURY N/B 2.75% 32/8/15(アメリカ)	226,701
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/4/30(ユーロ・スペイン)	40,003	US TREASURY N/B 3.125% 28/11/15(アメリカ)	212,653
US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30(アメリカ)	39,573	CHINESE GOVERNMENT BOND 2.91% 28/10/14(中国)	210,261

(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('24年1月11日から'24年2月20日まで)

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

※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。

◎自社による当ファンドの設定・解約状況

当作成期設定元本	当作成期解約元本	当作成期末残高(元本)	取引の理由
千円 1,000	千円 -	千円 1,000	当初設定時における取得

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎組入資産の明細('24年2月20日現在)

○親投資信託残高

種 類	当作成期末(第1期末)	
	口 数	評価額
外国債券インデックス・マザー・ファンド	千口 349	千円 1,015

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当作成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32,087,499千口です。

当作成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('24年2月20日現在)

項 目	当作成期末(第1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 1,015	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	0	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,015	100.0

(注1) 外貨建資産は、当作成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、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=150.38円、1カナダドル=111.38円、1メキシコペソ=8.8208円、1ユーロ=161.94円、1英ポンド=189.30円、1スウェーデンクローナ=14.46円、1ノルウェークローネ=14.33円、1デンマーククローネ=21.72円、1ポーランドズロチ=37.4169円、1オーストラリアドル=98.21円、1ニューージーランドドル=92.33円、1シンガポールドル=111.67円、1マレーシアリンギット=31.3886円、1人民元=20.8686円、1イスラエルシェケル=41.3877円、1オフショア人民元=20.8415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、当作成期末における外貨建純資産(93,164,758千円)の投資信託財産総額(93,457,735千円)に対する比率は99.7%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

('24年2月20日現在)

項 目	当作成期末
	円
(A) 資 産	1,015,587
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	98
外国債券インデックス・マザー・ファンド(評価額)	1,015,489
(B) 負 債	67
未 払 信 託 報 酬	53
そ の 他 未 払 費 用	14
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,015,520
元 本	1,000,000
次 期 繰 越 損 益 金	15,520
(D) 受 益 権 総 口 数	1,000,000口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	10,155円

(注) 設定元本額 1,000,000円
 作成期中追加設定元本額 0円
 作成期中一部解約元本額 0円

◎損益の状況

当作成期(自'24年1月11日 至'24年2月20日)

項 目	当作成期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 2
支 払 利 息	△ 2
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,589
売 買 益	15,589
(C) 信 託 報 酬 等	△ 67
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	15,520
(E) 計 (D)	15,520
(F) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (E+F)	15,520
分 配 準 備 積 立 金	15,520

(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) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	2,412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	13,108円
C	分配対象収益(A+B)	15,520円
D	分配対象収益(1万口当たり)	155円
E	分配金	0円
F	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1期 (2024年1月11日～ 2024年2月20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	155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23期 運用報告書 (決算日2024年2月20日)

外国債券インデックス・マザー・ファンドの第23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、円換算ベース)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、円換算ベース)		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			
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
22期('23年 2月20日)	25,315	0.2	25,566	0.2	99.0	-	100,006
23期('24年 2月20日)	29,054	14.8	29,349	14.8	98.9	-	93,228

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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、円換算ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '23年 2月20日	25,315	-	25,566	-	99.0	-
2月末	25,403	0.3	25,655	0.3	99.0	-
3月末	25,720	1.6	25,977	1.6	99.0	-
4月末	25,906	2.3	26,169	2.4	98.6	-
5月末	26,564	4.9	26,850	5.0	99.1	-
6月末	27,636	9.2	27,922	9.2	98.8	-
7月末	27,035	6.8	27,312	6.8	99.2	-
8月末	27,784	9.8	28,065	9.8	99.2	-
9月末	27,368	8.1	27,645	8.1	99.1	-
10月末	27,342	8.0	27,620	8.0	99.0	-
11月末	28,300	11.8	28,593	11.8	99.0	-
12月末	28,330	11.9	28,615	11.9	99.1	-
'24年 1月末	28,834	13.9	29,130	13.9	98.8	-
(期末) '24年 2月20日	29,054	14.8	29,349	14.8	98.9	-

(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、円換算ベース)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

(2023年2月21日から2024年2月20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、円換算ベース)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29,054円となり、前期末の25,315円に比べて3,739円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+14.8%となり、ベンチマークの騰落率(+14.8%)とほぼ同水準となりました。主な要因は以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

投資環境

(2023年2月21日から2024年2月20日まで)

米国債券市場

米国債券市場は、債券利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、序盤に米地方銀行の経営破綻に伴う金融不安から債券が買われる場面がありましたが、その後は根強いインフレに対する警戒感や堅調な経済指標を受けた金融引き締め長期化観測から債券利回りは上昇基調で推移しました。

期後半は、序盤は金融引き締め長期化観測から債券が売られる展開となりました。その後はインフレの鈍化や労働需給の緩和などを受けて利上げ終了や2024年の利下げ観測が高まる中、債券利回りが低下しましたが、期末にかけて堅調な経済指標などを受けて早期の利下げ観測が後退する中、債券が売られる展開となりました。

米国10年国債利回りは前期末から0.47%上昇の4.28%となりました。

米国10年国債利回りの推移



欧州債券市場

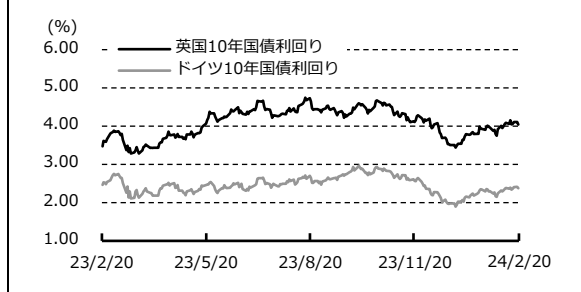
欧州債券市場は、債券利回りがドイツやフランスで低下する一方、英国では上昇するなど方向感に欠ける展開となりました。

期前半は、序盤に米地方銀行の経営破綻に伴う金融不安が欧州にも飛び火する中、債券が買われる場面がありましたが、その後は根強いインフレに対する警戒感などを受けた米欧の金融引き締め長期化観測から債券利回りは上昇基調で推移しました。

期後半は、序盤は米欧の金融引き締め長期化観測から債券が売られる展開となりました。その後はインフレの鈍化や欧州の景気減速などを受けて米欧で利上げ終了や2024年の利下げ観測が高まる中、債券利回りが低下しましたが、期末にかけて米欧で早期の利下げ観測が後退する中、債券が売られる展開となりました。

独10年国債利回りは前期末から0.09%低下の2.37%、英10年国債利回りは前期末から0.57%上昇の4.04%となりました。

英独10年国債利回りの推移



為替市況

為替相場は、円安が進行しました。

ドル・円相場は、米国の金融引き締め長期化観測から日米金利差の拡大が意識される中、円安が進みました。その後、米国の利上げ終了や2024年の利下げ観測などから2023年末にかけて円高に振れましたが、期末にかけては早期の米利下げ観測の後退などを背景に円安が進行しました。円は対米ドルで前期末の134円台から150円台に下落しました。

ユーロ・円相場は、ドル・円相場と同様に円安が進みました。円は対ユーロで前期末の143円台から161円台に下落しました。

ドル・円、ユーロ・円相場の推移



運用の概況

(2023年2月21日から2024年2月20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、円換算ベース)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、円換算ベース)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、550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、円換算ベース)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 (2023年2月21日~2024年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	27,185円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (保管費用)	10円 (10)	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	10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('23年2月21日から'24年2月20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 56,845	千米ドル 131,443
	カナダ	国債証券 千カナダドル 4,967	千カナダドル 8,980
	メキシコ	国債証券 千メキシコペソ 39,978	千メキシコペソ 66,369
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 6,096	15,386
	イタリア	国債証券 5,040	16,784
	フランス	国債証券 5,484	18,572
	オランダ	国債証券 729	3,097
	スペイン	国債証券 3,251	10,610
	ベルギー	国債証券 592	3,761
	オーストリア	国債証券 762	2,386
	フィンランド	国債証券 435	1,057
	アイルランド	国債証券 62	1,225
	イギリス	国債証券 千英ポンド 3,834	千英ポンド 6,413
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 496	千スウェーデンクローナ 2,519
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 1,811	千ノルウェークローネ 4,821
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 113	千デンマーククローネ 5,549
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 4,089	千ポーランドズロチ 6,384
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 1,462	千オーストラリアドル 5,545
	ニュージーランド	国債証券 千ニュージーランドドル 534	千ニュージーランドドル 494
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 285	千シンガポールドル 1,402	
マレーシア	国債証券 千マレーシアリンギット 4,760	千マレーシアリンギット 7,950	
中国	国債証券 千人民元 172,003	千人民元 31,171	
イスラエル	国債証券 千イスラエルシエケル 1,845	千イスラエルシエケル 2,791	

(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('23年2月21日から'24年2月20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 3.875% 25/4/30(アメリカ)	832,105	US TREASURY N/B 2.375% 24/8/15(アメリカ)	1,207,646
US TREASURY N/B 3.375% 33/5/15(アメリカ)	706,710	US TREASURY N/B 2.5% 24/5/15(アメリカ)	1,196,638
US TREASURY N/B 4.5% 33/11/15(アメリカ)	467,754	US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15(アメリカ)	1,071,700
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.64% 28/1/15(中国)	398,739	US TREASURY N/B 2% 25/2/15(アメリカ)	999,619
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.55% 28/10/15(中国)	362,458	US TREASURY N/B 2% 24/4/30(アメリカ)	932,463
US TREASURY N/B 3.625% 28/3/31(アメリカ)	350,080	US TREASURY N/B 2.125% 24/2/29(アメリカ)	850,183
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.91% 28/10/14(中国)	337,703	US TREASURY N/B 2.125% 24/3/31(アメリカ)	843,880
US TREASURY N/B 2.5% 24/5/15(アメリカ)	328,605	US TREASURY N/B 2% 24/5/31(アメリカ)	828,670
US TREASURY N/B 4% 28/6/30(アメリカ)	328,150	US TREASURY N/B 2.125% 24/9/30(アメリカ)	756,726
US TREASURY N/B 0.25% 25/5/31(アメリカ)	323,218	US TREASURY N/B 2% 24/6/30(アメリカ)	567,415

(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('23年2月21日から'24年2月20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。

※ 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('24年2月20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
			千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	千米ドル 330,570	千米ドル 290,711	千円 43,717,215	46.9	—	19.2	17.6	10.1
カ ナ ダ	千カナダドル 17,930	千カナダドル 16,595	1,848,407	2.0	—	1.1	0.3	0.6
メ キ シ コ	千メキシコペソ 97,600	千メキシコペソ 90,873	801,573	0.9	—	0.5	0.3	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	37,950	36,030	5,834,813	6.3	—	3.4	1.9	0.9
イ タ リ ア	43,450	41,585	6,734,427	7.2	—	4.1	2.5	0.6
フ ラ ン ス	49,550	46,140	7,472,020	8.0	—	4.9	2.5	0.6
オ ラ ン ダ	8,960	8,185	1,325,512	1.4	—	0.8	0.5	0.1
ス ペ イ ン	29,130	27,558	4,462,827	4.8	—	2.6	1.6	0.6
ベルギー	10,630	9,830	1,592,025	1.7	—	1.2	0.4	0.1
オーストリア	7,470	6,736	1,090,970	1.2	—	0.7	0.4	0.0
フィンランド	3,405	2,930	474,518	0.5	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	3,715	3,303	534,965	0.6	—	0.4	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千英ポンド 28,860	千英ポンド 25,276	4,784,782	5.1	—	3.6	0.8	0.7
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 13,650	千スウェーデンクローナ 13,401	193,781	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 12,600	千ノルウェークローネ 11,582	165,984	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 12,300	千デンマーククローネ 11,597	251,889	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 13,930	千ポーランドズロチ 12,876	481,802	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 14,150	千オーストラリアドル 12,740	1,251,254	1.3	—	0.9	0.4	0.0
ニュージーランド	千ニューージーランドドル 3,015	千ニューージーランドドル 2,462	227,400	0.2	—	0.1	0.1	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 3,465	千シンガポールドル 3,367	376,028	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 14,330	千マレーシアリンギット 14,901	467,728	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中 国	千人民元 362,700	千人民元 373,929	7,803,394	8.4	—	3.0	3.9	1.5
イスラエル	千イスラエルシエケル 7,920	千イスラエルシエケル 7,562	312,983	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	92,206,308	98.9	—	48.2	34.4	16.3

(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	2.0	4,050	3,794	570,593	2026/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	700	622	93,604	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,000	707	106,417	2046/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	520	534	80,363	2036/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	900	993	149,468	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	100	97	14,600	2025/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,200	1,173	176,438	2025/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,000	4,875	733,190	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	5,000	4,762	716,214	2025/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	5,800	5,730	861,744	2025/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.125	5,200	5,028	756,256	2025/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.25	2,500	2,358	354,611	2025/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,900	2,821	424,262	2025/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.625	500	498	74,969	2025/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	4,600	4,476	673,238	2025/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	4,500	4,320	649,747	2025/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.25	4,000	3,734	561,598	2025/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	1,500	1,503	226,169	2025/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	2,500	2,431	365,699	2025/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	2,000	2,006	301,770	2025/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	4,000	3,836	576,942	2025/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,300	2,228	335,092	2025/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	3,000	2,891	434,856	2025/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	1,000	985	148,230	2026/ 1/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,300	2,214	332,971	2026/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	3,000	2,829	425,516	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	3,000	2,877	432,724	2026/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,300	2,193	329,796	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.75	1,200	1,108	166,689	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,751	564,183	2026/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,600	2,390	359,510	2026/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	3,500	3,254	489,363	2026/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,500	3,241	487,389	2026/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,722	559,789	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,200	2,007	301,913	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	3,000	2,750	413,691	2026/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	4,800	4,415	663,937	2027/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,500	3,288	494,482	2027/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	4,100	3,721	559,598	2027/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,200	3,943	593,034	2027/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,800	1,702	255,986	2027/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,758	264,469	2027/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,500	3,053	459,222	2027/ 7/31

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	2.25	2,000	1,862	280,082	2027/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,200	3,067	461,328	2027/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,200	2,776	417,492	2027/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,738	261,390	2027/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,800	2,596	390,520	2027/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	5,300	4,616	694,180	2027/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,950	2,561	385,170	2027/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,900	1,840	276,826	2028/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,300	2,166	325,756	2028/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,400	1,238	186,172	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	2,500	2,432	365,758	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,400	3,208	482,431	2028/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	2,800	2,464	370,635	2028/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	2,600	2,283	343,427	2028/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	2,300	2,269	341,334	2028/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,500	1,411	212,308	2028/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	600	523	78,741	2028/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.625	1,800	1,822	274,067	2028/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,400	1,226	184,421	2028/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,700	1,613	242,703	2028/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	2,400	2,110	317,419	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	350	351	52,801	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,000	872	131,200	2028/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,800	3,370	506,888	2029/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	5,800	5,366	806,993	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	3,000	2,731	410,731	2029/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.25	2,800	2,658	399,829	2029/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	8,000	6,982	1,050,028	2029/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,000	2,625	394,747	2029/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,500	1,279	192,430	2030/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,800	2,240	336,916	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	4,600	3,648	548,723	2030/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	4,000	3,209	482,625	2030/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,500	1,504	226,239	2030/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	3,650	2,968	446,378	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,400	3,675	552,651	2031/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,000	3,226	485,163	2031/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	4,000	3,233	486,267	2031/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	4,000	3,346	503,256	2032/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,900	3,513	528,291	2032/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	3,100	2,756	414,552	2032/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	2,200	2,169	326,222	2032/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,800	1,691	254,326	2033/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	2,200	2,043	307,341	2033/ 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	3.875	2,000	1,932	290,609	2033/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	2,100	2,131	320,534	2033/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	304	45,758	2038/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	400	360	54,228	2039/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	500	490	73,739	2039/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	750	743	111,767	2039/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	500	493	74,232	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,000	609	91,626	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	900	833	125,413	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,700	1,025	154,276	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,000	968	145,668	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,700	1,067	160,497	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,800	1,850	278,275	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,400	954	143,564	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,250	903	135,863	2041/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	800	723	108,771	2041/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	950	783	117,854	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	800	549	82,582	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,400	1,150	173,072	2042/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,200	964	145,034	2042/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,200	924	139,092	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	1,300	1,103	165,872	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,000	768	115,510	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	277	41,788	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	700	569	85,619	2043/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	300	234	35,190	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	800	726	109,269	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	600	524	78,882	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	500	486	73,134	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	357	53,825	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	800	697	104,951	2044/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,100	885	133,090	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	900	645	97,113	2045/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,100	860	129,471	2045/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,100	840	126,402	2045/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	779	117,261	2045/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	200	134	20,186	2046/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	800	605	91,012	2046/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	695	104,562	2047/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	771	115,980	2047/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	367	55,232	2047/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,000	733	110,288	2047/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	550	422	63,530	2048/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,500	1,178	177,160	2048/ 5/15

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	3.0	1,500	1,149	172,851	2048/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	2,050	1,682	253,017	2048/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,700	1,300	195,589	2049/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	500	373	56,113	2049/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,000	653	98,199	2049/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,700	1,140	171,542	2049/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,200	1,348	202,856	2050/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,500	748	112,599	2050/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	2,700	1,392	209,468	2050/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	800	441	66,425	2050/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,650	2,148	323,114	2051/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,000	2,657	399,564	2051/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,600	969	145,727	2051/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	2,400	1,404	211,218	2051/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,100	1,350	203,146	2052/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,500	1,111	167,194	2052/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,800	1,369	206,005	2052/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	900	831	125,001	2052/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,100	948	142,563	2053/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	850	802	120,752	2053/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	950	997	150,026	2053/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	400	401	60,384	2038/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	200	214	32,225	2037/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.0	2,000	2,051	308,549	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.375	500	534	80,365	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.125	300	317	47,776	2027/11/15
小計					43,717,215	
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	750	825	91,987	2029/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	450	516	57,535	2037/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	3,350	3,252	362,235	2025/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,650	1,554	173,094	2025/ 9/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,100	1,037	115,576	2026/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,200	1,097	122,205	2027/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	550	513	57,193	2028/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,090	946	105,412	2030/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,720	1,488	165,805	2031/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,710	1,514	168,644	2032/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	300	280	31,214	2033/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	300	285	31,752	2034/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	450	450	50,147	2045/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	430	379	42,255	2048/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	850	630	70,206	2051/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	820	564	62,854	2053/12/ 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	
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル	千円	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	150	130	14,543	2055/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	360	311	34,683	2064/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	700	817	91,058	2033/ 6/ 1
小計					1,848,407	
(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	11,500	10,603	93,526	2031/ 5/29
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	19,000	17,490	154,278	2026/ 3/ 5
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	19,500	18,423	162,514	2027/ 6/ 3
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	10,500	10,192	89,905	2029/ 5/31
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	5,500	4,952	43,680	2034/11/23
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	7,200	7,626	67,270	2036/11/20
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	7,000	6,548	57,761	2038/11/18
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	4,300	3,685	32,508	2042/11/13
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	9,100	7,908	69,759	2047/11/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	4,000	3,442	30,366	2053/ 7/31
小計					801,573	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	600	583	94,539	2025/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,950	1,893	306,560	2025/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,850	1,728	279,989	2027/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,750	1,636	264,948	2027/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	859	139,221	2025/10/10
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	350	381	61,758	2042/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,050	1,032	167,273	2046/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,000	1,911	309,580	2026/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,350	1,229	199,051	2028/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	600	541	87,652	2029/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	630	554	89,869	2029/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	609	98,740	2030/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	776	125,747	2030/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,100	937	151,809	2031/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,011	163,754	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,011	163,801	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	2,330	2,215	358,812	2032/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	900	916	148,365	2033/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	300	294	47,700	2034/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	600	456	73,903	2035/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	950	931	150,919	2044/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,150	876	141,993	2048/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,300	669	108,423	2050/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	880	431	69,936	2052/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	750	632	102,381	2053/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	800	875	141,846	2028/ 7/ 4

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	
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.625	1,300	1,449	234,782	2028/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	580	673	109,010	2037/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	600	724	117,271	2039/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,050	1,271	205,871	2034/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	680	872	141,252	2040/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,100	1,317	213,280	2031/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	850	1,028	166,581	2030/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5	1,200	1,351	218,800	2027/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,500	2,342	379,378	2026/ 8/15
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,500	1,536	248,850	2026/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,150	1,148	186,016	2037/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	850	930	150,655	2034/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.25	900	993	160,954	2026/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	800	870	140,975	2039/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.25	1,400	1,535	248,689	2029/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,050	1,208	195,741	2033/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	800	925	149,896	2031/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	780	791	128,200	2025/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	850	830	134,418	2025/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,000	1,957	317,006	2025/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	3,100	2,992	484,682	2026/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,100	1,994	322,931	2026/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	1,200	1,163	188,449	2027/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.05	1,000	963	155,980	2027/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	2,600	2,483	402,244	2028/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,270	1,347	218,163	2028/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,100	1,076	174,372	2028/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,400	1,374	222,526	2029/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	900	903	146,373	2030/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	1,000	885	143,381	2030/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,000	887	143,737	2030/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	700	584	94,674	2031/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	1,230	993	160,809	2031/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,750	1,510	244,605	2032/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4	900	945	153,035	2033/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	1,230	1,101	178,422	2033/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	450	462	74,944	2034/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.35	700	662	107,348	2035/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	900	743	120,471	2036/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	500	435	70,566	2038/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	850	924	149,746	2040/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	970	687	111,306	2041/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	500	529	85,688	2044/ 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	3.25	600	512	83,004	2046/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	550	426	69,053	2047/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	600	526	85,300	2048/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	600	558	90,374	2049/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	600	429	69,540	2050/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	420	252	40,858	2051/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	100	101	16,443	2053/10/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	550	395	63,982	2067/ 3/ 1
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	950	1,112	180,117	2041/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	570	648	105,095	2060/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	900	870	140,932	2025/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	650	613	99,389	2026/ 2/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	1,700	1,722	278,922	2026/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,800	2,658	430,456	2026/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,250	1,183	191,616	2027/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,600	2,602	421,426	2027/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,230	2,058	333,395	2028/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,250	1,143	185,186	2028/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,600	1,431	231,743	2029/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,400	1,202	194,745	2029/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,100	2,077	336,504	2030/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,300	1,919	310,897	2030/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,800	1,458	236,254	2031/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,850	1,476	239,051	2032/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	800	750	121,529	2032/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,500	1,281	207,506	2034/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,100	901	145,914	2036/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,200	1,001	162,253	2039/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	900	595	96,479	2040/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,200	941	152,479	2048/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,100	754	122,175	2050/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	530	278	45,086	2053/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	350	326	52,796	2054/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	190	72	11,804	2072/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,400	1,634	264,740	2035/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,480	1,676	271,572	2029/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,300	1,588	257,211	2032/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	750	785	127,256	2025/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,950	1,884	305,174	2025/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,700	1,565	253,586	2031/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	1,190	1,184	191,890	2045/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	900	992	160,697	2038/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	930	1,044	169,109	2055/ 4/25

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	
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,280	2,128	344,696	2026/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	850	570	92,322	2066/ 5/25
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	500	563	91,310	2042/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	500	564	91,338	2037/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	520	499	80,966	2025/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	950	901	145,908	2026/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	700	658	106,562	2027/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	700	647	104,840	2028/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	250	221	35,838	2029/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	425	68,833	2030/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	800	662	107,271	2031/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	650	643	104,224	2033/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	450	305	49,456	2038/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	370	261	42,322	2040/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	100	106	17,205	2044/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	540	536	86,927	2047/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	550	262	42,533	2052/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	180	152	24,709	2054/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	700	773	125,262	2028/ 1/15
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	750	735	119,068	2025/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.65	1,050	1,071	173,440	2025/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	1,150	1,101	178,414	2026/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,600	1,531	247,977	2027/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,100	1,044	169,081	2027/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,100	1,034	167,597	2028/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	900	843	136,674	2028/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	600	557	90,309	2029/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	750	657	106,552	2029/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	850	731	118,487	2030/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	750	704	114,017	2030/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	1,550	1,257	203,704	2031/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7	2,200	1,818	294,497	2032/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	1,200	1,115	180,689	2033/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	870	745	120,725	2035/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	400	411	66,628	2039/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7	800	905	146,610	2041/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	680	437	70,854	2042/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	400	479	77,714	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	520	428	69,383	2048/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	550	293	47,585	2050/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	500	331	53,608	2052/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	270	130	21,062	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	1,550	1,527	247,318	2025/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	440	381	61,824	2046/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	950	1,022	165,524	2037/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9	900	1,035	167,657	2040/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9	1,800	1,920	311,056	2026/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	750	822	133,178	2028/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	350	314	50,929	2066/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	800	912	147,747	2029/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,050	1,252	202,906	2032/ 7/30
(ベルギー)						
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	400	387	62,777	2025/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	480	495	80,238	2026/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	380	357	57,817	2027/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	750	694	112,417	2028/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	580	529	85,804	2029/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	400	340	55,090	2030/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	900	796	128,973	2031/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	950	1,032	167,128	2032/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	200	163	26,498	2032/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	450	393	63,715	2033/ 4/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	450	452	73,214	2034/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	300	245	39,760	2037/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	300	256	41,491	2038/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	280	179	29,128	2040/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	370	417	67,598	2041/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	340	361	58,532	2045/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	350	251	40,700	2047/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	450	319	51,740	2050/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	580	449	72,797	2057/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	160	119	19,367	2066/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	260	108	17,512	2071/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	800	887	143,645	2028/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	500	593	96,071	2035/ 3/28
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2	230	223	36,167	2025/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.85	350	363	58,833	2026/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	700	664	107,535	2026/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	700	648	105,044	2028/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	350	314	50,886	2029/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	820	697	112,984	2030/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	550	453	73,459	2031/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	550	550	89,228	2033/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	300	286	46,330	2034/ 5/23
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	250	150	24,337	2040/10/20

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	3.15	240	239	38,845	2044/ 6/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	335	246	39,986	2047/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	390	225	36,532	2051/ 3/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	195	222	36,112	2062/ 1/26
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	120	71	11,529	2086/11/ 2
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1	190	142	23,065	2117/ 9/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.85	150	67	10,860	2120/ 6/30
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.15	400	446	72,264	2037/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	650	722	116,965	2027/ 7/15
(フィンランド)						
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	430	409	66,271	2026/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	120	111	17,985	2027/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	200	200	32,475	2028/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	300	272	44,057	2028/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	170	150	24,419	2029/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	30	25	4,071	2030/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	280	244	39,516	2031/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	230	188	30,586	2031/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	50	50	8,179	2033/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.125	200	169	27,378	2034/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	250	177	28,670	2036/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	150	95	15,404	2040/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.625	245	228	37,030	2042/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	170	123	19,921	2047/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	180	83	13,485	2052/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	80	78	12,658	2055/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	320	323	52,404	2025/ 7/ 4
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	100	82	13,322	2032/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.55	70	47	7,644	2041/ 4/22
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4	100	102	16,538	2025/ 3/13
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	220	190	30,870	2037/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	81	13,270	2031/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	170	131	21,251	2035/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	420	392	63,506	2028/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	650	625	101,334	2026/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1	220	204	33,050	2029/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	190	168	27,283	2033/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	500	459	74,459	2031/ 3/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	405	291	47,275	2050/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	250	209	33,952	2045/ 2/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	320	316	51,204	2030/ 5/15
小計					29,522,081	

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	650	611	115,795	2049/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	750	742	140,563	2042/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	900	922	174,572	2034/9/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	430	418	79,250	2039/9/7
UK GILT BOND	国債証券	4.0	920	828	156,785	2060/1/22
UK GILT BOND	国債証券	5.0	1,720	1,722	326,127	2025/3/7
UK GILT BOND	国債証券	2.0	1,650	1,587	300,519	2025/9/7
UK GILT BOND	国債証券	1.5	1,150	1,078	204,217	2026/7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	650	628	118,996	2040/12/7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	800	679	128,618	2045/1/22
UK GILT BOND	国債証券	3.75	970	836	158,287	2052/7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	847	160,372	2036/3/7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	800	835	158,156	2030/12/7
UK GILT BOND	国債証券	6.0	700	759	143,837	2028/12/7
UK GILT BOND	国債証券	0.375	800	632	119,732	2030/10/22
UK GILT BOND	国債証券	0.875	810	683	129,412	2029/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	500	450	85,194	2028/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	970	439	83,253	2071/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	900	520	98,523	2049/1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	880	459	87,004	2057/7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.5	820	513	97,256	2065/7/22
UK GILT BOND	国債証券	3.5	650	526	99,638	2068/7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	803	152,106	2046/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,050	1,065	201,752	2032/6/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,050	1,054	199,611	2027/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	950	891	168,811	2055/12/7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	600	619	117,282	2038/12/7
UK GILT BOND	国債証券	1.25	900	818	154,927	2027/7/22
UK GILT BOND	国債証券	0.25	1,390	1,055	199,721	2031/7/31
UK GILT BOND	国債証券	3.25	900	842	159,526	2033/1/31
UK GILT BOND	国債証券	1.75	700	513	97,140	2037/9/7
UK GILT BOND	国債証券	1.125	650	414	78,477	2039/1/31
UK GILT BOND	国債証券	4.75	100	101	19,253	2043/10/22
UK GILT BOND	国債証券	3.25	450	370	70,054	2044/1/22
小計					4,784,782	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	3,000	2,865	41,442	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	2,100	2,081	30,091	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	4,200	3,906	56,492	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,400	1,277	18,469	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,950	3,270	47,285	2039/3/30
小計					193,781	
(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	2,700	2,569	36,816	2026/2/19

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)		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	3,000	2,819	40,406	2027/ 2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,700	1,528	21,899	2029/ 9/ 6
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	2,200	1,896	27,171	2030/ 8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.125	1,300	1,144	16,393	2032/ 5/18
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	950	888	12,728	2033/ 8/15
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	750	737	10,568	2042/10/ 6
小計					165,984	
(デンマーク)			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,600	1,571	34,126	2025/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	3,400	3,161	68,678	2027/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,050	1,842	40,020	2029/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	3,160	3,912	84,987	2039/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	2,090	1,108	24,075	2052/11/15
小計					251,889	
(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	0.75	620	590	22,099	2025/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	2,580	2,516	94,165	2025/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	3,000	2,828	105,830	2026/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	3,220	3,287	122,999	2029/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,500	1,944	72,774	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,370	1,045	39,115	2032/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	640	663	24,816	2033/10/25
小計					481,802	
(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	3.25	50	49	4,869	2025/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	1,650	1,665	163,573	2026/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	930	957	94,016	2027/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	650	627	61,590	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	700	658	64,648	2028/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	370	359	35,345	2029/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	700	645	63,346	2030/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,400	1,152	113,155	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	910	725	71,276	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,250	1,803	177,142	2032/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,980	2,032	199,633	2033/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	490	425	41,776	2035/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	350	306	30,054	2039/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	400	318	31,265	2041/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	340	265	26,068	2047/ 3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	500	282	27,744	2051/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	130	134	13,242	2054/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	350	330	32,503	2037/ 4/21
小計					1,251,254	

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	
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル	千円	
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	540	524	48,387	2025/ 4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	800	664	61,384	2028/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	30	27	2,557	2029/ 4/20
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,150	933	86,153	2032/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	290	178	16,520	2041/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	205	134	12,396	2051/ 5/15
小計					227,400	
(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	850	859	96,032	2027/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	455	448	50,133	2025/ 6/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	650	642	71,782	2030/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	350	359	40,095	2033/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	240	220	24,656	2039/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	370	357	39,966	2042/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	110	105	11,770	2046/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	160	127	14,279	2050/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	190	153	17,086	2051/10/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	90	91	10,223	2072/ 8/ 1
小計					376,028	
(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	1,000	31,393	2027/ 5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.582	300	294	9,231	2032/ 7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.642	3,100	3,298	103,535	2033/11/ 7
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.757	200	192	6,056	2040/ 5/22
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.065	850	831	26,094	2050/ 6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.955	1,550	1,562	49,037	2025/ 9/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	2,500	2,528	79,369	2026/11/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.498	1,700	1,772	55,621	2030/ 4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.935	1,130	1,245	39,109	2043/ 9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.736	1,550	1,677	52,648	2046/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.921	450	497	15,628	2048/ 7/ 6
小計					467,728	
(中国)			千人民元	千人民元		
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.26	23,500	23,582	492,125	2025/ 2/24
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.24	21,200	21,237	443,192	2025/ 5/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.18	20,000	20,019	417,789	2025/ 8/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3	7,000	7,017	146,439	2026/ 5/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.69	39,100	39,599	826,379	2026/ 8/12
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.37	21,000	21,117	440,694	2027/ 1/20
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.48	15,000	15,123	315,601	2027/ 4/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.64	19,500	19,770	412,582	2028/ 1/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.91	42,000	43,163	900,765	2028/10/14
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.55	17,900	18,099	377,720	2028/10/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.37	9,000	9,034	188,545	2029/ 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	
(中国)		%	千人民元	千人民元	千円	
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	5,100	5,200	108,517	2029/ 6/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.62	7,000	7,079	147,747	2030/ 6/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.54	1,000	1,007	21,033	2030/12/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.02	18,300	19,021	396,945	2031/ 5/27
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.89	25,800	26,607	555,261	2031/11/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.88	15,000	15,519	323,879	2033/ 2/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.67	9,000	9,133	190,613	2033/ 5/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.52	8,500	8,538	178,185	2033/ 8/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.86	13,200	15,996	333,826	2049/ 7/22
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.53	10,500	12,202	254,642	2051/10/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.32	14,100	15,856	330,904	2052/ 4/15
小計					7,803,394	
(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	-	2,000	1,957	81,032	2025/ 8/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,300	1,255	51,971	2027/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,400	1,316	54,474	2028/ 9/28
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	880	746	30,897	2030/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	950	1,052	43,578	2042/ 1/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	1,240	1,110	45,980	2047/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	-	150	121	5,046	2032/ 4/30
小計					312,983	
合計					92,206,308	

(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('24年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 92,206,308	% 98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,251,427	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	93,457,735	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=150.38円、1カナダドル=111.38円、1メキシコペソ=8.8208円、1ユーロ=161.94円、1英ポンド=189.30円、1スウェーデンクローナ=14.46円、1ノルウェークローネ=14.33円、1デンマーククローネ=21.72円、1ポーランドズロチ=37.4169円、1オーストラリアドル=98.21円、1ニュージーランドドル=92.33円、1シンガポールドル=111.67円、1マレーシアリンギット=31.3886円、1人民元=20.8686円、1イスラエルシェケル=41.3877円、1オフショア人民元=20.8415円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(93,164,758千円)の投資信託財産総額(93,457,735千円)に対する比率は99.7%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

('24年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	93,487,759,028
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	537,918,604
公 社 債 (評 価 額)	92,206,308,892
未 収 入 金	30,071,340
未 収 利 息	677,680,675
前 払 費 用	35,779,517
(B) 負 債	259,163,915
未 払 金	241,494,583
未 払 解 約 金	17,668,896
未 払 利 息	217
そ の 他 未 払 費 用	219
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	93,228,595,113
元 本	32,087,499,983
次 期 繰 越 損 益 金	61,141,095,130
(D) 受 益 権 総 口 数	32,087,499,983口
1万口当たり基準価額 (C / D × 10,000)	29,054円

- (注1) 期首元本額 39,505,032,684円
 期中追加設定元本額 3,568,386,896円
 期中一部解約元本額 10,985,919,597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	6,522,141,699円
バランスファンドVA50B <適格機関投資家限定>	5,226,113,526円
4資産バランス40VA <適格機関投資家限定>	2,726,042,591円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き(年1) <適格機関投資家限定>	2,648,325,399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)	2,341,135,762円
バランスファンドVA35A <適格機関投資家限定>	1,718,423,064円
世界国債タムスブレッド・プレミア戦略ファンド/為替ヘッジ付 <適格機関投資家限定>	1,564,858,301円
バランスファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,389,443,841円
世界分散ファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,073,298,832円
バランスファンドVA37.5A <適格機関投資家限定>	901,135,728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(ステイブル)	796,641,718円
グローバルバランス40VA2 <適格機関投資家限定>	691,277,057円
4資産インデックスバランスVA20 <適格機関投資家限定>	663,700,649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>	643,266,255円
外国債券バッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	517,318,076円
4資産バランス30VA <適格機関投資家限定>	508,872,030円
4資産バランス20VA <適格機関投資家限定>	422,909,834円
バランスファンドVA25B <適格機関投資家限定>	409,339,503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	271,289,355円
Ta d リスク/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)	182,418,457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>	178,832,429円
Ta d リスク/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>	174,506,643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>	65,074,366円

◎損益の状況

当期(自'23年2月21日 至'24年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	2,635,949,263
受 取 利 息	2,636,063,026
そ の 他 収 益 金	29,768
支 払 利 息	△ 143,531
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,258,170,057
売 買 益	13,092,199,231
売 買 損	△ 1,834,029,174
(C) そ の 他 費 用	△ 37,267,149
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	13,856,852,171
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	60,501,152,432
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,145,618,953
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 19,362,528,426
(H) 次 期 繰 越 損 益 金 (H)	61,141,095,130

- (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。

フレックス資産配分戦略ファンド <適格機関投資家限定>	64,152,607円
グローバル4資産30VA <適格機関投資家限定>	60,485,928円
バランスファンドVA40C <適格機関投資家限定>	59,284,371円
バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	49,349,187円
グローバル4資産45VA <適格機関投資家限定>	48,955,179円
グローバルバランス40VA3 <適格機関投資家限定>	30,445,613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	29,972,360円
4資産インデックスバランスVA50 <適格機関投資家限定>	28,574,469円
4資産バランス30VA2 <適格機関投資家限定>	23,931,189円
バランスファンドVA75A <適格機関投資家限定>	19,758,715円
世界バランス40VA <適格機関投資家限定>	10,472,898円
グローバルバランス50VA <適格機関投資家限定>	9,971,451円
世界バランス60VA <適格機関投資家限定>	6,432,090円
バランスファンドVA40B <適格機関投資家限定>	1,907,466円
バランスファンドVA50A <適格機関投資家限定>	1,436,172円
バランスファンドVA30A <適格機関投資家限定>	1,365,542円
バランスファンドVA20A <適格機関投資家限定>	1,291,345円
バランスファンドVA50C <適格機関投資家限定>	1,259,139円
バランスファンドVA35B <適格機関投資家限定>	1,051,916円
グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	608,168円
ステート・ストリート・グローバル債券インデックス・オープン(隔月分配型)	349,518円
バランスファンドVA40A <適格機関投資家限定>	79,545円