

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

外国債券SMTBセレクション (SMA専用)

運用報告書(全体版)

第9期(決算日 2024年4月26日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率				
第5期(2020年4月27日)	円 9,283	円 0	% 1.3	% 71.9	% 1.0	% 24.9	百万円 83,337
第6期(2021年4月26日)	9,815	0	5.7	72.6	0.6	24.4	92,153
第7期(2022年4月26日)	10,090	0	2.8	61.9	0.7	35.6	106,834
第8期(2023年4月26日)	10,113	0	0.2	44.5	0.1	52.2	77,299
第9期(2024年4月26日)	11,537	0	14.1	42.5	—	55.3	213,019

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率			
(当期首) 2023年 4月26日	円 10,113	% —	% 44.5	% 0.1	% 52.2
4月末	10,097	△0.2	44.5	0.1	52.2
5月末	10,318	2.0	41.6	—	56.1
6月末	10,731	6.1	41.9	—	55.9
7月末	10,480	3.6	42.1	—	55.6
8月末	10,779	6.6	42.0	—	55.8
9月末	10,689	5.7	42.1	—	55.7
10月末	10,578	4.6	37.0	—	48.7
11月末	10,965	8.4	42.3	—	55.8
12月末	11,015	8.9	41.9	—	55.9
2024年 1月末	11,223	11.0	42.4	—	55.8
2月末	11,341	12.1	42.3	—	55.7
3月末	11,506	13.8	42.5	—	55.7
(当期末) 2024年 4月26日	11,537	14.1	42.5	—	55.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

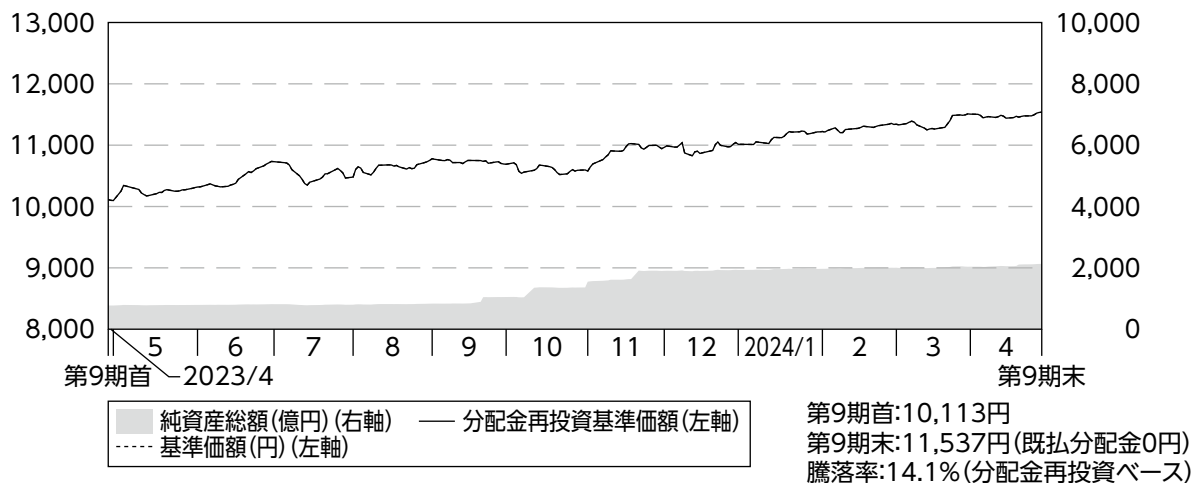
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2023年4月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの投資対象ファンドの騰落率は以下の通りです。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
世界債券総合インデックスマザーファンド	ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)を構成する通貨建ての債券等	49.7%	15.4%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	日本を除く世界の公社債	19.6%	14.1%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	世界各国の投資適格債券(除く日本円)	14.7%	14.3%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	日本を除く世界の債券等	14.7%	16.9%
マネープールマザーファンド	わが国の公社債等	0.0%	△0.0%

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

○先進国債券市場

主要国の長期金利は、期初から2023年10月下旬にかけて、堅調な米経済指標やインフレ圧力を受けて、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利を長期的に高水準に維持するとの見方が広がったことなどから上昇しました。その後は、労働需給の軟化やインフレ鈍化を示す指標を受けて米国の早期利下げ観測が高まったことなどにより、金利は低下に転じました。2024年年明け以降は、米国の堅調な経済指標等を背景に早期利下げ開始観測が後退したため再び金利は上昇しました。4月にはFRBパウエル議長など複数の高官が利下げ開始に慎重な姿勢を示したことなどを受け、米国金利を中心に主要国の長期金利は上昇しました。

○新興国債券市場

当期初から2023年10月下旬にかけて米国やユーロ圏で政策金利の高止まりが長期化するとの見方が強まったことなどから、主要国の長期金利が大幅に上昇し新興国の長期金利も概ね上昇しました。11月から年末にかけては、米国や欧州で利上げ局面が終了したとの見方が強まったことや早期利下げ開始観測の高まりを受けた主要国の金利低下が新興国にも波及し、長期金利は低下しました。2024年2月には米国で雇用や物価の経済指標が上振れたことや、FRB、ECB（欧州中央銀行）の高官から先行きの利下げ開始に慎重な発言が相次ぎ、主要国の長期金利が上昇したことを受けて新興国債券の金利も上昇しました。当期末にかけても主要国の金利が上昇基調となる中、新興国債券の長期金利も上昇基調となりました。

○外国為替市場

当期初から2023年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に、概ね主要通貨は対円で上昇しました。その後年末にかけては、米国の早期利下げ観測の高まりなどにより、対円での上昇幅は縮小しましたが、2024年年初以降は、米国の堅調な経済指標等を背景に早期利下げ観測が後退したことなどから、再び対円での上昇幅は拡大しました。日銀が4月下旬に開催した日銀金融政策決定会合で政策金利現状維持を決定した後の記者会見で、植田総裁が円安について「基調的な物価上昇率への大きな影響はない」と言及したことで、円安を理由にした追加的な利上げの時期は遠いとの見方が広がり、主要通貨が対円で大幅に上昇する局面もありました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

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

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

・外国債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しに伴い売却を行い、当期末時点における組み入れはありません。

・新興国債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しに伴い売却を行い、当期末時点における組み入れはありません。

・世界債券総合インデックスマザーファンド

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は49.7%となりました。

・ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は19.6%となりました。

・フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は14.7%となりました。

・PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class

投資割合の見直しに伴い、当期末時点における組入比率は14.7%となりました。

組入ファンド	当期首(前期末)	当期末
外国債券インデックス マザーファンド	23.4%	—
新興国債券インデックス マザーファンド	4.8%	—
世界債券総合インデックスマザーファンド	20.8%	49.7%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	19.8%	19.6%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	15.0%	14.7%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	14.8%	14.7%
マネープールマザーファンド	0.0%	0.0%

(注)比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

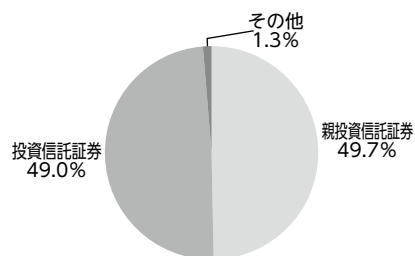
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

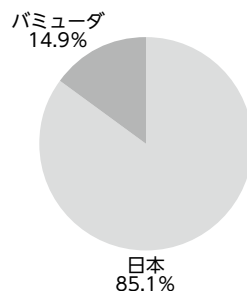
	当期末
	2024年4月26日
世界債券総合インデックスマザーファンド	49.7%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	19.6%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	14.7%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	14.7%
マネープールマザーファンド	0.0%
その他	1.3%
組入ファンド数	5

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

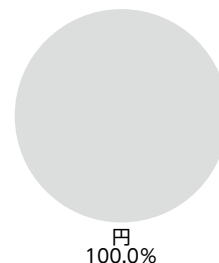
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第9期	
	2023年4月27日~2024年4月26日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	2,076	

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

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

(注3)―印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

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

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年4月27日~2024年4月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	63円	0.583%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は10,810円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(34)	(0.319)	
(販売会社)	(24)	(0.220)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.030	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(3)	(0.028)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	66	0.614	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

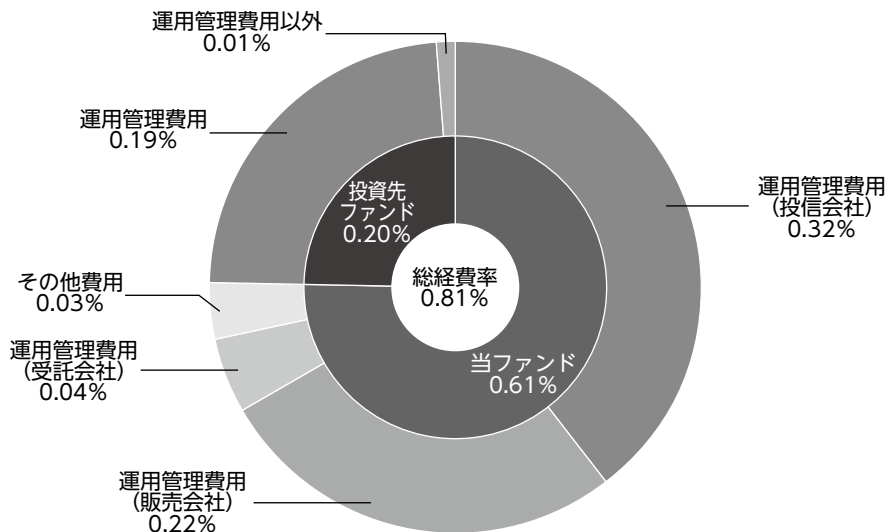
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.81%です。



総経費率 (①+②+③)	0.81%
①当ファンドの費用の比率	0.61%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.19%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

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

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

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

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国 内	PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	千口 1,579	千円 17,670,260	千口 89	千円 998,040
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ ファンド(適格機関投資家専用)	16,062,267	17,998,060	906,190	1,026,888
	ウエスタン・グローバル債券 ファンド(適格機関投資家専用)	18,067,754	23,866,980	878,666	1,193,716

(注)金額は受渡代金です。

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 5,817,650	千円 18,300,600
新興国債券インデックス マザーファンド	—	—	1,942,180	3,774,433
世界債券総合インデックスマザーファンド	77,504,768	82,415,520	2,070,710	2,283,110

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投資信託受益証券	百万円 59,535	百万円 41,865	% 70.3	百万円 3,218	百万円 2,220	% 69.0
金 銭 信 託	400	400	100.0	400	400	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	851,478	44,723	5.3	849,412	44,242	5.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	44,862	264	0.6	33,417	163	0.5
金 銭 信 託	49	49	100.0	49	49	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	627,585	53,260	8.5	625,131	52,701	8.4

<平均保有割合 6.4%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	27	27	100.0	27	27	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	373,903	31,672	8.5	372,494	31,353	8.4

<平均保有割合 3.6%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<世界債券総合インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	96,746	2,668	2.8	5,048	1,243	24.6
金 銭 信 託	3	3	100.0	3	3	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	111,679	8,878	7.9	111,728	8,884	8.0

<平均保有割合 85.6%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<マネープールマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	3,258	3,258	100.0	3,258	3,258	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	52,372,986	4,228,752	8.1	52,587,619	4,270,495	8.1

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
債券ファンド	千口	千円	%
PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class	2,596	31,416,519	14.7
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	26,232,336	31,289,931	14.7
ウェスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	29,581,263	41,679,999	19.6
合 計	55,816,196	104,386,450	49.0

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当 期 首(前 期 末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	5,817,650	—	—
新興国債券インデックス マザーファンド	1,942,180	—	—
世界債券総合インデックスマザーファンド	16,000,000	91,434,057	105,862,352
マネープールマザーファンド	9	9	9

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

世界債券総合インデックスマザーファンド	105,569,240千口
マネープールマザーファンド	156,971,071千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 104,386,450	% 48.8
世界債券総合インデックスマザーファンド	105,862,352	49.5
マネープールマザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	3,510,177	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	213,758,988	100.0

(注1) 世界債券総合インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(122,018,119千円)の投資信託財産総額(123,171,269千円)に対する比率は99.1%です。

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

1米ドル=155.76円	1カナダドル=114.05円	1メキシコペソ=9.0608円
1ブラジルリアル=30.1485円	1チリペソ=0.163956円	1コロンビアペソ=0.039332円
1ペルー・ソル=41.4496円	1ウルグアイペソ=4.047円	1ドミニカペソ=2.6487円
1ユーロ=167.05円	1イギリスポンド=194.76円	1スイスフラン=170.58円
1スウェーデンクローナ=14.30円	1ノルウェークローネ=14.21円	1デンマーククローネ=22.40円
1チェココナナ=6.6445円	1ハンガリーフォリント=0.425129円	1ポーランドズロチ=38.7262円
1ルーマニア・レイ=33.576円	1オーストラリアドル=101.65円	1ニュージーランドドル=92.90円
1シンガポールドル=114.59円	1マレーシアリングギット=32.575円	1タイバーツ=4.21円
1インドネシアルピア=0.0097円	1韓国ウォン=0.1135円	1オフショア人民元=21.4529円
1イスラエルシェケル=40.9285円	1南アフリカランド=8.19円	

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2024年4月26日現在
(A)資 産	213,758,988,710円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,510,169,382
投資信託受益証券(評価額)	104,386,450,728
世界債券総合インデックス マザーファンド(評価額)	105,862,352,131
マネーボールマザーファンド(評価額)	9,956
未 収 利 息	6,513
(B)負 債	739,000,471
未 払 解 約 金	177,506,787
未 払 信 託 報 酬	560,222,764
そ の 他 未 払 費 用	1,270,920
(C)純 資 産 総 額(A-B)	213,019,988,239
元 本	184,640,056,898
次 期 繰 越 損 益 金	28,379,931,341
(D)受 益 権 総 口 数	184,640,056,898口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,537円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年4月27日 至 2024年4月26日
(A)配 当 等 収 益	△673,063円
受 取 利 息	274,469
支 払 利 息	△947,532
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	18,331,917,641
売 買 益	19,719,855,525
売 買 損	△1,387,937,884
(C)信 託 報 酬 等	△818,990,662
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	17,512,253,916
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,589,146,104
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	8,278,531,321
(配 当 等 相 当 額)	(18,094,682,199)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△9,816,150,878)
(G) 計 (D+E+F)	28,379,931,341
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	28,379,931,341
追 加 信 託 差 損 益 金	8,278,531,321
(配 当 等 相 当 額)	(18,239,969,205)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△9,961,437,884)
分 配 準 備 積 立 金	20,101,400,020

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は76,433,560,415円、期中追加設定元本額は130,321,267,290円、期中一部解約元本額は22,114,770,807円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	1,965,670,340円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	15,460,688,789円
(C) 収益調整金額	18,239,969,205円
(D) 分配準備積立金額	2,675,040,891円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	38,341,369,225円
(F) 期末残存口数	184,640,056,898口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	2,076円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

投資対象とする投資信託証券を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日:2023年7月27日)

信託期間を無期限とするため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日:2024年1月27日)

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	日本を除く世界の公社債
運用の基本方針	この投資信託は、主に日本を除く世界の公社債に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

●損益の状況

項目	第 5 期 自 2022年10月12日 至 2023年10月10日
(A)有価証券売買損益	1,102,024,430円
売 益	1,151,685,986
売 損	△49,661,556
(B)信託報酬等	△64,186,759
(C)当期損益金(A+B)	1,037,837,671
(D)前期繰越損益金	1,262,429,844
(E)追加信託差損益金	3,244,638,997
(配当等相当額)	(2,498,342,177)
(売買損益相当額)	(746,296,820)
(F)計(C+D+E)	5,544,906,512
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	5,544,906,512
追加信託差損益金	3,244,638,997
(配当等相当額)	(2,518,412,971)
(売買損益相当額)	(726,226,026)
分配準備積立金	2,300,267,515

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 4 期 末	第 5 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ウエスタン・グローバル債券マザーファンド	14,367,949	19,211,702	25,096,247

下記は、ウエスタン・グローバル債券マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
国債証券					
COLOMBIA GOVT	5.625	260	176	26,177	2044/2/26
FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	690	494	73,446	2045/1/27
REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	260	160	23,922	2045/6/15
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	910	776	115,367	2028/10/12
TSY INFL IX N/B	1.375	4,040	3,682	547,263	2033/7/15
UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,100	783	116,442	2046/1/23
US TREASURY NOTE	1.5	2,550	2,511	373,157	2024/2/29
US TREASURY NOTE	0.375	3,490	3,154	468,778	2025/12/31
US TREASURY NOTE	0.375	16,710	15,040	2,234,989	2026/1/31
US TREASURY NOTE	0.75	5,280	4,754	706,514	2026/4/30
US TREASURY NOTE	2.5	190	176	26,153	2027/3/31
US TREASURY NOTE	2.625	7,340	6,802	1,010,794	2027/5/31
US TREASURY NOTE	3.875	2,730	2,634	391,542	2027/11/30
US TREASURY NOTE	1.375	3,750	3,179	472,443	2028/10/31
US TREASURY NOTE	1.125	1,020	563	83,696	2040/5/15
US TREASURY NOTE	2.0	270	169	25,138	2041/11/15
US TREASURY NOTE	2.875	180	125	18,652	2045/8/15
US TREASURY NOTE	1.375	6,900	3,203	475,982	2050/8/15
US TREASURY NOTE	4.0	380	323	48,006	2052/11/15
US TREASURY NOTE	3.625	40	31	4,713	2053/2/15
US TREASURY NOTE	3.625	940	745	110,830	2053/5/15
特殊債券(除金融債)					
DELTA AIR LINES	4.5	45	43	6,512	2025/10/20
DELTA AIR LINES	4.75	60	56	8,428	2028/10/20
FHLMC #G67721	4.5	20	18	2,782	2049/4/1
FHLMC #Q59799	5.0	14	13	2,050	2048/11/1
FNMA #AL9546	3.5	38	34	5,060	2046/11/1
FNMA #AS9760	4.5	50	47	7,020	2047/6/1
FNMA #BK5659	2.0	250	189	28,173	2050/10/1
FNMA #BK7700	4.5	71	66	9,949	2048/10/1
FNMA #BM4897	3.5	35	30	4,594	2046/12/1
FNMA #BP2319	3.0	53	44	6,622	2050/2/1
FNMA #BQ3331	2.0	76	58	8,635	2050/8/1
FNMA #BQ4926	2.0	73	55	8,304	2050/10/1
FNMA #BR0663	2.0	79	60	9,008	2051/2/1
FNMA #BR2664	2.0	70	54	8,031	2051/2/1
FNMA #BR4052	2.0	76	57	8,596	2051/2/1
FNMA #BR9104	2.5	70	56	8,417	2051/5/1
FNMA #BR9750	2.0	248	189	28,113	2051/4/1
FNMA #BT5574	2.5	81	64	9,538	2051/8/1
FNMA #BU1030	2.0	84	65	9,665	2051/11/1
FNMA #BU1421	3.0	88	73	10,952	2052/1/1
FNMA #CA2047	4.5	44	41	6,196	2048/7/1
FNMA #CA2472	4.0	28	25	3,829	2048/10/1
FNMA #CA2482	4.5	42	39	5,833	2048/10/1
FNMA #CA2652	5.0	53	51	7,639	2048/11/1
FNMA #CA5371	4.0	55	49	7,377	2050/3/1
FNMA #CA7531	3.0	72	61	9,075	2050/10/1

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FNMA #CA9121	2.5	74	59	8,808	2051/2/1
FNMA #CA9220	2.0	80	61	9,151	2051/2/1
FNMA #CB1666	2.5	172	137	20,436	2051/9/1
FNMA #CB3044	2.5	91	72	10,801	2052/3/1
FNMA #CB3234	3.0	90	74	11,090	2052/4/1
FNMA #CB3320	4.0	90	80	11,968	2052/4/1
FNMA #CB5316	6.0	179	175	26,122	2052/12/1
FNMA #CB5892	4.5	96	87	13,030	2053/3/1
FNMA #CB6030	4.5	98	90	13,424	2053/4/1
FNMA #FM1468	5.0	15	15	2,255	2049/8/1
FNMA #FM1727	5.0	23	22	3,328	2049/9/1
FNMA #FM2256	4.5	73	68	10,147	2044/10/1
FNMA #FM3773	3.5	443	386	57,451	2048/11/1
FNMA #FM4899	2.5	52	41	6,157	2050/11/1
FNMA #FM6117	3.0	159	133	19,894	2051/4/1
FNMA #FM6184	2.0	146	112	16,771	2051/3/1
FNMA #FM6448	2.0	83	63	9,474	2051/3/1
FNMA #FM6460	2.5	75	60	8,955	2051/3/1
FNMA #FM7786	4.0	155	139	20,730	2049/1/1
FNMA #FM7900	2.5	80	64	9,568	2051/7/1
FNMA #FM7910	2.5	82	66	9,820	2051/7/1
FNMA #FM8576	3.0	745	630	93,633	2050/2/1
FNMA #FM8786	2.5	168	134	19,924	2051/10/1
FNMA #FM8864	2.5	81	64	9,624	2051/10/1
FNMA #FM9195	2.5	85	67	10,002	2051/10/1
FNMA #FM9464	3.0	81	68	10,123	2051/11/1
FNMA #FS0028	2.5	86	68	10,197	2051/9/1
FNMA #FS0424	2.5	86	69	10,281	2052/1/1
FNMA #FS0439	2.5	86	69	10,255	2052/1/1
FNMA #FS0523	2.5	89	71	10,597	2052/2/1
FNMA #FS0549	2.5	179	142	21,231	2052/2/1
FNMA #FS0751	3.0	87	72	10,703	2052/3/1
FNMA #FS0957	3.0	89	74	11,019	2052/3/1
FNMA #FS0965	2.0	88	67	10,076	2051/11/1
FNMA #FS1107	2.5	84	67	10,061	2051/12/1
FNMA #FS1118	3.5	85	73	10,891	2052/3/1
FNMA #FS1171	3.0	258	212	31,619	2052/1/1
FNMA #FS1289	3.0	86	72	10,831	2052/3/1
FNMA #FS1374	3.0	90	74	11,030	2052/3/1
FNMA #FS1556	3.5	90	78	11,591	2052/5/1
FNMA #FS1603	3.5	89	77	11,468	2052/5/1
FNMA #FS2442	4.0	93	82	12,297	2052/7/1
FNMA #FS2768	2.0	557	424	63,143	2052/1/1
FNMA #FS2914	4.5	93	85	12,724	2052/9/1
FNMA #FS3339	3.5	186	159	23,712	2052/6/1
FNMA #FS3941	5.0	96	90	13,510	2053/2/1
FNMA #FS4269	2.0	95	73	10,961	2051/10/1
FNMA #FS4270	2.0	95	73	10,881	2052/3/1
FNMA #FS4454	6.0	93	91	13,633	2053/4/1

第	5	期 末				
		銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
FNMA #FS4979	5.5	96	92	13,760	2053/5/1	
FNMA #FS5059	3.5	192	168	25,019	2048/11/1	
FNMA #FS5155	5.0	290	273	40,685	2053/7/1	
FNMA #FS5437	5.5	198	190	28,253	2053/6/1	
FNMA #MA4031	4.5	22	20	3,082	2050/5/1	
FNMA #MA4237	2.0	459	350	52,040	2051/1/1	
FNMA #MA4325	2.0	83	63	9,390	2051/5/1	
FNMA #MA4422	2.0	82	66	9,923	2041/9/1	
FNMA 30YR NOV FWD	6.0	1,200	1,177	174,956	2050/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	6.5	1,100	1,099	163,429	2050/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	2.5	900	711	105,742	2051/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	3.0	100	82	12,247	2051/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	3.5	600	513	76,348	2051/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	4.0	400	354	52,649	2051/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	5.0	700	656	97,602	2051/11/1	
FNMA 30YR NOV FWD	5.5	1,000	961	142,806	2051/11/1	
FNR 2012-118 VZ	3.0	130	113	16,876	2042/11/25	
G2SF 30YR OCT FWD	6.0	900	888	131,969	2050/10/1	
G2SF 30YR OCT FWD	6.5	400	401	59,672	2050/10/1	
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	700	660	98,220	2051/10/1	
G2SF 30YR OCT FWD	5.5	800	773	114,997	2051/10/1	
G2SF 30YR OCT FWD	4.5	200	183	27,322	2051/10/1	
GNMA #783669	3.0	48	42	6,298	2042/9/15	
GNMA #784571	3.5	61	55	8,195	2048/6/15	
GNMA #AA5649	3.0	17	15	2,250	2042/9/15	
GNMA #AB9109	3.0	14	12	1,809	2042/10/15	
GNMA #AB9207	3.0	12	10	1,565	2042/11/15	
GNMA #BS8439	3.5	40	35	5,326	2050/5/15	
GNMA II 30YR OCT FWD	3.0	600	506	75,308	2051/10/1	
GNMA II 30YR OCT FWD	3.5	300	261	38,923	2051/10/1	
GNMA II 30YR OCT FWD	4.0	400	358	53,337	2051/10/1	
GNMA II 30YR OCT FWD	2.5	200	163	24,271	2051/10/1	
GNMA2 #784825	3.5	11	9	1,436	2049/10/20	
GNMA2 #784905	3.0	59	50	7,556	2050/1/20	
GNMA2 #785218	2.0	74	58	8,689	2050/12/20	
GNMA2 #785219	2.0	72	56	8,407	2050/12/20	
GNMA2 #785220	2.0	77	60	9,042	2050/12/20	
GNMA2 #785221	2.0	75	59	8,771	2050/12/20	
GNMA2 #785558	2.5	81	65	9,719	2051/7/20	
GNMA2 #785657	2.5	84	68	10,135	2051/10/20	
GNMA2 #785791	2.5	169	136	20,248	2051/12/20	
GNMA2 #786095	3.0	92	76	11,302	2052/4/20	
GNMA2 #786134	3.0	82	68	10,157	2052/4/20	
GNMA2 #786335	4.5	93	86	12,872	2052/9/20	
GNMA2 #786474	5.0	95	90	13,508	2053/1/20	
GNMA2 #786583	3.0	191	162	24,109	2052/3/20	
GNMA2 #786843	3.0	98	82	12,248	2052/3/20	
GNMA2 #BS8420	4.0	30	27	4,125	2050/4/20	
GNMA2 #BS8546	2.5	71	56	8,438	2050/12/20	
GNMA2 #BZ4350	2.5	92	74	11,016	2051/3/20	
GNMA2 #CD8312	2.5	73	59	8,781	2051/5/20	
GNMA2 #MA1995	3.5	27	24	3,593	2044/6/20	
GNMA2 #MA3875	4.0	174	158	23,574	2046/8/20	

第	5	期 末				
		銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
GNMA2 #MA4068	3.0	17	15	2,269	2046/11/20	
GNMA2 #MA4836	3.0	5	4	686	2047/11/20	
GNMA2 #MA4838	4.0	14	12	1,898	2047/11/20	
GNMA2 #MA4901	4.0	13	12	1,878	2047/12/20	
GNMA2 #MA5019	3.5	16	14	2,133	2048/2/20	
GNMA2 #MA5078	4.0	92	84	12,551	2048/3/20	
GNMA2 #MA5137	4.0	10	9	1,395	2048/4/20	
GNMA2 #MA5193	4.5	55	52	7,756	2048/5/20	
GNMA2 #MA5194	5.0	18	18	2,694	2048/5/20	
GNMA2 #MA5265	4.5	99	92	13,740	2048/6/20	
GNMA2 #MA5331	4.5	9	8	1,265	2048/7/20	
GNMA2 #MA5398	4.0	83	76	11,322	2048/8/20	
GNMA2 #MA5465	3.5	141	125	18,628	2048/9/20	
GNMA2 #MA5467	4.5	19	17	2,661	2048/9/20	
GNMA2 #MA5594	3.5	80	71	10,567	2048/11/20	
GNMA2 #MA5597	5.0	15	14	2,175	2048/11/20	
GNMA2 #MA5653	5.0	46	44	6,618	2048/12/20	
GNMA2 #MA5711	4.5	90	84	12,587	2049/1/20	
GNMA2 #MA5712	5.0	14	13	2,069	2049/1/20	
GNMA2 #MA5764	4.5	91	85	12,659	2049/2/20	
GNMA2 #MA5818	4.5	75	70	10,463	2049/3/20	
GNMA2 #MA5878	5.0	18	18	2,685	2049/4/20	
GNMA2 #MA5929	3.0	48	41	6,124	2049/5/20	
GNMA2 #MA6287	5.0	16	15	2,367	2049/11/20	
GNMA2 #MA6413	5.0	18	17	2,644	2050/1/20	
GNMA2 #MA6477	4.5	16	15	2,254	2050/2/20	
GNMA2 #MA6544	4.5	17	16	2,472	2050/3/20	
GNMA2 #MA7194	3.0	306	260	38,650	2051/2/20	
GNMA2 #MA7312	2.5	7	5	858	2051/4/20	
GNMA2 #MA7589	2.5	164	134	19,984	2051/9/20	
GNMA2 #MA7590	3.0	77	65	9,706	2051/9/20	
GNMA2 #MA7768	3.0	254	215	31,963	2051/12/20	
GNMA2 #MA7937	3.0	79	67	9,997	2052/3/20	
GNMA2 #MA7989	3.5	274	239	35,591	2052/4/20	
GNMA2 #MA8197	2.5	89	73	10,882	2052/8/20	
GNMA2 #MA8268	4.5	94	87	12,974	2052/9/20	
GNMA2 #MA8424	3.0	93	79	11,766	2052/11/20	
GNMA2 #MA8429	5.5	188	182	27,192	2052/11/20	
GNMA2 #MA8486	3.0	92	78	11,625	2052/12/20	
GNMA2 #MA8487	3.5	192	167	24,956	2052/12/20	
GNMA2 #MA8490	5.0	479	453	67,316	2052/12/20	
GNMA2 #MA8569	5.0	290	274	40,809	2053/1/20	
GNMA2 #MA8642	2.5	94	77	11,513	2053/2/20	
GNMA2 #MA8725	5.0	97	92	13,717	2053/3/20	
GNMA2 #MA8796	3.0	94	80	11,888	2053/4/20	
GNR 2020-H04 FP	5.29361	115	114	16,990	2069/6/20	
GNR 2020-H13 FA	5.00022	63	61	9,143	2070/7/20	
MILEAGE PLUS HOLDINGS LLC	6.5	52	51	7,700	2027/6/20	
QB3535	2.0	292	223	33,145	2050/9/1	
QB4985	2.0	74	56	8,453	2050/11/1	
QB6998	2.0	73	56	8,339	2050/12/1	
QB9057	2.0	78	59	8,848	2051/2/1	
QB9290	2.0	81	62	9,317	2051/3/1	

銘 柄	第 5 期 末	評 価 額				
		利 率 (%)	額 面 金 額	外 貨 建 金 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
QC5830	2.5	84	67	10,058	2051/8/1	
QC9443	2.5	88	69	10,384	2051/10/1	
QC9511	2.0	86	66	9,851	2051/10/1	
QK1354	2.0	87	70	10,444	2042/2/1	
RA3913	2.5	357	286	42,636	2050/11/1	
RA4414	2.5	72	57	8,552	2051/1/1	
RA4703	2.0	78	59	8,893	2051/2/1	
RA7183	4.0	87	77	11,571	2052/4/1	
RA7185	4.0	178	158	23,501	2052/4/1	
RA7186	4.0	177	157	23,424	2052/4/1	
RA8790	5.0	98	92	13,678	2053/4/1	
RB5131	2.0	84	67	10,089	2041/10/1	
SD0573	2.0	70	54	8,165	2051/4/1	
SD0857	2.5	270	214	31,904	2052/1/1	
SD0958	3.5	87	75	11,232	2052/4/1	
SD1143	4.5	162	150	22,424	2050/9/1	
SD1218	4.0	506	455	67,658	2049/7/1	
SD1340	3.0	454	380	56,517	2052/3/1	
SD1749	2.5	93	74	11,069	2052/4/1	
SD1775	4.5	93	85	12,748	2052/11/1	
SD1807	4.5	94	86	12,847	2052/7/1	
SD1936	3.5	187	160	23,826	2052/6/1	
SD2245	5.5	95	92	13,717	2052/12/1	
SD2394	4.5	94	86	12,836	2052/11/1	
SD2395	5.0	92	86	12,844	2053/1/1	
SD2443	4.5	96	88	13,112	2052/10/1	
SD2452	6.5	91	92	13,691	2053/2/1	
SD2578	6.0	94	92	13,722	2053/3/1	
SD2591	5.0	95	89	13,336	2053/3/1	
SD2688	5.5	95	92	13,723	2053/4/1	
SD2756	5.5	96	92	13,799	2053/5/1	
SD2762	5.5	96	93	13,851	2053/5/1	
SD2792	4.5	93	87	12,959	2047/3/1	
SD2892	5.5	94	91	13,531	2053/5/1	
SD2919	5.5	195	187	27,909	2053/4/1	
SD2981	6.5	186	186	27,698	2053/5/1	
SD3171	5.5	95	91	13,638	2053/6/1	
SD7525	2.5	138	110	16,483	2050/10/1	
SD7548	2.5	342	274	40,752	2051/11/1	
SD7552	2.5	439	349	51,865	2052/1/1	
SD7554	2.5	357	286	42,541	2052/4/1	
SD7560	4.0	190	170	25,295	2053/2/1	
SD8121	2.0	612	466	69,335	2051/1/1	
SD8146	2.0	410	312	46,407	2051/5/1	
SD8214	3.5	183	156	23,322	2052/5/1	
UMBS 30YR NOV FWD	1.5	200	143	21,309	2051/11/1	
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	151	22,544	2051/11/1	
普通社債券 (含む投資法人債券)						
3M COMPANY	3.7	160	109	16,248	2050/4/15	
ABBVIE INC	4.875	10	8	1,251	2048/11/14	
ABBVIE INC	4.25	480	368	54,706	2049/11/21	

銘 柄	第 5 期 末	評 価 額				
		利 率 (%)	額 面 金 額	外 貨 建 金 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
AMERICAN INTL GROUP	2.5	28	26	3,924	2025/6/30	
AMERICAN TRANSMISSION SY	2.65	40	31	4,624	2032/1/15	
ANHEUSER-BUSCH	4.9	100	84	12,614	2046/2/1	
ANHEUSER-BUSCH	4.6	8	6	969	2048/4/15	
ANHEUSER-BUSCH	5.55	300	278	41,414	2049/1/23	
AT&T INC	4.5	405	295	43,932	2048/3/9	
BANK OF AMERICA CORP FRN	3.419	440	391	58,218	2028/12/20	
BANK OF AMERICA CORP FRN	4.571	210	183	27,201	2033/4/27	
BAUSCH HEALTH COS INC	6.25	50	18	2,821	2029/2/15	
BAUSCH HEALTH COS INC	7.25	20	7	1,096	2029/5/30	
BNP PARIBAS FRN	5.198	280	263	39,105	2030/1/10	
BOEING CO	5.15	170	160	23,819	2030/5/1	
BOEING CO	3.3	150	110	16,372	2035/3/1	
BOEING CO	5.805	430	380	56,542	2050/5/1	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2.9	20	19	2,906	2024/7/26	
BROADCOM INC-14A 351115	3.137	70	50	7,439	2035/11/15	
COO HDGS LLC/CAP CORP	4.5	210	170	25,271	2030/8/15	
COO HDGS LLC/CAP CORP	4.5	360	278	41,350	2032/5/1	
COO HDGS LLC/CAP CORP	4.5	200	149	22,146	2033/6/1	
COO HDGS LLC/CAP CORP	4.25	250	182	27,045	2034/1/15	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.908	60	58	8,713	2025/7/23	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.2	170	155	23,060	2028/3/15	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	3.5	20	12	1,814	2041/6/1	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.25	270	195	29,042	2053/4/1	
CHESTERE ENERGY INC	4.625	40	36	5,426	2028/10/15	
CIGNA CORP	4.375	130	121	18,118	2028/10/15	
CIGNA CORP	4.8	290	249	37,064	2038/8/15	
CIGNA CORP	4.9	110	89	13,353	2048/12/15	
CITIGROUP INC	8.125	570	648	96,401	2039/7/15	
CITIGROUP INC	4.65	180	139	20,661	2045/7/30	
CITIGROUP INC FRN	3.785	580	475	70,589	2033/3/17	
COCA-COLA CO	2.5	20	13	1,962	2040/6/1	
COCA-COLA CO	2.6	10	5	872	2050/6/1	
COMCAST CORP	4.15	390	365	54,346	2028/10/15	
COMCAST CORP	4.0	210	151	22,503	2048/3/1	
COMCAST CORP	2.987	50	26	3,944	2063/11/1	
CSC HOLDINGS LLC	4.125	890	627	93,228	2030/12/1	
CVS HEALTH CORP	4.3	116	108	16,193	2028/3/25	
CVS HEALTH CORP	3.75	110	96	14,288	2030/4/1	
CVS HEALTH CORP	5.05	650	525	78,141	2048/3/25	
DANSKE BANK A/S	5.375	200	199	29,622	2024/1/12	
DELTA AIR LINES	7.0	700	706	104,911	2025/5/1	
DEVON ENERGY CORPORATION	5.85	430	427	63,531	2025/12/15	
DEVON ENERGY CORPORATION	5.6	90	76	11,418	2041/7/15	
DEVON ENERGY CORPORATION	4.75	10	7	1,140	2042/5/15	
DIAMONDBACK ENERGY INC	3.5	70	61	9,139	2029/12/1	
DISH NETWORK CORP	2.375	340	327	48,599	2024/3/15	
ECOPETROL SA	5.375	780	743	110,546	2026/6/26	
ENERGY TRANSFER LP	5.95	130	111	16,523	2043/10/1	
ENERGY TRANSFER OPERATING	3.75	270	231	34,474	2030/5/15	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	5.1	410	352	52,319	2045/2/15	
FIRST QUANTUM MINERALS L	8.625	400	383	57,032	2031/6/1	
FORD MOTOR COMPANY	3.25	340	253	37,621	2032/2/12	

銘柄	第 5 期		末		
	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FREEMORE-MCMORAN INC	4.625	70	62	9,235	2030/8/1
FREEMORE-MCMORAN INC	5.45	50	41	6,179	2043/3/15
GALAXY PIPELINE ASSETS	2.625	680	519	77,173	2036/3/31
GENERAL MOTORS	6.6	60	56	8,441	2036/4/1
GENERAL MOTORS	6.75	60	54	8,066	2046/4/1
GOLDMAN SACHS GROUP	3.5	340	314	46,786	2026/11/16
GOLDMAN SACHS GROUP	6.75	320	315	46,906	2037/10/1
GOLDMAN SACHS GROUP FRN	2.615	80	61	9,103	2032/4/22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.15	1,150	952	141,486	2045/5/22
GSK CONSUMER HEALTHCARE	3.625	510	428	63,740	2032/3/24
HCA INC	5.375	10	9	1,469	2025/2/1
HCA INC	5.25	420	410	60,956	2026/6/15
HCA INC	5.625	10	9	1,440	2028/9/1
HCA INC	5.875	70	68	10,146	2029/2/1
HCA INC	3.5	100	83	12,441	2030/9/1
HOME DEPOT INC	2.7	70	58	8,767	2030/4/15
HOME DEPOT INC	3.625	110	75	11,194	2052/4/15
HSBC HOLDINGS PLC	4.25	640	613	91,150	2025/8/18
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.803	200	197	29,363	2025/3/11
HUMANA INC	2.15	20	14	2,211	2032/2/3
JPMORGAN CHASE & CO FRN	0.969	150	144	21,411	2025/6/23
JPMORGAN CHASE & CO FRN	4.452	500	461	68,584	2029/12/5
JPMORGAN CHASE & CO FRN	2.58	1,080	838	124,627	2032/4/22
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.25	10	8	1,333	2031/3/1
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.0	30	25	3,732	2042/6/4
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.2	110	93	13,860	2045/7/15
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.875	30	24	3,571	2049/10/1
MCDONALD'S CORP	4.2	30	22	3,331	2050/4/1
MORGAN STANLEY	3.95	130	119	17,820	2027/4/23
MORGAN STANLEY FRN	3.622	410	348	51,739	2031/4/1
MPLX LP	5.5	20	16	2,430	2049/2/15
NGPL PIPECO LLC	4.875	170	159	23,725	2027/8/15
NORTHROP GRUMMAN CORP	5.25	50	44	6,591	2050/5/1
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	300	212	31,616	2046/4/15
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	280	184	27,369	2049/8/15
PETROBRAS GLOBAL FINANCE	6.25	1,270	1,267	188,332	2024/3/17
RAYTHEON TECH CORP	2.25	50	39	5,897	2030/7/1
SANDS CHINA LTD	3.1	660	531	79,008	2029/3/8
SOUTHWESTERN ENERGY CO	4.75	10	8	1,251	2032/2/1
SPIRIT LOYALTY LT LTD/IP	8.0	47	47	7,079	2025/9/20
SUNOCO LOGISTICS PARTNER	5.35	90	71	10,580	2045/5/15
SUZANO AUSTRIA GMBH	3.125	1,000	748	111,237	2032/1/15
T-MOBILE USA INC	2.25	20	18	2,734	2026/2/15
T-MOBILE USA INC	2.625	50	42	6,249	2029/2/15
T-MOBILE USA INC	2.875	530	424	63,152	2031/2/15
T-MOBILE USA INC	3.5	50	41	6,176	2031/4/15
T-MOBILE USA INC	2.7	140	107	15,985	2032/3/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.5	20	19	2,934	2027/7/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	30	29	4,440	2029/1/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	4.0	10	8	1,221	2032/1/15
TEVA PHARMACEUTICALS NE	3.15	420	371	55,150	2026/10/1
TEVA PHARMACEUTICALS NE	5.125	400	357	53,101	2029/5/9
TIME WARNER ENT	8.375	260	273	40,581	2033/7/15

銘柄	第 5 期		末		
	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UNITED AIRLINES INC	4.625	600	513	76,284	2029/4/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	3.5	100	74	11,081	2039/8/15
VERIZON COMMUNICATIONS	4.329	650	606	90,085	2028/9/21
VERIZON COMMUNICATIONS	3.4	90	61	9,092	2041/3/22
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	5.5	430	377	56,097	2029/5/15
VISA INC	2.7	120	81	12,098	2040/4/15
VOC ESCROW LTD	5.0	280	252	37,499	2028/2/15
WELLS FARGO & COMPAN FRN	0.805	160	154	22,947	2025/5/19
WELLS FARGO & COMPAN FRN	2.879	390	320	47,648	2030/10/30
WELLS FARGO & COMPAN FRN	5.013	1,120	896	133,278	2051/4/4
WELLS FARGO & COMPANY	4.3	340	317	47,176	2027/7/22
WELLS FARGO & COMPANY	3.9	20	14	2,080	2045/5/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.05	980	846	125,817	2030/2/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	5.25	240	179	26,695	2050/2/1
WYNN MACAU LTD	5.625	200	168	25,074	2028/8/26
小 計				16,107,204	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVT	1.25	740	614	67,239	2030/6/1
CANADIAN GOVT	5.75	1,680	1,886	206,528	2033/6/1
地方債証券					
ONTARIO (PROVINCE OF)	3.45	590	466	51,047	2045/6/2
PROVINCE OF QUEBEC	3.5	620	493	54,008	2045/12/1
小 計				378,824	
(メキシコ) 国債証券		千メキシカンペソ	千メキシカンペソ		
MEXICAN BONOS DESARR FIX	7.75	72,820	59,660	486,874	2042/11/13
(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BUNDES REPUBLIC DE	0.5	600	568	89,267	2026/2/15
BUNDES REPUBLIC DE	2.1	690	668	105,125	2029/11/15
BUNDES REPUBLIC DE	—	300	247	38,943	2031/2/15
BUNDES REPUBLIC DE	1.7	3,180	2,931	460,786	2032/8/15
普通社債券 (含む投資法人債券)					
MUNICH RE FRN	3.25	500	452	71,059	2049/5/26
VOLKSWAGEN FIN SERV	1.5	540	526	82,756	2024/10/1
(イタリア) 国債証券					
BUONI POLIENNALI	3.25	1,750	1,308	205,702	2046/9/1
普通社債券 (含む投資法人債券)					
INTESA SANPAOLO SPA	1.0	560	547	85,981	2024/7/4
UNICREDIT SPA FRN	4.875	900	894	140,601	2029/2/20
(フランス) 国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	—	1,300	1,041	163,645	2030/11/25
FRANCE O. A. T.	1.5	370	226	35,642	2050/5/25
FRANCE O. A. T.	4.0	280	285	44,852	2060/4/25
普通社債券 (含む投資法人債券)					
BNP PARIBAS FRN	0.5	300	260	40,905	2028/5/30
CREDIT AGRICOLE FRN	1.875	1,600	1,497	235,406	2027/4/22

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(オランダ) 普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABN AMRO BANK NV	1.0	310	296	46,657	2025/4/16
ABN AMRO BANK NV	4.5	300	291	45,749	2034/11/21
ING GROEP NV FRN	2.5	600	592	93,104	2029/2/15
VOLKSWAGEN FIN SERV	3.75	300	292	45,929	2027/9/28
(スペイン) 国債証券					
SPAIN GOVT	5.15	590	648	101,861	2044/10/31
SPANISH GOVT 2.7 10/31/4	2.7	710	521	81,958	2048/10/31
普通社債券 (含む投資法人債券)					
BANCO SANTANDER SA FRN	5.75	300	296	46,529	2033/8/23
CELLEX FINANCE CO SA	2.0	800	618	97,228	2032/9/15
(ベルギー) 国債証券					
BELGIUM GOVT	3.75	760	741	116,536	2045/6/22
(ルクセンブルク) 普通社債券 (含む投資法人債券)					
HOLCIM FINANCE LUX SA	1.75	530	461	72,563	2029/8/29
(その他) 国債証券					
UNITED MEXICAN STATES	2.875	590	413	64,956	2039/4/8
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABBVIE INC	1.5	100	99	15,673	2023/11/15
ANGLO AMERICAN CAPITAL	1.625	600	573	90,183	2025/9/18
BANK OF AMERICA CORP FRN	1.776	660	618	97,223	2027/5/4
CREDIT SUISSE GROUP FRN	3.25	460	449	70,596	2026/4/2
CREDIT SUISSE GROUP FRN	2.125	1,200	1,139	179,063	2026/10/13
CREDIT SUISSE GROUP FRN	1.0	140	126	19,814	2027/6/24
DANSKE BANK A/S FRN	1.375	950	897	141,029	2030/2/12
GENERAL ELECTRIC CO	4.125	610	596	93,717	2035/9/19
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.019	320	307	48,258	2027/6/15
LOTUS BANKING GROUP FRN	3.5	1,180	1,161	182,591	2026/4/1
MCDONALD'S CORP	1.875	1,100	1,028	161,630	2027/5/26
MORGAN STANLEY FRN	4.656	350	349	54,970	2029/3/2
NETFLIX INC	3.625	700	663	104,307	2030/6/15
STANDARD CHARTERED P FRN	2.5	1,280	1,206	189,657	2030/9/9
TORONTO-DOMINION BANK	2.551	1,020	955	150,186	2027/8/3
ユーロ計				4,212,656	
(イギリス) 国債証券		千ポンド	千ポンド		
UK TREASURY	4.5	70	69	12,677	2034/9/7
UK TREASURY	4.75	1,040	1,037	188,806	2038/12/7
UK TREASURY	3.25	860	672	122,381	2044/1/22
UK TREASURY	2.5	280	163	29,813	2065/7/22
UK TREASURY INFL	0.125	570	508	92,521	2068/3/22
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AVIVA PLC FRN	6.125	20	19	3,607	2036/11/14
BNP PARIBAS FRN	2.0	700	607	110,583	2031/5/24

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ENEL FINANCE INTL NV	2.875	370	317	57,713	2029/4/11
NATWEST GROUP PLC FRN	2.105	200	169	30,903	2031/11/28
ROYAL BANK OF CANADA	3.625	710	658	119,786	2027/6/14
小 計				768,795	
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ		
POLAND GOVT	1.75	11,590	8,416	289,741	2032/4/25
(オーストラリア) 国債証券		千オーストラリア ドル	千オーストラリア ドル		
AUSTRALIAN GOVT	1.75	1,440	765	73,081	2051/6/21
(インドネシア) 国債証券		千インドネシア ルピア	千インドネシア ルピア		
INDONESIA GOVERNMENT	8.375	21,485,000	23,691,457	222,699	2039/4/15
(中国) 国債証券		千元	千元		
CHINA GOVERNMENT BOND	3.38	1,000	1,018	20,753	2026/7/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.85	1,000	1,035	21,090	2026/12/12
CHINA GOVERNMENT BOND	4.29	4,500	4,828	98,362	2029/5/22
CHINA GOVERNMENT BOND	3.6	1,000	1,043	21,250	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	2.82	10,000	9,925	202,182	2032/8/12
CHINA GOVERNMENT BOND	4.0	13,500	14,493	295,226	2035/11/30
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.4	14,000	14,076	286,735	2024/11/6
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.8	11,390	11,830	240,980	2030/10/27
CHINA DEVELOPMENT BANK	4.2	8,000	8,324	169,561	2027/1/19
CHINA DEVELOPMENT BANK	4.3	8,000	8,611	175,415	2032/8/2
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.4	6,000	6,050	123,257	2024/5/14
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.15	3,000	3,123	63,617	2027/6/18
小 計				1,718,435	
(南アフリカ) 国債証券		千ランド	千ランド		
SOUTH AFRICA GOVT	6.5	59,597	33,642	258,714	2041/2/28
合 計				24,517,027	

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

< 売付債券 >

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
FMMA 30YR NOV FWD	5.5	300	288	42,842	2051/11/1
FMMA 30YR NOV FWD	5.0	300	281	41,829	2051/11/1
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	500	472	70,157	2051/10/1
GMA II 30YR OCT FWD	3.0	600	506	75,308	2051/10/1
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	151	22,544	2051/11/1
合 計				252,682	

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

<外国投資信託証券>

銘柄	第 4 期 末		第 5 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千ドル		
LMQI-LMWA INDIA BOND-LM USD	—	1,833	247	36,834	
WA CHINA BOND FUND L. L. C.	547,626	438,377	4,656	692,012	
合 計	口 数 ・ 金 額	547,626	440,211	4,904	728,847
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 2.9% >

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	第 5 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外		
CA 10YR 0312	149	—
US 5YR 0312	4,702	—
UK 10YR 0312	1,121	—
BTP10YR 1312	171	—
OAT10YR 1312	503	—
EB 5YR 0312	1,682	—
EB 10YR 0312	1,726	—
US 2YR 0312	5,100	—
US 10YR 0312	—	3,221
EB 30YR 2312	—	19
US 20YR 0312	366	—
USUL10YR2312	—	1,186
国		
AU 10YR 0312	138	—
3M SOFR 2412	4,011	—

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

<オプションの銘柄別期末残高>

銘 柄 別	コールプット別	第 5 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	債券		
	RXX3 C 1027	0.961819	—
	RXX3 P 1027	—	10

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

<スワップ及び先渡取引残高>

種 類	第 5 期 末	
	取 引 契 約 残 高 (想 定 元 本 額)	
直物為替先渡取引		百万円 2,184

組入投資信託証券の内容

■フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

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

●損益の状況

項 目	第 2 期 自 2022年5月3日 至 2023年5月1日
(A)有価証券売買損益	627,210,515円
売 買 益	716,375,426
売 買 損	△89,164,911
(B)信託報酬等	△76,709,350
(C)当期損益金(A+B)	550,501,165
(D)前期繰越損益金	127,275,046
(E)追加信託差損益金	259,707,930
(配当等相当額)	(106,005,454)
(売買損益相当額)	(153,702,476)
(F)合 計(C+D+E)	937,484,141
次期繰越損益金(F)	937,484,141
追加信託差損益金	259,707,930
(配当等相当額)	(121,502,204)
(売買損益相当額)	(138,205,726)
分配準備積立金	677,776,211

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末		第 2 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
フィデリティ・外国債券・マザーファンド	千口 5,647,663	千口 5,180,256	千円 15,106,146	千円 15,106,146

下記は、フィデリティ・外国債券・マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	第 2 期 末		評 価 額		
	利 率 (%)	額面金額	外 貨 建 金 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル		
国債証券					
SAUDI ARABIA 4.875% 7/33 BGS	4.8750	1,600	1,644	225,089	2033/07/18
USTN 4.5% 11/30/24	4.5000	13,050	13,081	1,790,012	2024/11/30
USTN 4.5% 11/15/25	4.5000	9,760	9,907	1,355,738	2025/11/15
USTN 4% 02/29/28	4.0000	68,750	70,264	9,615,002	2028/02/29
USTN 4% 02/28/30	4.0000	31,260	32,222	4,409,283	2030/02/28
USTN 4.125% 11/15/32	4.1250	27,890	29,436	4,028,128	2032/11/15
USTN 3.5% 02/15/33	3.5000	7,050	7,091	970,442	2033/02/15
USTB 3.375% 08/15/42	3.3750	5,660	5,330	729,367	2042/08/15
USTB 3.875% 02/15/43	3.8750	2,600	2,627	359,562	2043/02/15
USTB 1.875% 11/15/51	1.8750	8,000	5,450	745,854	2051/11/15
USTB 3% 08/15/52	3.0000	3,480	3,056	418,311	2052/08/15
USTB 4% 11/15/52	4.0000	10,495	11,142	1,524,759	2052/11/15
USTB 3.625% 02/15/53	3.6250	3,425	3,396	464,721	2053/02/15
特殊債券					
UMS 15YR 2.5% 05/01/2038 #7BA	2.5000	9,725	9,032	1,236,044	2038/05/01
UMS 30YR 2.5% 05/01/2053 #7BA	2.5000	9,175	7,941	1,086,691	2053/05/01
UMS 30YR 3% 05/01/2053 #7BA	3.0000	10,425	9,368	1,281,946	2053/05/01
GNI II 3.5% 05/01/2053 #7BA	3.5000	3,850	3,613	494,523	2053/05/01
GNI II 2.5% 05/01/2053 #7BA	2.5000	3,450	3,053	417,806	2053/05/01
UMS 30YR 2% 05/01/2053 #7BA	2.0000	5,550	4,613	631,257	2053/05/01
GNI II 3% 05/01/2053 #7BA	3.0000	15,250	13,929	1,906,133	2053/05/01
社債券					
BPCE 4.625% 07/11/24 BGS	4.6250	450	439	60,084	2024/07/11
HCA INC 5.375% 02/01/25	5.3750	2,500	2,499	342,065	2025/02/01
NESTERA ENR CA 6.051% 03/01/25	6.0510	1,740	1,768	242,058	2025/03/01
AIB GR 4.263%VAR 4/10/25 144A	4.2630	4,125	4,049	554,129	2025/04/10
JPMORGAN CHASE 0.824%VAR 6/25	0.8240	2,350	2,232	305,521	2025/06/01
GE HEALTH 5.6% 11/15/25 144A	5.6000	1,500	1,519	207,901	2025/11/15
SOGEN 2.226%VAR 01/21/26 144A	2.2260	2,535	2,363	323,411	2026/01/21
SOGEN SOFR+105 01/21/26 BGS	5.8785	1,000	974	133,364	2026/01/21
HCA INC 5.875% 02/15/26	5.8750	675	685	93,804	2026/02/15
MSTW SOFR+95 02/18/26	5.5242	1,000	993	135,920	2026/02/18
DEERE&P FIN 5.145%VAR 03/03/26	5.1200	3,150	3,140	429,731	2026/03/03
KENUE INC 5.35% 03/22/26 144A	5.3500	800	821	112,387	2026/03/22
HYUNDAI CAP AMR 5.5% 3/26 REGS	5.5000	500	501	68,624	2026/03/30
LENAR CORP 5.25% 06/01/2026	5.2500	100	100	13,720	2026/06/01
AIR LEASE CORP 1.875% 08/15/26	1.8750	2,868	2,548	348,749	2026/08/15
AERCAP IRELAND 2.45% 10/29/26	2.4500	4,050	3,631	496,919	2026/10/29
AIB T.583%VAR 10/14/26 144A	7.5830	1,175	1,212	165,891	2026/10/14
ROYALBK SFR1X+59 11/02/26	5.0221	1,000	978	133,896	2026/11/02
BDA CORP 3.559%VAR 4/23/27	3.5590	575	548	75,039	2027/04/23
ENERGY TRAN LP 4.2% 04/15/27	4.2000	1,275	1,231	168,566	2027/04/15
BANK IRE 2.029%VAR 9/27/144A	2.0290	1,475	1,287	176,185	2027/09/30
ENEL FIN AM 7.1% 10/14/27 144A	7.1000	1,506	1,615	221,046	2027/10/14
DBSF SOFR+121.9 11/16/27	5.7935	2,050	1,843	252,245	2027/11/16
DEUTSCHE B 2.311%VAR 11/16/27	2.3110	2,185	1,891	258,792	2027/11/16
GE HEALTHCARE 5.65% 11/27/144A	5.6500	1,150	1,187	162,505	2027/11/15

銘柄	第 2 期 末		評 価 額		
	利 率 (%)	額面金額	外 貨 建 金 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AIR LEASE CORP 5.85% 12/15/27	5.8500	950	961	131,544	2027/12/15
SOCIETE GE 2.797%/VAR 1/19/28 144A	2.7970	2,130	1,903	260,483	2028/01/19
NATIONWIDE B FIN 2/16/28 144A	5.8645	4,925	4,737	648,313	2028/02/16
JPMORGAN FIN SOFR+118 2/24/28	5.7551	2,650	2,640	361,320	2028/02/24
ENERGY TRAN LP 5.55% 02/15/28	5.5500	696	709	97,105	2028/02/15
AMGEN INC 5.15% 03/02/28	5.1500	1,541	1,577	215,828	2028/03/02
KENUE INC 5.05% 03/22/28 144A	5.0500	1,179	1,221	167,090	2028/03/22
HYUNDAI CAP AMR 5.6% 3/28 REGS	5.6000	848	855	117,016	2028/03/30
BDA CORP 6.204%VAR 11/10/28	6.2040	1,095	1,141	156,233	2028/11/10
US BANCORP DEL 4.653%VAR 2/29	4.6530	1,781	1,733	237,146	2029/02/01
HCA INC 3.375% 03/15/29 144A	3.3750	775	707	96,823	2029/03/15
HSBC HOLDINGS 6.161%VAR 3/29	6.1610	868	892	122,156	2029/03/09
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	5.1250	900	892	122,096	2029/05/15
NESTERA ENR CA 2.25% 06/01/30	2.2500	500	424	58,076	2030/06/01
DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30	8.1250	402	455	62,348	2030/08/16
MSCI INC 3.625% 09/01/30 144A	3.6250	2,530	2,182	298,660	2030/09/01
AIR LEASE CORP 3.125% 12/01/30	3.1250	350	298	40,802	2030/12/01
COMB BK AUS 2.688% 3/31 144A	2.6880	2,944	2,342	320,597	2031/03/11
MSCI INC 3.625% 11/01/31 144A	3.6250	554	470	64,448	2031/11/01
AERCAP IRELAND 3.3% 01/30/32	3.3000	1,800	1,474	201,746	2032/01/30
BDA CORP 2.651%VAR 03/11/32	2.6510	790	658	90,094	2032/03/11
HCA INC 3.625% 03/15/32 144A	3.6250	580	513	70,308	2032/03/15
BRADCOM 4.15% 4/15/32 144A	4.1500	779	711	97,371	2032/04/15
WELLTOWER INC 3.85% 06/15/32	3.8500	1,012	909	124,464	2032/06/15
ENEL FI INT 7.5% 10/14/32 144A	7.5000	1,113	1,245	170,408	2032/10/14
ANZ BRG GRP 6.742% 12/08/32 BE	6.7420	1,162	1,219	166,813	2032/12/08
ANZ BRG GRP 6.742% 12/32 144A	6.7420	1,305	1,368	187,315	2032/12/08
SOGEN 3.337%VAR 1/21/33 144A	3.3370	2,150	1,758	240,607	2033/01/21
ORACLE CORP 4.9% 02/06/33	4.9000	1,071	1,055	144,388	2033/02/06
RP CAP MARKETS 4.812% 02/13/33	4.8120	1,067	1,085	148,537	2033/02/13
FISERV INC 5.6% 03/02/33	5.6000	782	815	111,584	2033/03/02
MET LIFE GRL 5.15% 3/33 144A	5.1500	235	238	32,649	2033/03/01
ASSTHD CAP 5.55% 5/30/33 144A	5.5500	1,164	1,155	158,063	2033/05/30
HSBC HLD PLC SFR1X+ 08/11/33	5.4020	1,249	1,237	169,402	2033/08/11
HSBC HLDGS 8.111%VAR 11/3/33	8.1130	1,068	1,205	164,926	2033/11/03
BARCLAYS PLC 7.437%VAR 11/33	7.4370	2,500	2,753	376,747	2033/11/02
DEUTSCHE BA 7.079%VAR 2/10/34	7.0790	720	673	92,173	2034/02/10
REPUBLIC SVCS 5% 04/01/34	5.0000	610	624	85,392	2034/04/01
BARCLAYS PLC 3.564%VAR 09/23/35	3.5640	725	578	79,208	2035/09/23
WESTPAC B 2.668%VAR 11/15/35	2.6680	1,350	1,059	144,951	2035/11/15
ANZ B 2.57%VAR 11/25/35 144A	2.5700	1,116	871	119,293	2035/11/25
BROADCOM 3.187% 11/15/36 BGS	3.1870	450	341	46,664	2036/11/15
BROADCOM 3.187% 11/15/36 144A	3.1870	700	532	72,894	2036/11/15
ARN A 3.324%VAR 03/13/37 144A	3.3240	800	621	85,012	2037/03/13
GS GRP INC MTN 6.25% 2/01/41	6.2500	150	165	22,657	2041/02/01
AERCAP LTD/TR 3.85% 10/29/41	3.8500	1,000	751	102,773	2041/10/29
HCA INC 4.375% 03/15/42 144A	4.3750	170	142	19,520	2042/03/15
MAGALLANES 5.05% 03/15/42 144A	5.0500	973	804	110,124	2042/03/15
BARCLAYS PLC 3.33% 11/24/42	3.3300	1,184	857	117,371	2042/11/24

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
HSBC HOLDING 6.332%/VAR 3/9/14	6.3320	868	914	125,104	2044/03/09
ENERGY TRANSFER 6% 04/15/18	6.0000	800	763	104,543	2048/06/15
ENERGY TRAN OP 6.25% 04/15/19	6.2500	425	421	57,691	2049/04/15
WILLIS TOWERS WATSON 3.875% 9/15/19	3.8750	4,300	3,139	429,634	2049/09/15
AVON CORP / AON 3.9% 02/28/32	3.9000	946	761	104,232	2052/02/28
ENEL FIN 7.75% 10/14/32 144A	7.7500	654	764	104,623	2052/10/14
MARSHMCLN 6.25% 11/01/32	6.2500	501	574	78,601	2052/11/01
SOGEN 7.367% 01/10/33 144A	7.3670	1,400	1,372	187,870	2053/01/10
ORACLE CORP 5.55% 02/06/33	5.5500	962	924	126,470	2053/02/06
MARSHMCLN 5.45% 03/15/33	5.4500	504	524	71,819	2053/03/15
COO LLC/CAPITL 6.83% 10/23/35	6.8340	1,382	1,311	179,452	2055/10/23
AMEREN ENERGY INC 5.8% 02/15/35	5.8000	1,565	1,512	239,851	2059/01/23
MAGALLANE 5.391% 03/15/32 144A	5.3910	960	770	105,475	2062/03/15
UNITEDHEALTH GR 6.0% 02/15/33	6.0500	700	804	110,148	2063/02/15
UNITEDHEALTH GR 5.2% 04/15/33	5.2000	875	892	122,097	2063/04/15
小計	-	366,414	355,542	48,652,426	-
(カナダ)		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
国債証券					
CANADA GOVT .25% 04/01/24	0.2500	6,455	6,222	627,928	2024/04/01
CANADA GOVT 2.25% 6/1/25	2.2500	3,420	3,329	336,058	2025/06/01
CANADA GOVT .5% 12/01/30	0.5000	11,800	9,919	1,001,081	2030/12/01
CANADA GOVT 1.5% 12/01/31	1.5000	4,800	4,307	434,743	2031/12/01
CANADA GOVT 2% 12/01/31	2.0000	2,150	1,757	177,344	2031/12/01
小計	-	28,625	25,536	2,577,156	-
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
国債証券					
AUSTRALIA GOVT 1.25% 05/21/32	1.2500	6,700	5,615	508,392	2032/05/21
AUSTRALIA GOVT 3.75% 5/34 BGS	3.7500	2,145	2,212	200,338	2034/05/21
AUSTRALIA GOVT 3% 3/21/47 BGS	3.0000	2,300	1,991	180,276	2047/03/21
AUSTRALIA GOVT 1.75% 06/31 BGS	1.7500	4,587	2,931	265,389	2051/06/21
社債券					
BARCLAYS 2.064%/VAR 5/27 BGS	2.0640	1,750	1,554	140,710	2027/05/20
BARCLAY 3.382%/VAR 5/20/32 BGS	3.3820	1,250	956	86,573	2032/05/20
小計	-	18,732	15,262	1,381,681	-
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
国債証券					
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/24	0.5000	11,000	10,485	885,894	2024/05/15
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/26	0.5000	8,750	7,830	661,566	2026/05/15
NEW ZEALAND GOV .25% 05/15/28	0.2500	6,450	5,344	451,543	2028/05/15
小計	-	26,200	23,659	1,999,004	-
(イギリス)		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
国債証券					
UK GILT 1.25% 07/22/27 BGS	1.2500	8,530	7,731	1,328,354	2027/07/22
UK GILT .875% 07/31/33 BGS	0.8750	15,350	11,628	1,998,043	2033/07/31
UK GILT .625% 10/22/30 REGS	0.6250	2,700	1,181	202,925	2050/10/22
UK GILT 1.25% 07/31/31 BGS	1.2500	1,425	757	130,193	2051/07/31
UK GILT 1.75% 07/22/37 BGS	1.7500	4,325	2,534	435,521	2057/07/22
社債券					
HSBC HLD PL 1.75%/VAR 07/24/27	1.7500	1,628	1,431	245,960	2027/07/24
DIRECT LINE IN 4% 06/05/32 BGS	4.0000	3,200	2,448	420,708	2032/06/05
MORGAN 5.789%/VAR 11/18/33	5.7890	1,300	1,321	227,140	2033/11/18

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
HSBC HLD 8.201%/VAR 11/34 BGS	8.2010	1,176	1,248	214,573	2034/11/16
小計	-	39,634	30,284	5,203,420	-
(ノルウェー)		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券					
NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2	2.0000	18,275	17,311	221,763	2028/04/26
小計	-	18,275	17,311	221,763	-
(スウェーデン)		千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券					
SWEDEN GOVT 1.375% 06/23/71 BE	1.3750	7,415	4,604	61,334	2071/06/23
小計	-	7,415	4,604	61,334	-
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券					
MEXICO UNITED 5.75% 03/05/26	5.7500	86,850	78,602	597,891	2026/03/05
MEXICO GOVT 7.75% 5/29/31	7.7500	72,800	68,426	520,489	2031/05/29
小計	-	159,650	147,029	1,118,380	-
(インドネシア)		千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア		
国債証券					
INDONESIA GOVT 7% 5/15/27	7.0000	28,776,000	29,512,090	277,413	2027/05/15
小計	-	28,776,000	29,512,090	277,413	-
(チェコ)		千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
国債証券					
CZECH REPUBLIC .25% 02/10/27	0.2500	55,280	46,446	297,488	2027/02/10
小計	-	55,280	46,446	297,488	-
(韓国)		千韓国・ウォン	千韓国・ウォン		
国債証券					
KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10	2.6250	2,320,200	2,243,540	229,065	2028/06/10
KOREA GOVT 1.5% 12/10/30	1.5000	15,016,960	13,140,590	1,341,654	2030/12/10
小計	-	17,337,160	15,384,131	1,570,719	-
(中国)		千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
国債証券					
CHINA GOVT 1.99% 04/09/25	1.9900	52,170	51,747	1,019,543	2025/04/09
CHINA GOVT 3.27% 11/19/30	3.2700	33,000	34,300	675,792	2030/11/19
CHINA GOVT 3.02% 05/27/31	3.0200	30,000	30,507	601,058	2031/05/27
CHINA GOVT 2.89% 11/18/31	2.8900	56,640	56,963	1,122,310	2031/11/18
CHINA GOVT 2.8% 11/15/32	2.8000	170,000	169,578	3,341,084	2032/11/15
小計	-	341,810	343,096	6,759,788	-
(ポーランド)		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
国債証券					
POLAND GOVT .25% 10/25/26	0.2500	6,675	5,512	180,864	2026/10/25
POLAND GOVT 1.25% 10/25/30	1.2500	7,450	5,406	177,408	2030/10/25
小計	-	14,125	10,918	358,273	-
(アイルランド)		千ユーロ	千ユーロ		
社債券					
AIB GROUP 2.25%/VAR 04/28 BGS	2.2500	1,097	1,001	150,761	2028/04/04
PTSB HEADOFFICE 4/25/28 BGS	6.6250	1,729	1,751	263,640	2028/04/25
AIB GROUP PLC 4.625% 07/23/29 BGS	4.6250	725	716	107,929	2029/07/23
AIB GR 2.875%/VAR 05/30/31 BGS	2.8750	765	694	104,522	2031/05/30
BANKER 1.375%/VAR 08/11/31 BGS	1.3750	1,818	1,569	236,244	2031/08/11

第 2 期 末	銘 柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(オランダ)						
社債券						
	ING GROEP 4.875/VAR 11/27 RGS	4.8750	900	920	138,595	2027/11/14
	ABN AMRO BANK 4.25% 02/21/30 R	4.2500	1,500	1,498	225,608	2030/02/21
	DIGITAL DUT 1.25% 02/01/31 RGS	1.2500	2,450	1,836	276,532	2031/02/01
	PROSUS NV 1.985% 07/13/33 RGS	1.9850	1,475	1,015	152,944	2033/07/13
	ING GROEP 5.25%VAR 11/33 RGS	5.2500	1,400	1,475	222,164	2033/11/14
	ABN AMRO BK 4.5% 11/21/34 RGS	4.5000	900	902	135,833	2034/11/21
	NN GROUP 6%/VAR 11/03/43 RGS	6.0000	791	791	119,173	2043/11/03
	ASR NEDERLA 7%/VAR 12/7/43 RGS	7.0000	971	1,016	153,081	2043/12/07
	VOLKSWA 4.375%/VAR PERP RGS	4.3750	1,900	1,564	235,609	2049/12/31
	VWIF 3.748%/VAR PERP RGS	3.7480	900	778	117,203	2049/12/31
	RABOBANK NEDERLAND 4.875% PERP RGS	4.8750	1,200	1,014	152,762	2049/12/31
(フランス)						
特殊債券						
	EDF 4.25% 01/25/32 RGS	4.2500	1,100	1,088	163,809	2032/01/25
	EDF 4.625% 01/25/43 RGS	4.6250	1,100	1,038	156,301	2043/01/25
社債券						
	BNPSA 0.875%/VAR 07/11/30 RGS	0.8750	2,400	1,953	294,103	2030/07/11
	BPCE 1% 01/14/32 RGS	1.0000	2,900	2,247	338,352	2032/01/14
	BPCE 4.5% 01/13/33 RGS	4.5000	1,400	1,405	211,526	2033/01/13
	BFCM PARIS 5.125% 01/13/33 RGS	5.1250	1,700	1,672	251,822	2033/01/13
	CREDIT AGR 3.875% 11/28/34 RGS	3.8750	1,500	1,491	224,546	2034/11/28
	BPCE SA 3.125%/VAR 1/25/35 RGS	5.1250	700	679	102,267	2035/01/25
	TOTALENERG 3.25%/VAR PERP RGS	3.2500	3,317	2,430	365,871	2049/12/31
	ORANGE EISAS+ PERP RGS	5.3750	700	695	104,722	2049/12/31
(ドイツ)						
国債証券						
	GERMANY GOVT 0% 12/15/23 RGS	0.0000	5,960	5,853	881,306	2023/12/15
	GERMANY GOVT 1.3% 10/15/27 RGS	1.3000	7,560	7,234	1,089,092	2027/10/15
	GERMANY GOVT 0% 02/15/32 RGS	0.0000	27,440	22,547	3,394,600	2032/02/15
	GERMANY GOVT 1.7% 08/15/32 RGS	1.7000	13,860	13,194	1,986,367	2032/08/15
	GERMANY GOVT 3.25% 7/04/42	3.2500	2,330	2,601	391,707	2042/07/04
	GERMANY GOVT 0% 08/15/32 RGS	0.0000	6,576	3,334	501,948	2052/08/15
社債券						
	RWEAG 4.125% 02/13/35 RGS	4.1250	511	501	75,536	2035/02/13
	BAYER AG 5.375%/VAR 3/82 RGS	5.3750	700	639	96,338	2082/03/25
(スペイン)						
新株予約権付社債						
	CELLNEX GOV .75% 11/20/31 RGS	0.7500	300	239	36,053	2031/11/20
社債券						
	BANCO 5.125%/VAR 11/10/28 RGS	5.1250	1,100	1,113	167,701	2028/11/10
	CELLNEX FINANCE 1.25% 01/15/29	1.2500	900	755	113,742	2029/01/15
	BANCO DE SABADE 5.25% 02/07/29 REP	5.2500	1,900	1,826	274,977	2029/02/07
	CELLNEX FINANCE 2% 02/15/33 RE	2.0000	1,300	1,022	153,910	2033/02/15
	CAIXABANK SA VAR 02/23/33 RGS	6.2500	800	814	122,558	2033/02/23
(イタリア)						
社債券						
	TERNA 2.375%/VAR PERP RGS	2.3750	1,105	921	138,700	2049/12/31
(その他)						
国債証券						
	POLAND GOVT 4.25% 02/14/43 RGS	4.2500	1,525	1,472	221,674	2043/02/14

第 2 期 末	銘 柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
特殊債券						
	EUROPEAN UNION 2.5% 10/04/32 R	2.5000	2,552	2,134	321,305	2052/10/04
	EUROPEAN UNION 3% 03/04/33 RGS	3.0000	970	896	135,000	2053/03/04
社債券						
	MITSUB 3.275%/VAR 09/19/25 RGS	3.2730	1,153	1,135	170,968	2025/09/19
	CREDIT SUISSE 2.125% 10/13/26 RGS	2.1250	1,854	1,696	255,352	2026/10/13
	TORONTO 2.551% 8/03/27 RGS	2.5510	1,237	1,166	175,650	2027/08/03
	MSTOW 0.406%/VAR 10/29/27	0.4060	850	744	112,072	2027/10/29
	HSBC BUL 4.752%/VAR 3/10/28 RGS	4.7520	2,177	2,209	332,624	2028/03/10
	UBS GROUP AG 4.625% 03/17/28 REGS	4.6250	1,186	1,183	178,175	2028/03/17
	MSTOW 4.656%/VAR 3/2/29	4.6560	1,179	1,199	180,611	2029/03/02
	WESTPAC BANK 3.799% 01/30 RGS	3.7990	2,450	2,433	366,361	2030/01/17
	BIA CO 0.694%/VAR 03/22/31 RGS	0.6940	640	506	76,245	2031/03/22
	HSBC 4.7870/VAR 03/10/32 RGS	4.7870	1,672	1,697	255,520	2032/03/10
	UBS GROUP 4.75%/VAR 3/32 RGS	4.7500	993	989	148,963	2032/03/17
	MSTOW 2.95%/VAR 05/07/32	2.9500	1,772	1,604	241,495	2032/05/07
	SBERBANK 3.625%/VAR 08/32 RGS	3.6250	667	619	93,315	2032/08/23
	HSBC HOLD 6.364%/VAR 11/32 RGS	6.3640	1,702	1,745	262,721	2032/11/16
	ANZ BKG GR 5.101%/VAR 2/33 RGS	5.1010	2,777	2,738	412,266	2033/02/03
	TEMASEK FIN 3.5% 02/15/33 RGS	3.5000	1,707	1,706	256,932	2033/02/15
	BIA CORP 2.824/VAR 4/27/33 RGS	2.8240	765	674	101,615	2033/04/27
	BARCLAYSPLC VAR 01/29/34	5.2620	1,020	1,025	154,387	2034/01/29
	HONEYWELL INTL 4.125% 11/02/34	4.1250	1,202	1,226	184,661	2034/11/02
	合 計	-	141,731	126,658	19,068,395	-
	注	-	-	-	89,547,247	-

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

第 2 期 末	銘 柄 別	買 建 額 売 建 額	
		(百万円)	(百万円)
外国	LONG GILT FUT	400	-
	EURO BOBL FUT	-	195

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

<スワップ及び先渡取引残高>

第 2 期 末	種 類	取 引 契 約 残 高	
		(想 定 元 本 額)	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
	直物為替先渡取引(NDF)	736	156

組入投資信託証券の内容

■PIMCO Global Bond Strategy Fund S (JPY) Class

●ファンドの概要

投資顧問会社	Pacific Investment Management Company LLC
主な投資対象・投資地域	日本を除く世界の債券等
運用の基本方針	主として日本を除く世界の債券等に投資し、トータル・リターンを最大化を目指して運用を行います。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「PIMCO BERMUDA TRUST IV Annual Report June 30, 2023」の情報を基に掲載しています。

PIMCO Global Bond Strategy Fund

● 損益の状況 (2023年6月30日までの会計期間)

(Amounts in thousands)	PIMCO Global Bond Strategy Fund	PIMCO Global High Yield Strategy Fund	PIMCO U.S. High Yield Strategy Fund A	PIMCO U.S. High Yield Strategy Fund B
Investment Income:				
Interest	\$ 3,406	\$ 2,916	\$ 15	\$ 227
Miscellaneous income	116	49	24	350
Total Income	3,522	2,965	39	577
Expenses:				
Advisory fees - S (JPY)	362	N/A	N/A	N/A
Management fees - C (JPY Hedged)	57	N/A	N/A	N/A
Interest expense	35	6	2	19
Total Expenses	454	6	2	19
Net Investment Income (Expense)	3,068	2,959	37	558
Net Realized Gain (Loss):				
Investments in securities	(13,274)	(2,603)	(1)	(2)
Investments in Affiliates	0	0	213	1,149
Exchange-traded or centrally cleared financial derivative instruments	(2,794)	179	0	0
Over the counter financial derivative instruments	2,723	(102)	(1,796)	4,747
Foreign currency	(306)	36	9	15
Net Realized Gain (Loss)	(13,651)	(2,490)	(1,575)	5,909
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation):				
Investments in securities	5,077	4,936	1	3
Investments in Affiliates	0	0	856	3,368
Exchange-traded or centrally cleared financial derivative instruments	1,142	(204)	0	0
Over the counter financial derivative instruments	(309)	351	456	4,378
Foreign currency assets and liabilities	133	13	0	0
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation)	6,043	5,096	1,313	7,749
Net Gain (Loss)	(7,608)	2,606	(262)	13,658
Net Increase (Decrease) in Net Assets Resulting from Operations	\$ (4,540)	\$ 5,565	\$ (225)	\$ 14,216

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

●投資明細表(2023年6月30日現在)

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)		元本 (単位：千)	時価 (単位：千)		元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 128.9%								
AUSTRALIA 2.7%								
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%								
Santos Finance Ltd.								
3.649% due 04/29/2031	\$	100	\$		83			
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 1.3%								
AFG Trust								
4.810% due 03/10/2053	AUD	373			247			
Bluestone Sapphire XXV								
5.145% due 09/21/2053		184			122			
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4								
4.910% due 02/19/2053		419			275			
La Trobe Financial Capital Markets Trust								
4.873% due 01/14/2053		307			203			
Liberty PRIME								
4.815% due 01/25/2053		354			234			
Pepper I-Prime Trust								
4.770% due 07/15/2053		188			124			
Pepper Residential Securities Trust No.30								
4.870% due 01/15/2053		241			159			
RedZed Trust								
4.858% due 06/09/2053		165			110			
Resimac Premier								
4.740% due 02/13/2053		403			265			
Securitized Australian Mortgage Trust								
4.894% due 02/20/2046		45			30			
					1,769			
SOVEREIGN ISSUES 1.3%								
Australia Government Bond								
3.250% due 04/21/2029		2,600			1,667			
South Australian Government Financing Authority								
1.750% due 05/24/2032		100			53			
Treasury Corp. of Victoria								
4.250% due 12/20/2032		100			65			
					1,785			
Total Australia					3,637			
(Cost \$4,276)								
BERMUDA 0.1%								
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%								
Bacardi Ltd.								
4.700% due 05/15/2028	\$	100			97			
Total Bermuda					97			
(Cost \$98)								
CANADA 0.5%								
SOVEREIGN ISSUES 0.5%								
Canada Government Bond								
1.750% due 12/01/2053	CAD	100			56			
Province of Ontario								
7.500% due 02/07/2024		800			613			
Total Canada					669			
(Cost \$720)								
CAYMAN ISLANDS 2.5%								
ASSET-BACKED SECURITIES 2.1%								
Ammc CLO 20 Ltd.								
6.130% due 04/17/2029	\$	49			49			
Anchorage Capital CLO 9 Ltd.								
6.400% due 07/15/2032	\$	500	\$		493			
Ares XXXIX CLO Ltd.								
6.312% due 04/18/2031		500			495			
HERA Commercial Mortgage Ltd.								
6.207% due 02/18/2038		173			167			
LoanCore Issuer Ltd.								
6.616% due 01/17/2037		500			492			
Mountain View CLO LLC								
6.300% due 01/16/2031		495			489			
Nassau Ltd.								
6.410% due 10/15/2029		103			102			
Vibrant CLO IV Ltd.								
6.370% due 07/20/2032		500			491			
					2,778			
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%								
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.								
4.600% due 03/27/2024 (a)		200			198			
Tencent Holdings Ltd.								
2.390% due 06/03/2030		200			166			
3.975% due 04/11/2029		200			186			
					550			
Total Cayman Islands					3,328			
(Cost \$3,404)								
CHILE 0.2%								
SOVEREIGN ISSUES 0.2%								
Chile Government International Bond								
2.450% due 01/31/2031		300			259			
Total Chile					259			
(Cost \$265)								
CHINA 3.6%								
SOVEREIGN ISSUES 3.6%								
China Development Bank								
3.400% due 01/09/2028	CNY	4,300			612			
China Government International Bond								
2.600% due 09/01/2032		8,400			1,146			
2.750% due 02/17/2032		4,000			552			
3.010% due 05/13/2028		5,300			750			
3.190% due 04/15/2053		3,900			556			
3.270% due 11/19/2030		4,700			679			
3.390% due 03/16/2050		900			130			
3.720% due 04/12/2051		1,200			185			
3.810% due 09/14/2050		1,500			234			
Total China					4,844			
(Cost \$5,014)								
DENMARK 3.6%								
CORPORATE BONDS & NOTES 3.6%								
Jyske Realkredit AJS								
1.000% due 10/01/2050	DKK	25			2			
1.500% due 10/01/2050		124			13			
1.500% due 10/01/2053		292			31			
2.000% due 10/01/2050		8			1			
2.500% due 10/01/2047		1			0			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab								
1.000% due 10/01/2050	DKK	27	\$		3			
1.500% due 10/01/2050		1,264			136			
1.500% due 10/01/2053		392			42			
2.000% due 10/01/2050		17			2			
2.500% due 10/01/2047		5			1			
3.000% due 10/01/2047		1			0			
Nykredit Realkredit AJS								
1.000% due 10/01/2050		166			17			
1.000% due 10/01/2053		95			10			
1.500% due 10/01/2050		388			42			
1.500% due 10/01/2053		2,199			242			
2.000% due 10/01/2050		217			25			
2.500% due 10/01/2047		2			0			
3.000% due 10/01/2047		2			1			
3.000% due 10/01/2053		18,383			2,367			
Realkredit Danmark AJS								
1.000% due 10/01/2050		73			8			
1.000% due 10/01/2053		195			20			
1.500% due 10/01/2053		6,080			633			
2.500% due 04/01/2036		25			3			
2.500% due 04/01/2047		8			1			
3.000% due 07/01/2046		1			0			
5.000% due 10/01/2053		7,684			1,106			
6.000% due 10/01/2053		1,414			210			
Total Denmark					4,916			
(Cost \$5,574)								
FRANCE 1.4%								
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%								
BNP Paribas S.A.								
2.871% due 04/19/2032	\$	250			205			
5.198% due 01/10/2030		200			193			
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)		200			180			
Societe Generale S.A.								
6.691% due 01/10/2034		400			407			
					985			
SOVEREIGN ISSUES 0.7%								
France Government Bond								
0.750% due 05/25/2052	EUR	420			250			
2.000% due 05/25/2048		804			694			
					944			
Total France					1,929			
(Cost \$2,519)								
GERMANY 0.5%								
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%								
Deutsche Bank AG								
3.035% due 05/28/2032 (h)	\$	600			473			
3.961% due 11/26/2025		200			191			
Total Germany					664			
(Cost \$776)								
HUNGARY 0.1%								
SOVEREIGN ISSUES 0.1%								
Hungary Government International Bond								
0.125% due 09/21/2028	EUR	100			86			
Total Hungary					86			
(Cost \$84)								

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
INDONESIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Indonesia Government International Bond		
5.125% due 01/15/2045	\$ 200	\$ 199
Total Indonesia		199
(Cost \$249)		
IRELAND 3.6%		
ASSET-BACKED SECURITIES 3.5%		
Accunia European CLO I DAC		
4.127% due 07/15/2030	EUR 71	77
Aurium CLO IV DAC		
3.907% due 01/16/2031	300	321
Blackrock European CLO IV DAC		
4.027% due 07/15/2030	528	568
Cairn CLO IV DAC		
3.842% due 04/30/2031	197	211
Carlyle Euro CLO DAC		
4.213% due 08/15/2032	500	533
CIFC European Funding CLO III DAC		
4.227% due 01/15/2034	500	536
Contego CLO IV DAC		
3.851% due 01/23/2030	100	107
Dryden 35 Euro CLO DAC		
4.157% due 01/17/2033	250	266
GoldenTree Loan Management EUR CLO I DAC		
3.930% due 10/20/2030	386	414
Harvest CLO XXII DAC		
4.027% due 01/15/2032	200	213
Invesco Euro CLO I DAC		
3.827% due 07/15/2031	200	213
Jubilee CLO XI DAC		
3.787% due 04/15/2030	200	214
OCP Euro CLO DAC		
4.081% due 09/22/2034	500	531
Palmer Square European CLO DAC		
3.957% due 04/15/2031	488	523
		4,726
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
AerCap Ireland Capital DAC		
2.450% due 10/29/2026	\$ 200	179
Total Ireland		4,905
(Cost \$5,122)		
ISRAEL 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Israel Government International Bond		
3.375% due 01/15/2050	200	151
Total Israel		151
(Cost \$219)		
ITALY 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
AMCO - Asset Management Co. SpA		
1.500% due 07/17/2023	EUR 100	109

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 1.5%		
Cassa Depositi e Prestiti SpA		
5.750% due 05/05/2026	\$ 280	\$ 276
Italy Buoni Poliennali del Tesoro		
2.800% due 03/01/2067	EUR 46	36
4.350% due 11/01/2033	1,500	1,681
		1,993
Total Italy		2,102
(Cost \$2,066)		
JAPAN 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
2.309% due 07/20/2032	\$ 400	319
2.852% due 01/19/2033	400	330
3.407% due 03/07/2024	150	148
3.741% due 03/07/2029	200	183
5.242% due 04/19/2029	500	492
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
4.436% due 04/02/2024 (a)	300	295
Total Japan		1,767
(Cost \$1,881)		
MALAYSIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Malaysia Government International Bond		
3.899% due 11/16/2027	MYR 1,000	217
4.736% due 03/15/2046	200	46
Total Malaysia		263
(Cost \$280)		
MEXICO 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Mexico Government International Bond		
6.350% due 02/09/2035	\$ 200	211
Total Mexico		211
(Cost \$213)		
MULTINATIONAL 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Delta Air Lines, Inc.		
4.750% due 10/20/2028	300	292
NXP BV		
5.000% due 01/15/2033	100	96
Total Multinational		388
(Cost \$428)		
NETHERLANDS 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
ING Groep NV		
4.550% due 10/02/2028	200	192
4.875% due 05/18/2029 (a)(b)	200	155
JT International Financial Services BV		
3.875% due 09/28/2028	200	186
		533
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.0%		
Dutch Property Finance BV		
3.692% due 07/28/2058	EUR 73	79
Total Netherlands		612
(Cost \$681)		

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
NORWAY 0.0%		
SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Norway Government Bond		
1.750% due 03/13/2025	NOK 600	\$ 54
Total Norway		54
(Cost \$74)		
QATAR 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Qatar Energy		
3.125% due 07/12/2041	\$ 300	230
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Qatar Government International Bond		
4.625% due 06/02/2046	200	191
Total Qatar		421
(Cost \$559)		
ROMANIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Romania Government International Bond		
1.750% due 07/13/2030	EUR 300	250
3.875% due 10/29/2035	100	87
6.625% due 09/27/2029	200	227
Total Romania		564
(Cost \$577)		
SAUDI ARABIA 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Saudi Arabian Oil Co.		
2.250% due 11/24/2030	\$ 400	333
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Saudi Government International Bond		
4.875% due 07/18/2033	500	500
Total Saudi Arabia		833
(Cost \$897)		
SINGAPORE 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Singapore Government Bond		
2.625% due 08/01/2032	SGD 300	214
Total Singapore		214
(Cost \$216)		
SOUTH KOREA 3.6%		
SOVEREIGN ISSUES 3.6%		
Korea Treasury Bond		
2.000% due 06/10/2031	KRW 680,250	458
2.125% due 06/10/2027	1,070,300	768
2.375% due 12/10/2027	270,000	194
2.625% due 06/10/2028	1,220,400	884
3.250% due 06/10/2033	253,390	186
4.250% due 12/10/2032	3,011,120	2,394
Total South Korea		4,884
(Cost \$5,325)		

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
SPAIN 1.0%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Spain Government Bond		
1.450% due 04/30/2029	EUR 580	\$ 574
1.450% due 10/31/2071	397	210
3.450% due 07/30/2066	290	289
3.550% due 10/31/2033	200	220
Total Spain		1,293
(Cost \$1,679)		
SUPRANATIONAL 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
European Investment Bank		
0.500% due 07/21/2023	AUD 300	199
0.500% due 08/10/2023	200	133
Total Supranational		332
(Cost \$436)		
SWITZERLAND 1.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
Credit Suisse AG		
6.500% due 08/08/2023 (a)	\$ 800	797
UBS Group AG		
4.194% due 04/01/2031	500	445
6.442% due 08/11/2028	300	302
Total Switzerland		1,544
(Cost \$1,658)		
UNITED ARAB EMIRATES 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
DAE Sukuk Dife Ltd.		
3.750% due 02/15/2026	200	191
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Abu Dhabi Government International Bond		
3.875% due 04/16/2050	400	337
Total United Arab Emirates		528
(Cost \$655)		
UNITED KINGDOM 7.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.6%		
Barclays PLC		
5.501% due 08/09/2028	200	195
7.437% due 11/02/2033	300	325
HSBC Holdings PLC		
2.804% due 05/24/2032	200	162
2.848% due 06/04/2031	200	166
5.210% due 08/11/2028	200	196
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	EUR 200	217
6.254% due 03/09/2034	\$ 200	205
Imperial Brands Finance PLC		
3.500% due 07/28/2025	300	280
Lloyds Banking Group PLC		
5.871% due 03/06/2029	500	496
NatWest Group PLC		
4.445% due 05/08/2030	300	276
5.076% due 01/27/2030	200	191
Santander UK Group Holdings PLC		
6.534% due 01/10/2029	200	201
Standard Chartered PLC		
1.456% due 01/14/2027	400	355

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Weir Group PLC		
2.200% due 05/13/2026	\$ 300	\$ 269
		3,534
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 2.9%		
Avon Finance No.2 PLC		
5.380% due 09/20/2048	GBP 359	457
Canada Square Funding PLC		
5.426% due 06/17/2058	63	80
Eurosail PLC		
3.766% due 12/15/2044	EUR 222	238
Finsbury Square PLC		
5.689% due 12/16/2071	GBP 452	572
Lanebrook Mortgage Transaction PLC		
5.141% due 07/20/2058	82	103
London Wall Mortgage Capital PLC		
5.452% due 05/15/2051	134	169
Pierpont Btl PLC		
0.000% due 09/21/2054	400	507
Pierpont BTL PLC		
5.714% due 12/22/2053	176	222
Polaris PLC		
5.631% due 12/23/2058	67	84
Towd Point Mortgage Funding Auburn 14 PLC		
5.801% due 05/20/2045	356	451
Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC		
5.635% due 10/20/2051	35	44
Tower Bridge Funding PLC		
5.527% due 11/20/2063	65	83
Trinity Square PLC		
5.316% due 07/15/2059	127	162
Twin Bridges PLC		
5.310% due 03/12/2055	70	89
5.410% due 06/12/2055	487	618
		3,879
SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
United Kingdom Gilt		
1.125% due 01/31/2039	200	159
1.750% due 09/07/2037	150	136
3.750% due 01/29/2038	400	467
4.250% due 12/07/2040	1,152	1,418
		2,180
Total United Kingdom		9,593
(Cost \$10,672)		
UNITED STATES 54.1%		
ASSET-BACKED SECURITIES 1.8%		
Landmark Funding Trust		
2.000% due 04/20/2032	\$ 700	597
Mariner Finance Issuance Trust		
2.100% due 11/20/2036	700	608
Navient Private Education Refi Loan Trust		
2.120% due 01/15/2069	48	44
Navient Student Loan Trust		
6.300% due 03/25/2066	468	462
Ready Capital Mortgage Financing LLC		
6.100% due 07/25/2036	377	366

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
SMB Private Education Loan Trust		
1.600% due 09/15/2054	\$ 457	\$ 406
		2,483
CORPORATE BONDS & NOTES 6.9%		
AbbVie, Inc.		
3.200% due 11/21/2029	300	271
AES Corp.		
2.450% due 01/15/2031	200	162
American Tower Corp.		
2.900% due 01/15/2030	200	173
Amgen, Inc.		
3.350% due 02/22/2032	100	88
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
5.550% due 01/23/2049	100	106
Aviation Capital Group LLC		
4.125% due 08/01/2025	100	93
5.500% due 12/15/2024	100	98
Bank of America Corp.		
3.419% due 12/20/2028	415	381
4.571% due 04/27/2033	500	470
Black Hills Corp.		
2.500% due 06/15/2030	100	83
Boeing Co.		
3.600% due 05/01/2034	100	85
3.625% due 02/01/2031	50	45
British Airways 2018-1 Class A Pass-Through Trust		
4.125% due 09/20/2031	68	61
Broadcom, Inc.		
2.450% due 02/15/2031	50	41
3.419% due 04/15/2033	100	84
3.469% due 04/15/2034	300	246
4.300% due 11/15/2032	48	44
Charter Communications Operating LLC		
3.850% due 04/01/2061	24	15
3.900% due 06/01/2052	24	16
3.950% due 06/30/2062	150	92
Citigroup, Inc.		
2.976% due 11/05/2030	100	87
3.070% due 02/24/2028	600	552
Comcast Corp.		
2.937% due 11/01/2056	131	85
Crown Castle, Inc.		
2.250% due 01/15/2031	400	326
CVS Health Corp.		
5.875% due 06/01/2053	100	103
Energy Transfer LP		
5.300% due 04/01/2044	50	43
6.000% due 06/15/2048	138	131
Essential Utilities, Inc.		
3.351% due 04/15/2050	36	25
Eversky Metro, Inc.		
2.250% due 06/01/2030	100	83
Goldman Sachs Group, Inc.		
1.250% due 02/07/2029	EUR 100	93
2.383% due 07/21/2032	\$ 200	160
2.615% due 04/22/2032	100	82
3.691% due 06/05/2028	200	188

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
HCA, Inc.		
4.125% due 08/15/2029	\$ 100	\$ 93
4.500% due 02/15/2027	250	241
5.900% due 06/01/2053	100	99
JPMorgan Chase & Co.		
2.522% due 04/22/2031	250	212
2.739% due 10/15/2030	100	86
2.963% due 01/25/2033	300	253
JPMorgan Chase Bank N.A.		
6.375% due 04/19/2032	IDR 5,922,000	398
Mileage Plus Holdings LLC		
6.500% due 06/20/2027	\$ 160	161
Morgan Stanley		
1.512% due 07/20/2027	200	177
Oracle Corp.		
3.950% due 03/25/2051 (h)	100	76
Pacific Gas & Electric Co.		
3.150% due 01/01/2026	100	93
3.250% due 06/01/2031	200	163
5.450% due 06/15/2027	300	292
Santander Holdings USA, Inc.		
4.500% due 07/17/2025	200	194
Southern California Edison Co.		
3.600% due 02/01/2045	50	37
3.650% due 06/01/2051	100	74
Southern California Gas Co.		
2.550% due 02/01/2030	150	129
T-Mobile USA, Inc.		
3.300% due 02/15/2051	126	89
3.600% due 11/15/2060	176	124
Toyota Motor Credit Corp.		
5.810% due 12/11/2023	300	300
UMass Memorial Health Care Obligated Group		
5.363% due 07/01/2052	200	197
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 05/01/2028	85	74
VMware, Inc.		
2.200% due 08/15/2031	100	79
4.700% due 05/15/2030	100	96
Wells Fargo & Co.		
2.393% due 06/02/2028	200	178
2.572% due 02/11/2031	100	85
3.526% due 03/24/2028	300	280
3.584% due 05/22/2028	100	93
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.		
3.200% due 06/15/2025	300	285
		9,270
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 2.1%		
Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.395% due 09/25/2035 (c)	8	7
Alternative Loan Trust		
6.000% due 04/25/2037 (c)	115	55
Banc of America Funding Trust		
4.416% due 01/20/2047 (c)	15	14

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.033% due 11/25/2034	\$ 4	\$ 4
4.096% due 05/25/2034	11	9
4.403% due 10/25/2033	6	5
4.439% due 02/25/2034	1	1
4.636% due 07/25/2033	8	8
4.715% due 05/25/2033	30	28
4.996% due 05/25/2034	19	17
Bear Stearns Alternative-A Trust (c)		
3.950% due 02/25/2036	22	15
4.365% due 01/25/2036	82	75
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust		
3.484% due 12/28/2046 (c)	13	10
Benchmark Mortgage Trust		
4.470% due 07/15/2055	600	564
BSREP Commercial Mortgage Trust		
6.144% due 08/15/2038	500	454
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
6.080% due 09/25/2035	23	23
6.780% due 09/25/2035	15	14
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
3.810% due 11/25/2034	24	22
5.730% due 04/25/2035	5	4
5.790% due 03/25/2035	46	40
5.910% due 02/20/2036 (c)	10	8
6.537% due 02/20/2036 (c)	28	25
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
5.270% due 07/25/2037	189	125
CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates		
4.260% due 07/25/2033	1	1
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
5.677% due 08/19/2045	4	3
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust		
4.715% due 08/25/2035 (c)	8	6
Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates		
3.600% due 01/25/2029	200	189
GMACM Mortgage Loan Trust		
3.623% due 11/19/2035 (c)	6	5
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates		
4.725% due 10/25/2033	1	1
GSR Mortgage Loan Trust		
6.780% due 03/25/2033	4	3
HarborView Mortgage Loan Trust		
4.201% due 07/19/2035 (c)	6	5
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
3.916% due 12/25/2034	8	8
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust		
3.723% due 03/15/2050	100	92
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust		
3.694% due 03/15/2050	100	92
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
2.812% due 01/16/2037	100	91
JPMorgan Mortgage Trust		
3.854% due 11/25/2033	10	9
4.086% due 02/25/2035	6	5
4.186% due 07/25/2035	22	21
Lehman Asset-Backed Securities Mortgage Loan Trust		
5.240% due 06/25/2037	22	14

	元本 (単位：千)	時価 (単位：千)
Long Beach Mortgage Loan Trust		
5.710% due 10/25/2034	\$ 39	\$ 36
Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust		
5.633% due 12/15/2030	37	35
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
4.386% due 02/25/2033	12	11
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
3.102% due 11/15/2049	100	91
Morgan Stanley Capital I Trust		
3.530% due 08/15/2050	100	92
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
3.834% due 10/25/2035	17	10
Residential Asset Securitization Trust		
5.500% due 06/25/2033	38	35
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust		
5.280% due 05/25/2037 (c)	298	224
Sequoia Mortgage Trust		
4.601% due 04/20/2035	6	6
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
5.282% due 02/25/2034	11	10
5.590% due 05/25/2037	26	23
5.701% due 04/25/2034	8	8
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
5.570% due 05/25/2036	43	29
5.846% due 03/19/2034	6	6
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
6.670% due 04/25/2035	4	4
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
4.016% due 03/25/2033	54	51
4.280% due 03/25/2034	36	35
4.830% due 06/25/2033	7	7
5.770% due 01/25/2045	6	6
		2,791
MUNICIPAL BONDS & NOTES 0.2%		
Illinois, Electric Agency Revenue Bonds, Series 2009		
6.832% due 02/01/2035	200	217
Oklahoma Development Finance Authority, Revenue Bonds, Series 2022		
5.087% due 02/01/2052	100	101
		318
U.S. GOVERNMENT AGENCIES 28.9%		
Fannie Mae		
4.000% due 12/01/2025	6	6
4.000% due 02/01/2026	11	11
4.000% due 06/01/2048	33	31
4.000% due 09/01/2048	57	55
4.287% due 02/01/2036	20	19
4.500% due 06/01/2038	41	41
6.000% due 12/01/2037	7	7
Fannie Mae, TBA (d)		
2.500% due 08/01/2053	1,280	1,087
3.000% due 08/01/2053	3,100	2,733
3.500% due 08/01/2053	3,600	3,284
4.000% due 08/01/2053	5,300	4,978
4.500% due 08/01/2053	8,100	7,792
5.000% due 09/01/2053	3,700	3,628
5.500% due 09/01/2053	6,300	6,269
6.000% due 08/01/2053	8,600	8,675

	元本 (單位：千)	時価 (單位：千)
Freddie Mac		
6.000% due 12/01/2033	\$ 44	\$ 44
6.000% due 04/15/2036	77	80
Ginnie Mae		
3.000% due 04/20/2047	148	134
3.500% due 01/20/2048	160	150
5.000% due 02/15/2039	75	76
	39,100	
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 14.2%		
Treasury Inflation Protected Securities (e)		
0.375% due 07/15/2027	496	465
0.625% due 07/15/2032	209	192
0.750% due 02/15/2045 (k)	111	92
1.125% due 01/15/2033	1,324	1,269
1.625% due 10/15/2027	2,355	2,321
U.S. Treasury Bonds		
1.625% due 11/15/2050	232	144
1.875% due 02/15/2041	3,850	2,799
1.875% due 11/15/2051	400	264
2.000% due 11/15/2041	300	220
2.250% due 02/15/2052	300	217
2.375% due 02/15/2042	900	701
2.500% due 02/15/2045	134	104
2.875% due 05/15/2043	1	1
2.875% due 05/15/2052	400	332
3.625% due 08/15/2043	221	208
3.875% due 02/15/2043	220	215
4.000% due 11/15/2042	1,200	1,193
4.375% due 05/15/2041	237	249
U.S. Treasury Notes		
0.375% due 04/30/2025	50	46
2.750% due 08/31/2023	1,700	1,693
2.750% due 02/28/2025	6,800	6,552
	19,277	
Total United States (Cost \$77,409)	73,239	
SHORT-TERM INSTRUMENTS 36.9%		
COMMERCIAL PAPER 2.2%		
Ameren Corp.		
5.426% due 07/24/2023 (f)	500	498
American Electric Power Co., Inc.		
5.526% due 08/14/2023 (f)	400	397
Constellation Brands, Inc.		
5.611% due 07/03/2023 (f)	500	500
Dominion Energy, Inc.		
5.483% due 07/28/2023 (f)	300	299
Electricite de France S.A. (f)		
5.547% due 08/03/2023	350	348
5.547% due 08/04/2023	350	348
Marriott International, Inc.		
5.443% due 07/18/2023 (f)	250	250
Mondelez International, Inc.		
5.468% due 08/01/2023 (f)	400	398
	3,038	
REPURCHASE AGREEMENTS (j) 8.4%		
	11,300	
TIME DEPOSITS 0.8%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
3.020% due 07/03/2023	AUD 53	35

	元本 (單位：千)	時価 (單位：千)
Bank of Nova Scotia		
3.790% due 07/04/2023	CAD 38	\$ 29
4.570% due 07/03/2023	\$ 9	9
BNP Paribas Bank		
(0.370%) due 07/03/2023	¥ 6	0
2.220% due 07/03/2023	DKK 4	0
2.470% due 07/03/2023	SEK 57	5
2.850% due 07/03/2023	NOK 587	55
3.020% due 07/03/2023	AUD 117	78
3.050% due 07/03/2023	SGD 4	3
3.720% due 07/03/2023	HKD 27	3
4.150% due 07/03/2023	NZD 85	52
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.370%) due 07/03/2023	¥ 1	0
0.650% due 07/03/2023	CHF 7	8
4.170% due 07/03/2023	GBP 1	2
Citibank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	\$ 66	66
DBS Bank Ltd.		
4.570% due 07/03/2023	52	52
DnB Bank ASA		
2.470% due 07/03/2023	SEK 18	2
3.020% due 07/03/2023	AUD 64	43
HSBC Bank		
3.050% due 07/03/2023	SGD 1	1
3.720% due 07/03/2023	HKD 117	15
HSBC Bank PLC		
2.620% due 07/03/2023	EUR 98	107
4.170% due 07/03/2023	GBP 17	22
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	\$ 51	51
MUFG Bank Ltd.		
(0.370%) due 07/03/2023	¥ 16	0
Royal Bank of Canada		
3.790% due 07/04/2023	CAD 21	16
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.370%) due 07/03/2023	¥ 159	1
2.620% due 07/03/2023	EUR 15	17
4.170% due 07/03/2023	GBP 45	57
4.570% due 07/03/2023	\$ 101	101
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.370%) due 07/03/2023	¥ 41	0
2.620% due 07/03/2023	EUR 25	27
4.170% due 07/03/2023	GBP 59	74
4.570% due 07/03/2023	\$ 118	118
	1,049	
JAPAN TREASURY BILLS 25.5%		
(0.244%) due 07/03/2023 (f)	¥ 530,000	3,667
(0.200%) due 07/24/2023 (f)	160,000	1,107
(0.200%) due 07/18/2023 (g)	84,000	581
(0.196%) due 09/11/2023 (g)	953,000	6,595
(0.193%) due 08/14/2023 (g)	630,000	4,360
(0.192%) due 07/31/2023 (g)	27,000	187
(0.186%) due 08/28/2023 (g)	560,000	3,875
(0.183%) due 08/21/2023 (f)	420,000	2,906
(0.182%) due 09/04/2023 (f)	396,000	2,741
(0.150%) due 09/25/2023 (f)	690,000	4,775
(0.143%) due 10/02/2023 (d)(g)	530,000	3,668
	34,482	
Total Short-Term Instruments (Cost \$51,337)	49,849	

	時価 (單位：千)
Total Investments in Securities 128.9% (Cost \$185,363)	\$ 174,375
Financial Derivative	
Instruments (j)(i) 0.2% (Cost or Premiums, net \$(18))	324
Other Assets and Liabilities, net (29.1%)	(39,447)
Net Assets 100.0%	\$ 135,252

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

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

(h) RESTRICTED SECURITIES:

Issuer Description	Coupon	Maturity Date	Acquisition Date	Cost	Market Value	Market Value as Percentage of Net Assets
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/27/2021	\$ 571	\$ 473	0.35%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	07/27/2021	111	76	0.06%
Total Restricted Securities				\$ 682	\$ 549	0.41%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS
(i) REPURCHASE AGREEMENTS:

Counterparty	Lending Rate	Settlement Date	Maturity Date	Principal Amount	Collateralized By	Collateral Received, at Value	Repurchase Agreements, at Value	Repurchase Agreement Proceeds to be Received ⁽¹⁾
BPS	5.160%	06/30/2023	07/03/2023	\$ 11,300	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0.125% due 07/15/2031	\$ (11,585)	\$ 11,300	\$ 11,305
Total Repurchase Agreements						\$ (11,585)	\$ 11,300	\$ 11,305

SHORT SALES:

Counterparty	Description	Coupon	Maturity Date	Principal Amount	Proceeds	Payable for Short Sales
MSC	Fannie Mae, TBA	2.000%	08/01/2053	\$ 4,440	\$ (3,643)	\$ (3,627)
Total Short Sales (2.7%)					\$ (3,643)	\$ (3,627)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of June 30, 2023:

Counterparty	Repurchase Agreement Proceeds to be Received	Payable for Reverse Repurchase Agreements	Payable for Sale-Buyback Transactions	Payable for Short Sales	Total Borrowings and Other Financing Transactions	Collateral Pledged/(Received)	Net Exposure ⁽²⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 11,305	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 11,305	\$ (11,585)	\$ (280)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
MSC	0	0	0	(3,627)	(3,627)	0	(3,627)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 11,305	\$ 0	\$ 0	\$ (3,627)			

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

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

The average amount of borrowings outstanding during the period ended June 30, 2023 was \$89 at a weighted average interest rate of 1.026%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

g) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED

WRITTEN OPTIONS:

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

Description	Strike Price	Expiration Date	# of Contracts	Premiums (Received)	Market Value
Call - U.S. Treasury Bond August 2023 Futures	\$ 131.000	07/21/2023	1	\$ (1)	\$ 0
Put - U.S. Treasury Bond August 2023 Futures	123.000	07/21/2023	1	0	0
Total Written Options				\$ (1)	\$ 0

FUTURES CONTRACTS:

Description	Type	Expiration Month	# of Contracts	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
					Asset	Liability
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2024	46	\$ 108	\$ 0	\$ (67)
Australia Government 3-Year Bond September Futures	Short	09/2023	37	15	13	0
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	14	5	13	0
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2023	17	(23)	12	0
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	Short	09/2023	54	44	30	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	Long	09/2023	3	3	0	(3)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	18	25	15	0
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2023	2	4	0	(2)
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	8	6	8	0
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	Short	09/2023	2	0	19	0
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	1	(4)	0	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2023	22	65	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2023	11	(23)	1	0
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2023	52	(97)	30	0
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	Short	09/2023	2	1	0	(2)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Short	09/2023	21	28	0	(8)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	Short	09/2023	1	0	0	(2)
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September Futures	Long	09/2023	10	(11)	0	(9)
Total Futures Contracts				\$ 146	\$ 141	\$ (93)

SWAP AGREEMENTS:

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

Reference Entity	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Implied Credit Spread at June 30, 2023 ⁽²⁾	Notional Amount ⁽³⁾	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
							Asset	Liability
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	0.744%	\$ 100	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	\$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2028	0.952%	100	0	1	0	0
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	1.224%	EUR 100	(1)	1	0	0
					\$ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 0

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

Index/Tranches	Fixed Deal (Pay) Rate	Maturity Date	Notional Amount ⁽³⁾	Market Value ⁽³⁾	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
						Asset	Liability
CDX.IG-40 Index	(1.000%)	06/20/2033	\$ 1,400	\$ 5	\$ (14)	\$ 0	\$ (5)

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

Index/Tranches	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Notional Amount ⁽³⁾	Market Value ⁽³⁾	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
						Asset	Liability
CDX.IG-40 Index	1.000%	06/20/2028	\$ 13,200	\$ 201	\$ 92	\$ 17	\$ 0

INTEREST RATE SWAPS

Pay/Receive	Floating Rate	Floating Rate Index	Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin		
								Asset	Liability	
Pay	3-Month Canadian Bank Bill		0.900%	03/10/2024	CAD 600	\$ (20)	\$ (20)	\$ 0	\$ 0	
Pay	3-Month Canadian Bank Bill		1.900%	12/18/2029	2,000	(174)	(137)	10	0	
Pay	3-Month Canadian Bank Bill		2.200%	12/18/2049	350	(66)	(53)	4	0	
Pay	3-Month Canadian Bank Bill		1.750%	06/17/2050	20	(5)	(6)	0	0	
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill		4.000%	06/14/2024	NZD 10,600	(115)	(98)	0	(2)	
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill		1.250%	12/15/2024	2,800	(109)	(49)	0	0	
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill		3.750%	06/15/2027	900	(22)	(16)	0	(1)	
Receive	3-Month THOR		2.000%	03/15/2025	THB 94,240	14	14	14	0	
Pay	3-Month THOR		2.750%	03/15/2033	12,440	2	(4)	0	(3)	
Pay	3-Month USD-LIBOR		1.665%	07/12/2023	\$ 1,900	(7)	(7)	0	0	
Pay	3-Month USD-LIBOR		0.000%	08/04/2023	12,700	(174)	(174)	0	0	
Receive	3-Month USD-LIBOR		1.500%	09/21/2023	2,400	25	24	0	(1)	
Pay	6-Month Australian Bank Bill		2.131%	01/11/2032	AUD 400	(45)	(45)	0	(2)	
Pay	6-Month Australian Bank Bill		2.100%	01/18/2032	200	(23)	(5)	0	(1)	
Pay ⁽¹⁾	6-Month Australian Bank Bill		4.250%	09/15/2032	600	(4)	(3)	0	(2)	
Pay ⁽¹⁾	6-Month Australian Bank Bill		4.500%	09/15/2032	7,000	5	29	0	(22)	
Pay	6-Month Australian Bank Bill		4.000%	06/21/2033	3,000	(69)	(47)	0	(20)	
Pay	6-Month EURIBOR		0.550%	08/10/2024	EUR 200	(10)	(10)	0	0	
Pay	6-Month EURIBOR		0.500%	12/15/2026	460	(48)	(64)	0	(2)	
Pay ⁽¹⁾	6-Month EURIBOR		3.000%	03/19/2027	6,290	(1)	(34)	0	(14)	
Pay	6-Month EURIBOR		0.650%	04/12/2027	1,050	(118)	(106)	0	(4)	
Pay	6-Month EURIBOR		0.650%	05/11/2027	800	(89)	(81)	0	(3)	
Pay ⁽¹⁾	6-Month EURIBOR		3.000%	09/20/2028	15,800	(162)	21	0	(77)	
Pay	6-Month EURIBOR		2.547%	03/09/2033	550	(24)	(24)	0	(3)	
Pay	6-Month EURIBOR		1.750%	03/15/2033	100	(11)	(1)	0	(1)	
Receive ⁽¹⁾	6-Month EURIBOR		3.000%	03/15/2033	2,800	(37)	(15)	5	0	
Pay	6-Month EURIBOR	(0.175%)		03/17/2033	900	(269)	(269)	0	(5)	
Pay ⁽¹⁾	6-Month EURIBOR		3.000%	09/20/2033	11,400	19	79	0	(72)	
Receive	6-Month EURIBOR		0.000%	03/17/2053	300	171	171	1	0	
Receive ⁽¹⁾	6-Month EURIBOR		2.500%	09/20/2053	2,200	6	(69)	17	0	
Receive ⁽¹⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate		0.850%	09/20/2033	¥ 570,000	(90)	(15)	8	0	
Pay ⁽¹⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average		3.500%	05/10/2025	CAD 19,700	(147)	(85)	15	0	
Pay	Euro Short-Term Rate		2.750%	06/21/2024	EUR 6,100	(70)	(70)	0	(2)	
Pay	IBMXID		8.450%	01/24/2028	MXN 6,900	0	0	0	0	
Pay	IBMXID		5.970%	05/06/2030	2,800	(19)	(16)	0	(1)	
Pay	KRW-CD-KSDA-Bloomberg		3.500%	09/21/2027	KRW 4,454,900	(5)	12	0	(8)	
Receive	KRW-CD-KSDA-Bloomberg		3.250%	03/15/2033	1,167,010	13	5	3	0	
Receive ⁽¹⁾	KRW-CD-KSDA-Bloomberg		3.250%	09/20/2033	523,170	5	1	2	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		0.000%	08/04/2023	\$ 12,700	175	175	0	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate		1.270%	11/04/2023	12,700	(276)	(276)	1	0	
Receive ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		1.500%	06/21/2024	2,400	71	144	0	(1)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		1.050%	12/15/2024	1,000	76	42	0	0	
Receive ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		3.200%	05/10/2025	15,300	170	32	0	(3)	
Receive ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		4.250%	12/20/2025	6,800	13	28	0	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		3.196%	02/28/2027	3,250	125	125	0	(1)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		1.750%	06/15/2027	1,300	112	24	0	(6)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		3.800%	03/10/2028	1,400	15	38	0	(1)	
Pay ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		1.665%	01/12/2029	1,900	(226)	(226)	1	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate		1.000%	06/15/2029	800	(119)	(46)	1	0	
Pay ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		3.500%	12/20/2030	2,300	(4)	(25)	3	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate		2.750%	09/21/2032	1,500	115	75	0	(3)	
Receive ⁽¹⁾	Secured Overnight Financing Rate		3.500%	12/20/2033	1,000	(5)	5	0	(3)	
Pay	Singapore Overnight Index Average		3.000%	06/15/2027	SGD 1,100	(12)	(22)	0	(2)	
Receive	Singapore Overnight Index Average		3.000%	12/21/2032	300	3	6	1	0	
Pay ⁽¹⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate		3.500%	09/20/2033	GBP 1,500	(121)	(87)	0	(13)	
Pay ⁽¹⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate		3.250%	09/20/2053	200	(24)	(18)	0	(2)	
Pay	Swiss Overnight Rate Average	(0.500%)		09/15/2026	CHF 1,300	(125)	(13)	0	(12)	
							\$ (1,710)	\$ (1,186)	\$ 86	\$ (293)
Total Swap Agreements							\$ (1,504)	\$ (1,107)	\$ 103	\$ (298)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of June 30, 2023:

- (k) Securities with an aggregate market value of \$19 and cash of \$2,804 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of June 30, 2023. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	Financial Derivative Assets				Financial Derivative Liabilities			
	Market Value		Variation Margin		Market Value		Variation Margin	
	Purchased Options	Futures	Swap Agreements	Asset Total	Written Options	Futures	Swap Agreements	Liability Total
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 141	\$ 103	\$ 244	\$ 0	\$ (93)	\$ (298)	\$ (391)

¹¹ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

¹² If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

¹³ Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

¹⁴ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

¹⁵ The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

¹⁶ This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

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

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)		
				Asset	Liability	
AZD	07/2023	AUD	56	\$ 36	\$ 0	(11)
AZD	07/2023	\$	80	AUD	120	0
AZD	08/2023	AUD	120	\$	80	0
BOA	07/2023	\$	390	MXN	7,174	27
BOA	07/2023		42	NZD	69	0
BOA	08/2023	EUR	188	\$	206	1
BOA	08/2023	JPY	109,192		792	30
BOA	08/2023	\$	12	CAD	16	0
BOA	08/2023		1,298	CNY	8,907	0
BOA	09/2023	KRW	1,090,744	\$	650	19
BOA	09/2023	TWD	5,199		171	4
BOA	09/2023	\$	240	IDR	3,587,141	0
BOA	09/2023		353	INR	29,226	2
BPS	07/2023	AUD	57	\$	38	0
BPS	07/2023	\$	57	AUD	86	0
BPS	07/2023		121	CZK	2,605	0
BPS	07/2023		2,234	JPY	310,488	0
BPS	08/2023	AUD	86	\$	57	0
BPS	08/2023	CNY	468		66	1
BPS	08/2023	EUR	169		183	0
BPS	08/2023	TWD	2,602		85	2
BPS	08/2023	\$	28	AUD	43	1
BPS	08/2023		716	CNH	4,944	0
BPS	08/2023		1,601	CNY	10,956	0
BPS	08/2023		598	EUR	547	0
BPS	08/2023		1,386	JPY	199,434	1
BPS	08/2023		28	TWD	855	0
BPS	09/2023	THB	2	\$	0	0
BPS	09/2023	\$	27	IDR	403,191	0
BRC	07/2023	JPY	530,000	\$	4,119	452
BRC	07/2023		84,000		649	67
BRC	07/2023	PHP	22,042		392	0
BRC	07/2023	\$	1,034	MYR	4,745	0
BRC	07/2023		124	RON	560	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)					
				Asset	Liability				
BRC	08/2023	GBP	94	\$	117	\$	0	\$	(2)
BRC	08/2023	\$	155	CDP	658,934		1		0
BRC	08/2023		259	EUR	239		2		0
BRC	09/2023	JPY	396,000	\$	2,893		126		0
BRC	09/2023	PHP	37,125		662		0		(8)
BRC	09/2023	\$	12	CDP	51,396		0		0
BRC	09/2023		58	ILS	208		0		(2)
BRC	10/2023	JPY	530,000	\$	3,711		0		(8)
CBK	07/2023	\$	107	CZK	2,299		0		(1)
CBK	08/2023	AUD	14	\$	9		0		0
CBK	08/2023	CAD	93		71		0		0
CBK	08/2023	CNY	1,001		140		1		0
CBK	08/2023	DKK	32,100		4,637		0		(80)
CBK	08/2023	EUR	899		983		0		0
CBK	08/2023	GBP	344		427		0		(10)
CBK	08/2023	JPY	60,808		441		17		0
CBK	08/2023	TWD	2,504		82		2		0
CBK	08/2023	\$	1,347	CAD	1,797		11		0
CBK	08/2023		65	CLP	53,023		1		0
CBK	08/2023		355	CNY	2,483		0		(12)
CBK	08/2023		266	EUR	248		5		0
CBK	08/2023		369	NOK	3,854		0		(9)
CBK	08/2023		584	SEK	5,925		0		(35)
CBK	09/2023	KRW	64,315	\$	49		0		0
CBK	09/2023	\$	4	KRW	4,789		0		0
DUB	08/2023	CNH	4,962	\$	723		38		0
DUB	08/2023	\$	73	DKK	500		0		0
FAR	07/2023		25	CLP	19,965		0		0
GLM	07/2023	NZD	847	AUD	778		0		(1)
GLM	08/2023	CNH	2,429	\$	348		13		0
GLM	08/2023	\$	314	CHF	278		0		(2)
GLM	08/2023		162	NOK	1,723		0		(1)
GLM	09/2023		358	THB	12,331		0		(7)
IND	08/2023	CNH	326	\$	47		2		0
IND	08/2023	JPY	390,000		2,834		112		0
IND	08/2023	\$	417	NOK	4,372		0		(8)
JPM	07/2023	JPY	36,782	EUR	247		15		0
JPM	07/2023		103,658	\$	725		8		0
JPM	07/2023	KRW	1,206,363		943		27		0
JPM	07/2023	SGD	21		16		0		0
JPM	08/2023	CNH	8,072		1,132		19		0
JPM	08/2023	\$	2,209	CAD	2,953		24		0
JPM	08/2023		473	CHF	416		0		(6)
JPM	08/2023		574	CNH	3,969		0		(27)
JPM	08/2023		1,483	CNY	10,142		0		(80)
JPM	08/2023		106	EUR	97		0		0
JPM	08/2023		297	GBP	234		1		0
JPM	08/2023		67	HUF	23,375		1		0
JPM	08/2023		725	JPY	103,218		0		(7)
JPM	08/2023		60	NOK	636		0		(1)
JPM	09/2023		100	IDR	1,500,538		0		0
JPM	09/2023		1		7,881		0		0
JPM	09/2023		56	ILS	200		0		(2)
JPM	09/2023		85	PEN	314		1		0
JPM	09/2023		340	THB	11,661		0		(9)
JPM	12/2023		676	INR	55,784		0		0
MBC	07/2023	JPY	160,000	\$	1,225		115		0
MBC	07/2023		6,100		43		1		0
MBC	08/2023	CAD	96		72		0		(1)
MBC	08/2023	CNH	2,104		302		12		0
MBC	08/2023	CNY	468		66		1		0
MBC	08/2023	JPY	420,000		3,074		146		0
MBC	08/2023	TWD	249		8		0		0
MBC	08/2023	\$	25,199	EUR	22,836		0		(230)
MBC	09/2023	JPY	953,000	\$	6,942		277		0
MBC	09/2023	KRW	905,698		710		20		0
MYI	07/2023	IDR	945,619		63		0		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
MYI	07/2023	PLN 28	\$ 7	\$ 0	\$ 0
MYI	07/2023	\$ 83	IDR 945,619	0	0
MYI	07/2023		MYR 1,506	0	(4)
MYI	08/2023	AUD 152	\$ 101	0	0
MYI	08/2023	CAD 93	70	0	0
MYI	08/2023	CHF 13	15	0	0
MYI	08/2023	CNH 529	73	0	0
MYI	08/2023	DKK 104	15	0	0
MYI	08/2023	EUR 1,672	1,809	0	(19)
MYI	08/2023	GBP 52	66	0	0
MYI	08/2023	NOK 782	73	0	0
MYI	08/2023	NZD 9	6	0	0
MYI	08/2023	SEK 188	17	0	0
MYI	08/2023	TWD 17,061	560	12	0
MYI	08/2023	\$ 83	CAD 113	2	0
MYI	08/2023	28	CHF 25	0	0
MYI	08/2023	42	DKK 289	1	0
MYI	08/2023	121	EUR 111	0	0
MYI	08/2023	28	JPY 3,866	0	(1)
MYI	08/2023	117	16,775	0	0
MYI	08/2023	112	NOK 1,244	4	0
MYI	08/2023	14	SEK 151	0	0
MYI	09/2023	KRW 1,017,857	\$ 795	20	0
MYI	09/2023	MXN 104	6	0	0
MYI	09/2023	\$ 63	IDR 946,441	0	0
MYI	09/2023	15	221,852	0	0
MYI	09/2023	155	THB 5,316	0	(4)
NGF	08/2023	884	CNH 6,067	0	(47)
NGF	09/2023	SGD 704	\$ 528	7	0
RBC	08/2023	\$ 57	GBP 45	0	0
RBC	08/2023	87	MXN 1,516	0	0
SCX	07/2023	117	AUD 177	0	0
SCX	07/2023	110	NZD 181	1	0
SCX	08/2023	AUD 177	\$ 117	0	0
SCX	08/2023	CNY 305	43	1	0
SCX	08/2023	TWD 11,243	368	7	0
SCX	08/2023	\$ 273	CNH 1,881	0	(14)
SCX	08/2023	3,945	CNY 26,930	0	(218)
SCX	09/2023	TWD 4,368	\$ 143	3	0
SCX	09/2023	\$ 46	IDR 694,986	0	0
SCX	09/2023	525	7,804,101	0	(6)
SCX	09/2023	349	THB 12,068	0	(6)
SOG	07/2023	AUD 367	\$ 240	0	(4)
SOG	07/2023	\$ 278	PLN 1,198	17	0
SOG	07/2023	140	SGD 185	0	(3)
SSB	07/2023	CLP 19,994	\$ 25	0	0
SSB	07/2023	JPY 27,000	205	17	0
SSB	08/2023	630,000	4,746	359	0
SSB	08/2023	\$ 25	CLP 20,052	0	0
TOR	07/2023	AUD 194	\$ 127	0	(2)
TOR	07/2023	NZD 250	152	0	(1)
TOR	07/2023	\$ 144	AUD 217	1	0
TOR	08/2023	AUD 217	\$ 144	0	(1)
TOR	08/2023	\$ 42	HUF 14,805	0	0
TOR	08/2023	152	NZD 250	1	0
TOR	09/2023	JPY 690,000	\$ 4,897	60	0
UAG	07/2023	AUD 44	29	0	0
UAG	07/2023	\$ 69	AUD 105	0	0
UAG	08/2023	AUD 105	\$ 69	0	0
UAG	08/2023	CAD 66	49	0	(1)
UAG	08/2023	\$ 259	GBP 205	2	0
UAG	09/2023	SGD 205	\$ 154	1	0
UAG	09/2023	\$ 48	ILS 173	0	(2)
UAG	09/2023	334	INR 27,648	2	0
				\$ 2,124	\$ (1,181)

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

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)					
				Asset	Liability				
BDA	07/2023	AUD	76	\$	49	\$	0	\$	(11)
BDA	07/2023	CAD	487		358		0		(10)
BDA	07/2023	CLP	5,630		7		0		0
BDA	07/2023	COP	45,955		10		0		(1)
BDA	07/2023	DKK	40		6		0		0
BDA	07/2023	HUF	2,798		8		0		0
BDA	07/2023	JPY	4,446		32		1		0
BDA	07/2023	KRW	645		0		0		0
BDA	07/2023	NOK	53		5		0		0
BDA	07/2023	NZD	7		4		0		0
BDA	07/2023	PEN	25		7		0		0
BDA	07/2023	SEK	10		1		0		0
BDA	07/2023	\$	3	AUD	4		0		0
BDA	07/2023		7	CLP	5,630		0		0
BDA	07/2023		11	COP	45,955		0		0
BDA	07/2023		11	DKK	73		0		0
BDA	07/2023		5	EUR	5		0		0
BDA	07/2023		3	JPY	439		0		0
BDA	07/2023		7	PEN	25		0		0
BDA	07/2023		19	PLN	79		0		0
BDA	07/2023		47	SEK	505		0		0
BDA	07/2023		0	SGD	0		0		0
BDA	08/2023	CLP	5,630	\$	7		0		0
BDA	08/2023	DKK	73		11		0		0
BDA	08/2023	PEN	25		7		0		0
BDA	08/2023	PLN	79		19		0		0
BDA	08/2023	SEK	505		47		0		0
BDA	08/2023	SGD	0		0		0		0
BPS	07/2023	CZK	310		14		0		0
BPS	07/2023	DKK	0		0		0		0
BPS	07/2023	JPY	48,912		339		1		0
BPS	07/2023		3,320		23		0		0
BPS	07/2023	NZD	1		0		0		0
BPS	07/2023	\$	35	AUD	53		0		0
BPS	07/2023		60	CHF	54		0		0
BPS	07/2023		385	CNY	2,777		0		(2)
BPS	07/2023		2,623	EUR	2,394		0		(11)
BPS	07/2023		23	JPY	3,320		0		0
BPS	07/2023		3,482		483,803		0		(135)
BPS	07/2023		1	NOK	13		0		0
BPS	08/2023	AUD	28	\$	19		0		0
BPS	08/2023	CHF	53		60		0		0
BPS	08/2023	CNY	2,666		370		1		0
BPS	08/2023	EUR	2,302		2,526		11		0
BPS	08/2023	NOK	13		1		0		0
BPS	08/2023	\$	11	CNY	77		0		0
BPS	08/2023		331	JPY	47,599		0		0
BRC	07/2023	PLN	79	\$	19		0		(1)
BRC	07/2023	\$	1	JPY	110		0		0
BRC	07/2023		136	KRW	179,132		0		0
BRC	08/2023	KRW	178,907	\$	136		0		0
CBK	07/2023	JPY	772		5		0		0
CBK	07/2023	MXN	748		42		0		(2)
CBK	07/2023	NOK	5		0		0		0
CBK	07/2023	\$	20	CNY	144		0		0
CBK	07/2023		89	EUR	82		1		0
CBK	07/2023		43	MXN	745		0		0
CBK	08/2023	MXN	745	\$	43		0		0
GLM	07/2023	COP	45,955		11		0		0
GLM	07/2023	MYR	204		46		2		0
GLM	07/2023	\$	11	COP	45,955		0		0
GLM	07/2023		7	NOK	80		0		0
GLM	08/2023	COP	45,955	\$	11		0		0
GLM	08/2023	NOK	80		7		0		0
IND	07/2023	DKK	119		17		0		0
IND	07/2023	\$	2	CHF	1		0		0
IND	08/2023	CHF	1	\$	2		0		0

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

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered	Currency to be Received	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	
				Asset	Liability
JPM	07/2023	JPY 68,810	\$ 477	\$ 1	\$ 0
JPM	07/2023	\$ 1	SGD 2	0	0
JPM	08/2023	SGD 2	\$ 1	0	0
JPM	08/2023	\$ 477	JPY 68,520	0	(11)
MBC	07/2023	CNY 22	\$ 3	0	0
MBC	07/2023	GBP 402	498	0	(14)
MBC	07/2023	JPY 601,535	4,169	7	0
MBC	07/2023	SGD 32	24	0	0
MBC	07/2023	\$ 31	CAD 41	1	0
MBC	07/2023	6	EUR 6	0	0
MBC	07/2023	42	GBP 34	1	0
MBC	07/2023	1,249	JPY 173,638	0	(48)
MBC	08/2023	3,970	570,863	0	(2)
MYI	07/2023	CHF 1	\$ 1	0	0
MYI	07/2023	ILS 57	15	0	0
MYI	07/2023	JPY 3,583	25	0	0
MYI	07/2023	KRW 317	0	0	0
MYI	07/2023	SEK 495	46	0	0
MYI	07/2023	\$ 22	CAD 29	0	0
MYI	07/2023	14	CZK 310	0	0
MYI	07/2023	10	DKK 65	0	0
MYI	07/2023	21	GBP 17	0	0
MYI	07/2023	60	IDR 901,800	0	0
MYI	07/2023	3,008	JPY 417,688	0	(119)
MYI	07/2023	44	MYR 204	0	0
MYI	07/2023	25	SGD 34	0	0
MYI	08/2023	CZK 311	\$ 14	0	0
MYI	08/2023	DKK 65	10	0	0
MYI	08/2023	IDR 902,141	60	0	0
MYI	08/2023	MYR 204	44	0	0
MYI	08/2023	SGD 34	25	0	0
MYI	08/2023	\$ 0	KRW 317	0	0
RBC	07/2023	5	CAD 6	0	0
RBC	07/2023	3,008	JPY 417,688	0	(118)
SCX	07/2023	AUD 72	\$ 47	0	(1)
SCX	07/2023	CHF 52	58	0	0
SCX	07/2023	NZD 19	12	0	0
SCX	07/2023	\$ 38	AUD 58	0	0
SCX	07/2023	1	CNY 7	0	0
SCX	07/2023	0	IDR 1,273	0	0
SCX	07/2023	4	JPY 488	0	0
SCX	08/2023	AUD 58	\$ 38	0	0
SCX	08/2023	CNY 7	1	0	0
SOG	07/2023	AUD 81	53	0	(1)
SOG	07/2023	EUR 2,463	2,650	0	(38)
SOG	07/2023	HKD 15	2	0	0
SOG	07/2023	IDR 4,723	0	0	0
SOG	07/2023	\$ 41	CNY 294	0	0
SOG	08/2023	0	IDR 4,725	0	0
TOR	07/2023	AUD 43	\$ 28	0	(1)
TOR	07/2023	JPY 483,704	3,359	12	0
TOR	07/2023	\$ 47	AUD 71	0	0
TOR	07/2023	332	CAD 439	0	0
TOR	07/2023	468	GBP 369	0	0
TOR	07/2023	8	HUF 2,804	0	0
TOR	07/2023	16	NZD 27	0	0
TOR	08/2023	AUD 71	\$ 47	0	0
TOR	08/2023	CAD 439	332	0	0
TOR	08/2023	GBP 369	468	0	0
TOR	08/2023	HUF 2,825	8	0	0
TOR	08/2023	NZD 27	16	0	0
TOR	08/2023	\$ 3,359	JPY 481,653	0	(11)
UAG	07/2023	AUD 15	\$ 10	0	0
UAG	07/2023	CHF 3	4	0	0
UAG	07/2023	CNY 3,200	455	14	0
UAG	07/2023	CZK 0	0	0	0
UAG	07/2023	IDR 898,375	60	0	0

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

Counterparty	Settlement Month	Currency to be Delivered		Currency to be Received		Unrealized Appreciation/(Depreciation)			
						Asset	Liability		
UAG	07/2023	JPY	285,575	\$	1,980	\$	4	\$	0
UAG	07/2023	KRW	194,217		147		0		0
UAG	07/2023	NOK	39		4		0		0
UAG	07/2023	SGD	3		2		0		0
UAG	07/2023	\$	67	AUD	100		0		0
UAG	07/2023		1	CHF	1		0		0
UAG	07/2023		3	DKK	21		0		0
UAG	07/2023		16	ILS	57		0		0
UAG	07/2023		12	KRW	16,046		0		0
UAG	07/2023		0	MXN	3		0		0
UAG	08/2023	AUD	100	\$	67		0		0
UAG	08/2023	CHF	1		1		0		0
UAG	08/2023	CNY	4,575		665		32		0
UAG	08/2023	DKK	21		3		0		0
UAG	08/2023	ILS	57		16		0		0
UAG	08/2023	\$	1,980	JPY	284,372		0		(3)
						\$	89	\$	(520)
Total Forward Foreign Currency Contracts						\$	2,213	\$	(1,701)

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPIONS

Counterparty	Description	Floating Rate Index	Pay/Receive		Expiration Date	Notional Amount ⁽¹⁾	Premiums (Received)	Market Value		
			Floating Rate	Exercise Rate						
BPS	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.200%	07/06/2023	100	\$ 0	\$ 0		
BPS	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	07/06/2023	100	0	0		
JPM	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.300%	07/10/2023	105	(1)	0		
JPM	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.250%	07/20/2023	200	(1)	0		
JPM	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	07/10/2023	105	(1)	0		
JPM	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	07/20/2023	200	(1)	(1)		
MYC	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.200%	07/06/2023	100	0	0		
MYC	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.300%	07/10/2023	105	0	0		
MYC	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.270%	07/24/2023	400	(1)	(1)		
MYC	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	07/06/2023	100	0	0		
MYC	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	07/10/2023	105	(1)	0		
MYC	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.670%	07/24/2023	400	(1)	(2)		
NGF	Call - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.270%	07/24/2023	400	(1)	(1)		
NGF	Put - DTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.670%	07/24/2023	400	(1)	(2)		
Total Written Options							\$	(9)	\$	(7)

SWAP AGREEMENTS:

INTEREST RATE SWAPS

Counterparty	Pay/Receive Floating Rate	Floating Rate Index	Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)	Swap Agreements, at Value					
								Asset	Liability				
BDA	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	4.000%	08/15/2027	MYR 11,000	\$ (6)	\$ (26)	\$ 0	\$ (32)				
MYC	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	12/21/2027	2,400	(2)	0	0	(2)				
Total Swap Agreements						\$	(8)	\$	(26)	\$	0	\$	(34)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of OTC financial derivative instruments and collateral pledged/(received) as of June 30, 2023:

Counterparty	Financial Derivative Assets				Financial Derivative Liabilities				Net Market Value of OTC Derivatives	Collateral Pledged/(Received)	Net Exposure ⁽²⁾
	Forward Foreign Currency Contracts	Purchased Options	Swap Agreements	Total Over the Counter	Forward Foreign Currency Contracts	Written Options	Swap Agreements	Total Over the Counter			
AZD	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	\$ 0	\$ (1)
BDA	84	0	0	84	(78)	0	(32)	(110)	(26)	0	(26)
BPS	18	0	0	18	(357)	0	0	(357)	(339)	0	(339)
BRC	648	0	0	648	(44)	0	0	(44)	604	(380)	224
CBK	38	0	0	38	(149)	0	0	(149)	(111)	0	(111)
DUB	38	0	0	38	0	0	0	0	38	0	38
FAR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
GLM	15	0	0	15	(11)	0	0	(11)	4	0	4
IND	114	0	0	114	(8)	0	0	(8)	106	0	106
JPM	97	0	0	97	(133)	(1)	0	(134)	(37)	0	(37)
MBC	581	0	0	581	(295)	0	0	(295)	286	(210)	76
MYC	0	0	0	0	0	(3)	(2)	(5)	(5)	0	(5)
MYI	39	0	0	39	(147)	0	0	(147)	(108)	0	(108)
NGF	7	0	0	7	(47)	(3)	0	(50)	(43)	0	(43)
RBC	0	0	0	0	(118)	0	0	(118)	(118)	0	(118)
SCX	12	0	0	12	(245)	0	0	(245)	(233)	0	(233)
SOG	17	0	0	17	(46)	0	0	(46)	(29)	0	(29)
SSB	376	0	0	376	0	0	0	0	376	(330)	46
TOR	74	0	0	74	(16)	0	0	(16)	58	0	58
UAG	55	0	0	55	(6)	0	0	(6)	49	0	49
Total Over the Counter	\$ 2,213	\$ 0	\$ 0	\$ 2,213	\$ (1,701)	\$ (7)	\$ (34)	\$ (1,742)			

⁽¹⁾ Notional amount represents the number of contracts.

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

世界債券総合インデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2024年4月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2023年4月21日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債 組 比	券 入 率	債 先 比	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	期 騰 落 率	中 落 率	期 騰 落 率	中 落 率					
設定日(2023年4月21日)	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 18,542
第1期(2024年4月26日)	11,578	15.8	11,634	16.3	85.6	—	12.6	122,228	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）です。

ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスとは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行なうインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

Bloomberg®及びブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

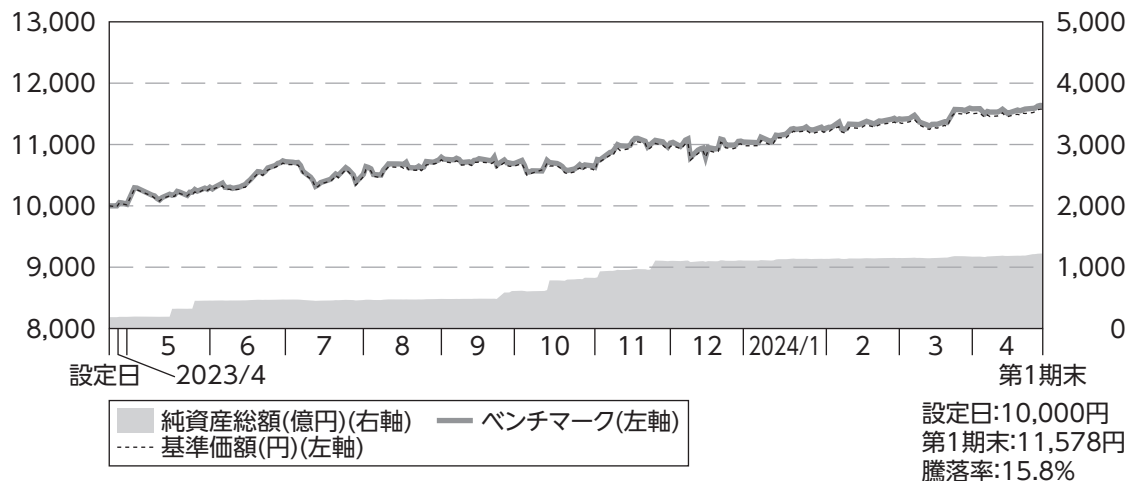
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	投資信託 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(設 定 日) 2023年 4月21日	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—	—
4月末	10,017	0.2	10,026	0.3	81.4	—	—	12.9	
5月末	10,276	2.8	10,303	3.0	84.3	—	—	13.4	
6月末	10,674	6.7	10,720	7.2	84.7	—	—	13.4	
7月末	10,476	4.8	10,514	5.1	84.3	—	—	13.1	
8月末	10,751	7.5	10,792	7.9	84.4	—	—	13.2	
9月末	10,648	6.5	10,690	6.9	84.7	—	—	13.2	
10月末	10,578	5.8	10,633	6.3	85.1	—	—	13.1	
11月末	10,970	9.7	11,024	10.2	85.2	—	—	13.0	
12月末	10,979	9.8	11,041	10.4	85.2	—	—	13.0	
2024年 1月末	11,215	12.2	11,268	12.7	85.3	—	—	13.2	
2月末	11,358	13.6	11,419	14.2	85.5	—	—	13.0	
3月末	11,502	15.0	11,582	15.8	85.8	—	—	12.8	
(当 期 末) 2024年 4月26日	11,578	15.8	11,634	16.3	85.6	—	—	12.6	

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

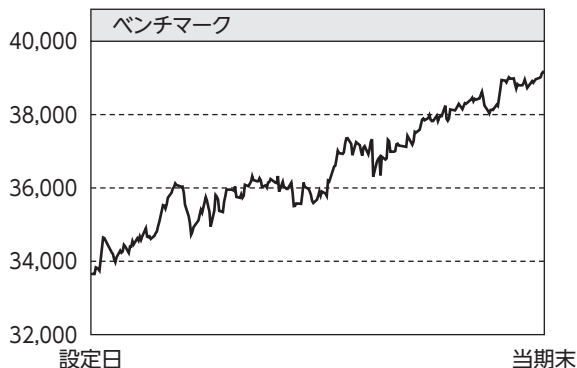


(注)ベンチマークは、2023年4月21日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとはほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月中旬にかけて、主要中央銀行の金融引き締め長期化観測などを背景に上昇（債券価格は下落）しました。同年12月下旬にかけて、主要国の長期金利は、主要先進国のインフレ鈍化を示す指標を受けて、主要中央銀行の利下げ観測が高まったことから低下（債券価格は上昇）しましたが、その後は米国の堅調な経済指標などを背景に上昇しました。

グローバル社債市場では、リスク選好機運の高まりからクレジットスプレッド（国債に対する上乘せ幅）は縮小しました。

外国為替市場では、日本と主要国の中央銀行の金融政策の違いを背景に、主要国通貨は対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

債券ETFを含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

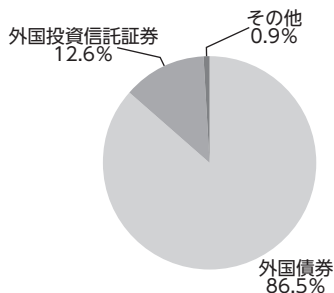
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES MBS ETF	アメリカ	12.6%
2	T 0.25% 10/31/25	アメリカ	0.4%
3	T 3.5% 09/15/25	アメリカ	0.4%
4	T 0.875% 09/30/26	アメリカ	0.3%
5	T 1.25% 04/30/28	アメリカ	0.3%
6	T 2.25% 11/15/27	アメリカ	0.3%

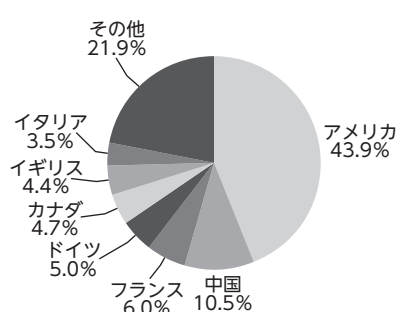
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.3%
8	T 2.25% 11/15/25	アメリカ	0.3%
9	T 0.25% 06/30/25	アメリカ	0.3%
10	CGB 4.08% 10/22/48	中国	0.3%
組入銘柄数			3,093

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

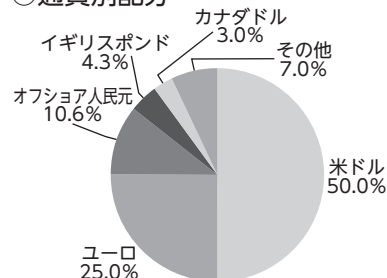
○資産別配分



○国別配分



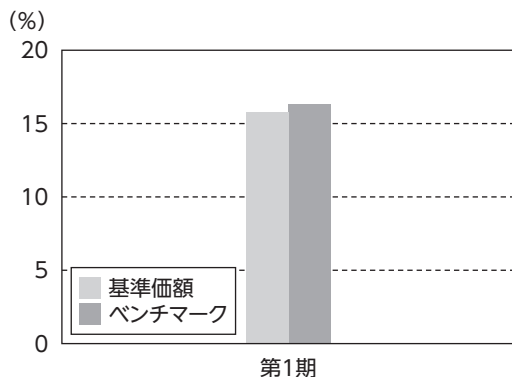
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主なマイナス要因は、売買コスト等です。

今後の運用方針

主としてブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)(以下「ベンチマーク」といいます。)を構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年4月21日~2024年4月26日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.003%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	6	0.059	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(6)	(0.058)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	6	0.062	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,787円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 180,847	千米ドル 23,767
		地 方 債 証 券	4,634	—
		特 殊 債 券	17,281	1,157
		社債券 (投資法人債券を含む)	117,077	3,410 (675)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 13,376	千カナダドル 2,366
		地 方 債 証 券	9,790	196
		特 殊 債 券	4,487	—
		社債券 (投資法人債券を含む)	7,223	292
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 53,288	千メキシコペソ 6,676
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 3,460,637	千コロンビアペソ —
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 25,814	千ユーロ 7,491
		地 方 債 証 券	3,781	—
		特 殊 債 券	5,064	193
		社債券 (投資法人債券を含む)	6,074	90
	イ タ リ ア	国 債 証 券	23,163	2,723
		特 殊 債 券	93	96
社債券 (投資法人債券を含む)		2,855	174	
フ ラ ン ス	国 債 証 券	25,709	2,648	
	特 殊 債 券	2,951	—	
	社債券 (投資法人債券を含む)	12,346	685	
オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,365	225	
	特 殊 債 券	1,219	—	
	社債券 (投資法人債券を含む)	6,827	291	
ス ペ イ ン	国 債 証 券	15,264	851	
	地 方 債 証 券	185	—	
	社債券 (投資法人債券を含む)	3,149	96	
ベ ル ギ ー	国 債 証 券	4,996	144	
	社債券 (投資法人債券を含む)	645	—	
オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	3,505	125	
	特 殊 債 券	174	—	
	社債券 (投資法人債券を含む)	756	95	

		当 期		
		買 付 額	売 付 額	
外	ルクセンブルク	社債券 (投資法人債券を含む)	965	98
	フィンランド	国債証券	1,503	—
		社債券 (投資法人債券を含む)	1,105	99
	アイルランド	国債証券	1,578	91
		社債券 (投資法人債券を含む)	553	—
	ギリシャ	国債証券	910	—
	ポルトガル	国債証券	1,863	—
	その他	国債証券	2,118	—
		地方債証券	1,486	—
		特殊債証券	13,748	193
		社債券 (投資法人債券を含む)	19,828	976
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 21,412	千イギリスポンド 2,225
		特殊債証券	2,265	—
		社債券 (投資法人債券を含む)	5,536	85
	スイス	国債証券	千スイスフラン 4,315	千スイスフラン 175
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 11,748	千スウェーデンクローナ 294
		社債券 (投資法人債券を含む)	25,826	2,918
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 7,979	千ノルウェークローネ 916
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 14,886	千デンマーククローネ 2,644
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 30,880	千チェココルナ 2,513
ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 233,808	千ハンガリーフォリント 14,189	
ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 7,776	千ポーランドズロチ 420	
オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 11,501	千オーストラリアドル 1,403	
	地方債証券	5,733	97	
	特殊債証券	1,792	—	
	社債券 (投資法人債券を含む)	1,386	—	
ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 2,477	千ニュージーランドドル 130	
シンガポール	国債証券	千シンガポールドドル 2,472	千シンガポールドドル 9	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 15,418	千マレーシアリンギット 876	

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	イ 国 債 証 券	千タイバーツ 98,484	千タイバーツ 5,416	
	インドネシア 国 債 証 券	千インドネシアルピア 62,253,291	千インドネシアルピア 506,050	
	韓 国 国 債 証 券	千韓国ウォン 14,019,252	千韓国ウォン 883,478	
国	中国オフショア 国 債 証 券	千オフショア人民元 314,393	千オフショア人民元 19,254	
		特 殊 債 券	298,167	23,693
	イスラエル 国 債 証 券	千イスラエルシェケル 3,912	千イスラエルシェケル -	

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
アメリカ		千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MBS ETF		1,159	105,614	50	4,661
小 計		1,159	105,614	50	4,661

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 115,643	百万円 2,668	% 2.3	百万円 5,112	百万円 1,243	% 24.3
金 銭 信 託	3	3	100.0	3	3	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	156,764	16,625	10.6	156,548	16,577	10.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 325,759	千米ドル 287,962	千円 44,853,044	% 36.7	% —	% 17.9	% 12.6	% 6.2
カ ナ ダ	千カナダドル 34,510	千カナダドル 31,652	3,609,942	3.0	—	1.8	0.8	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 51,470	千メキシコペソ 45,732	414,370	0.3	—	0.2	0.1	0.0
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 3,500,000	千コロンビアペソ 3,397,374	133,625	0.1	—	0.1	0.0	—
ド イ ツ	千ユーロ 36,540	千ユーロ 33,216	5,548,781	4.5	—	2.7	1.5	0.3
イ タ リ ア	25,160	23,844	3,983,161	3.3	—	1.9	0.8	0.5
フ ラ ン ス	42,100	38,192	6,380,015	5.2	—	3.1	1.5	0.6
オ ラ ン ダ	13,450	12,129	2,026,179	1.7	—	0.9	0.4	0.3
ス ペ イ ン	19,290	17,988	3,004,983	2.5	—	1.4	0.7	0.3
ベ ル ギ ー	6,110	5,587	933,451	0.8	—	0.5	0.2	0.1
オーストリア	4,770	4,293	717,268	0.6	—	0.3	0.2	0.0
ルクセンブルク	1,000	894	149,396	0.1	—	0.0	0.1	0.0
フィンランド	2,850	2,557	427,239	0.3	—	0.1	0.2	0.0
アイルランド	2,350	2,080	347,478	0.3	—	0.2	0.1	—
ギ リ シ ャ	850	885	147,913	0.1	—	0.1	0.0	—
ポルトガル	1,980	1,884	314,750	0.3	—	0.2	0.1	0.0
そ の 他	40,842	36,804	6,148,257	5.0	—	2.2	2.1	0.8
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 31,470	千イギリスポンド 26,744	5,208,806	4.3	—	2.7	1.1	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 3,950	千スイスフラン 4,190	714,859	0.6	—	0.4	0.2	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 37,020	千スウェーデンクローナ 34,973	500,126	0.4	—	0.1	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,600	千ノルウェークローネ 7,034	99,964	0.1	—	0.0	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 13,110	千デンマーククローネ 12,384	277,418	0.2	—	0.1	0.0	0.1
チ エ コ	千チェココルナ 31,950	千チェココルナ 29,090	193,290	0.2	—	0.1	0.0	0.0
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 274,000	千ハンガリーフォリント 229,104	97,399	0.1	—	0.0	0.0	0.0

区 分	額 面 金 額	当		期		末		
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,050	千ポーランドズロチ 7,439	千円 288,117	% 0.2	% —	% 0.1	% 0.1	% 0.0
オーストラリア	千オーストラリアドル 20,870	千オーストラリアドル 18,780	1,909,035	1.6	—	0.8	0.5	0.2
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 2,660	千ニュージーランドドル 2,363	219,545	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 2,570	千シンガポールドル 2,405	275,664	0.2	—	0.1	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 14,320	千マレーシアリンギット 14,498	472,298	0.4	—	0.3	0.1	0.0
タイ	千タイバーツ 97,300	千タイバーツ 93,723	394,576	0.3	—	0.2	0.1	0.0
インドネシア	千インドネシアルピア 61,200,000	千インドネシアルピア 60,646,459	588,270	0.5	—	0.3	0.1	0.1
韓国	千韓国ウォン 14,400,000	千韓国ウォン 13,434,402	1,524,804	1.2	—	0.8	0.3	0.2
中国オフショア	千オフショア人民元 556,100	千オフショア人民元 586,162	12,574,879	10.3	—	5.2	3.5	1.6
イスラエル	千イスラエルシェケル 4,390	千イスラエルシェケル 3,819	156,316	0.1	—	0.1	0.0	0.0
合 計	—	—	104,635,236	85.6	—	45.1	27.9	12.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
ADGB 1.625% 06/02/28	1.625	200	174	27,159	2028/6/2
CANADA 0.75% 05/19/26	0.75	200	183	28,576	2026/5/19
CHILE 2.55% 07/27/33	2.55	200	157	24,480	2033/7/27
CHILE 2.75% 01/31/27	2.75	200	185	28,906	2027/1/31
CHILE 4% 01/31/52	4.0	200	148	23,086	2052/1/31
CHILE 4.34% 03/07/42	4.34	200	165	25,848	2042/3/7
HKINTL 4.5% 01/11/28	4.5	200	197	30,795	2028/1/11
HKINTL 4.625% 01/11/33	4.625	200	197	30,746	2033/1/11
INDON 2.85% 02/14/30	2.85	200	174	27,222	2030/2/14
INDON 3.35% 03/12/71	3.35	200	123	19,204	2071/3/12
INDON 4.3% 03/31/52	4.3	200	159	24,889	2052/3/31
INDON 4.35% 01/11/48	4.35	200	163	25,458	2048/1/11
ISRAEL 4.5% 01/17/33	4.5	200	177	27,648	2033/1/17
ITALY 1.25% 02/17/26	1.25	200	184	28,799	2026/2/17
ITALY 3.875% 05/06/51	3.875	200	134	20,925	2051/5/6
KOREA 2.5% 06/19/29	2.5	200	177	27,665	2029/6/19
KSA 2.9% 10/22/25	2.9	200	192	30,013	2025/10/22
KSA 3.45% 02/02/61	3.45	200	122	19,113	2061/2/2
KSA 4.5% 10/26/46	4.5	200	161	25,135	2046/10/26
KSA 4.875% 07/18/33	4.875	200	190	29,707	2033/7/18
KSA 5% 01/18/53	5.0	200	167	26,128	2053/1/18
MEX 3.25% 04/16/30	3.25	200	173	27,005	2030/4/16
MEX 3.75% 04/19/71	3.75	200	118	18,387	2071/4/19
MEX 4.28% 08/14/41	4.28	200	152	23,772	2041/8/14
MEX 4.4% 02/12/52	4.4	200	143	22,353	2052/2/12
MEX 4.75% 04/27/32	4.75	200	182	28,496	2032/4/27
MEX 6.4% 05/07/54	6.4	200	187	29,254	2054/5/7
PANAMA 2.252% 09/29/32	2.252	200	138	21,548	2032/9/29
PANAMA 6.4% 02/14/35	6.4	200	183	28,617	2035/2/14
PERU 2.392% 01/23/26	2.392	200	189	29,457	2026/1/23
PERU 3.3% 03/11/41	3.3	200	142	22,166	2041/3/11
PHILIP 3.229% 03/29/27	3.229	200	188	29,436	2027/3/29
PHILIP 4.2% 03/29/47	4.2	200	159	24,794	2047/3/29
PHILIP 5.17% 10/13/27	5.17	200	198	30,948	2027/10/13
PHILIP 5.5% 01/17/48	5.5	200	192	29,986	2048/1/17
POLAND 5.5% 11/16/27	5.5	200	201	31,364	2027/11/16
QATAR 3.75% 04/16/30	3.75	200	186	29,115	2030/4/16
QATAR 4.817% 03/14/49	4.817	200	176	27,498	2049/3/14
REPHUN 5.5% 03/26/36	5.5	400	371	57,884	2036/3/26
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,000	947	147,643	2025/5/31
T 0.25% 06/30/25	0.25	2,500	2,361	367,777	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	2,069	322,366	2025/7/31
T 0.25% 08/31/25	0.25	1,000	937	145,958	2025/8/31
T 0.25% 09/30/25	0.25	2,000	1,866	290,796	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,350	3,116	485,351	2025/10/31
T 0.375% 12/31/25	0.375	1,000	925	144,102	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	1,450	1,335	207,973	2026/2/28
T 0.5% 10/31/27	0.5	1,000	861	134,239	2027/10/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 0.625% 05/15/30	0.625	1,000	786	122,457	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	1,400	1,271	198,106	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	1,000	778	121,282	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	1,200	1,035	161,339	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	2,000	1,720	268,016	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	1,000	861	134,260	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	450	415	64,662	2026/3/31
T 0.75% 05/31/26	0.75	1,000	916	142,766	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	1,000	908	141,461	2026/8/31
T 0.875% 09/30/26	0.875	3,000	2,725	424,567	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	1,400	1,101	171,512	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	2,470	2,114	329,400	2028/7/31
T 1.125% 02/15/31	1.125	1,000	795	123,911	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	1,000	872	135,873	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	500	292	45,571	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	300	173	27,071	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	1,600	1,373	213,989	2028/8/31
T 1.125% 10/31/26	1.125	1,000	911	141,969	2026/10/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	1,000	874	136,183	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	3,000	2,616	407,510	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	400	187	29,258	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	1,050	913	142,289	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	1,050	911	141,948	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	3,200	2,523	393,011	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	1,250	1,076	167,708	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	1,000	911	142,051	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	2,000	1,819	283,458	2026/12/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	950	460	71,760	2050/8/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	1,600	1,382	215,362	2028/10/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	850	671	104,551	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	300	180	28,158	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	1,000	860	133,956	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	1,600	1,461	227,677	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	500	418	65,261	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	1,000	925	144,169	2026/8/15
T 1.625% 02/15/26	1.625	1,000	941	146,621	2026/2/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	1,000	816	127,254	2031/5/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	1,000	519	80,910	2050/11/15
T 1.75% 01/31/29	1.75	2,300	2,009	312,970	2029/1/31
T 1.75% 08/15/41	1.75	400	252	39,341	2041/8/15
T 1.875% 02/15/32	1.875	1,000	815	127,099	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	500	326	50,918	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	800	444	69,164	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	1,000	921	143,487	2027/2/28
T 1.875% 02/28/29	1.875	1,000	877	136,655	2029/2/28
T 1.875% 06/30/26	1.875	160	149	23,354	2026/6/30
T 1.875% 11/15/51	1.875	1,300	716	111,581	2051/11/15
T 2% 02/15/50	2.0	1,050	607	94,685	2050/2/15
T 2% 08/15/25	2.0	1,000	960	149,657	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	900	513	80,014	2051/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 2% 11/15/26	2.0	1,300	1,210	188,527	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	350	229	35,824	2041/11/15
T 2.25% 02/15/27	2.25	1,000	932	145,179	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	500	303	47,202	2052/2/15
T 2.25% 05/15/41	2.25	260	180	28,075	2041/5/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	300	190	29,748	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	1,100	679	105,833	2049/8/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,500	2,394	372,972	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	2,800	2,567	399,908	2027/11/15
T 2.375% 02/15/42	2.375	200	139	21,729	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	700	627	97,802	2029/3/31
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,000	1,861	289,871	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	2,000	1,790	278,877	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	1,450	909	141,730	2051/5/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	800	507	79,077	2049/11/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	900	614	95,746	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	800	539	84,022	2046/2/15
T 2.5% 03/31/27	2.5	1,900	1,779	277,198	2027/3/31
T 2.5% 05/15/46	2.5	700	470	73,289	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	2,000	1,918	298,827	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	1,500	1,364	212,575	2029/2/15
T 2.625% 05/31/27	2.625	500	468	72,948	2027/5/31
T 2.625% 07/31/29	2.625	800	722	112,509	2029/7/31
T 2.75% 04/30/27	2.75	1,000	941	146,669	2027/4/30
T 2.75% 05/15/25	2.75	1,000	975	151,888	2025/5/15
T 2.75% 05/31/29	2.75	1,620	1,475	229,862	2029/5/31
T 2.75% 08/15/32	2.75	800	692	107,888	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	200	147	22,946	2042/8/15
T 2.75% 08/31/25	2.75	630	610	95,108	2025/8/31
T 2.75% 11/15/42	2.75	200	146	22,860	2042/11/15
T 2.875% 04/30/29	2.875	620	568	88,619	2029/4/30
T 2.875% 05/15/32	2.875	800	701	109,311	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	300	223	34,803	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	700	495	77,133	2049/5/15
T 2.875% 05/15/52	2.875	600	419	65,375	2052/5/15
T 2.875% 06/15/25	2.875	500	487	75,911	2025/6/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	820	596	92,943	2045/8/15
T 2.875% 11/15/46	2.875	600	431	67,215	2046/11/15
T 3% 02/15/47	3.0	300	220	34,318	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	150	109	17,041	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	100	72	11,304	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	600	461	71,855	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	770	574	89,433	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	220	161	25,123	2047/5/15
T 3% 07/15/25	3.0	1,000	974	151,853	2025/7/15
T 3% 08/15/48	3.0	300	218	33,979	2048/8/15
T 3% 08/15/52	3.0	800	574	89,459	2052/8/15
T 3% 11/15/44	3.0	750	561	87,526	2044/11/15
T 3% 11/15/45	3.0	200	148	23,131	2045/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	200	157	24,505	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	300	233	36,323	2043/2/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 3.125% 05/15/48	3.125	200	149	23,225	2048/5/15
T 3.125% 08/15/25	3.125	2,000	1,949	303,689	2025/8/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	600	460	71,680	2044/8/15
T 3.125% 08/31/27	3.125	1,000	947	147,643	2027/8/31
T 3.125% 08/31/29	3.125	1,000	924	144,047	2029/8/31
T 3.125% 11/15/28	3.125	1,500	1,400	218,188	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	500	394	61,479	2041/11/15
T 3.25% 05/15/42	3.25	920	735	114,555	2042/5/15
T 3.25% 06/30/27	3.25	1,000	953	148,592	2027/6/30
T 3.25% 06/30/29	3.25	2,000	1,864	290,443	2029/6/30
T 3.375% 05/15/33	3.375	1,500	1,353	210,814	2033/5/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	300	240	37,387	2044/5/15
T 3.375% 08/15/42	3.375	300	243	37,957	2042/8/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	150	116	18,207	2048/11/15
T 3.5% 02/15/33	3.5	1,950	1,780	277,345	2033/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	400	346	54,036	2039/2/15
T 3.5% 09/15/25	3.5	3,000	2,934	457,140	2025/9/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	600	499	77,816	2044/2/15
T 3.625% 02/15/53	3.625	820	666	103,824	2053/2/15
T 3.625% 05/15/53	3.625	1,000	813	126,643	2053/5/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	350	292	45,520	2043/8/15
T 3.75% 06/30/30	3.75	1,150	1,090	169,779	2030/6/30
T 3.75% 11/15/43	3.75	300	254	39,689	2043/11/15
T 3.75% 12/31/28	3.75	1,600	1,533	238,921	2028/12/31
T 3.875% 02/15/43	3.875	300	261	40,657	2043/2/15
T 3.875% 05/15/43	3.875	1,000	868	135,286	2043/5/15
T 3.875% 08/15/33	3.875	2,000	1,874	292,001	2033/8/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	600	534	83,183	2040/8/15
T 3.875% 12/31/29	3.875	250	239	37,291	2029/12/31
T 4% 02/28/30	4.0	1,500	1,444	224,924	2030/2/28
T 4% 10/31/29	4.0	900	868	135,225	2029/10/31
T 4% 11/15/42	4.0	1,000	887	138,230	2042/11/15
T 4% 11/15/52	4.0	840	732	114,107	2052/11/15
T 4.125% 07/31/28	4.125	750	731	113,954	2028/7/31
T 4.125% 08/15/53	4.125	790	703	109,620	2053/8/15
T 4.125% 09/30/27	4.125	2,100	2,054	319,953	2027/9/30
T 4.125% 11/15/32	4.125	1,000	958	149,334	2032/11/15
T 4.25% 02/28/31	4.25	1,100	1,069	166,651	2031/2/28
T 4.25% 05/15/39	4.25	500	471	73,379	2039/5/15
T 4.25% 10/15/25	4.25	1,100	1,086	169,254	2025/10/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	500	465	72,446	2040/11/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	230	216	33,739	2041/5/15
T 4.375% 08/15/43	4.375	800	744	115,885	2043/8/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	300	285	44,478	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	550	546	85,052	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	300	293	45,652	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	300	290	45,199	2039/8/15
T 4.5% 11/15/25	4.5	2,000	1,981	308,672	2025/11/15
T 4.5% 11/15/33	4.5	1,100	1,082	168,565	2033/11/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	500	489	76,197	2040/2/15
T 4.625% 09/30/30	4.625	1,760	1,749	272,525	2030/9/30

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 4.625% 11/15/26	4.625	1,600	1,589	247,531	2026/11/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	200	197	30,755	2041/2/15
T 4.75% 11/15/43	4.75	700	683	106,527	2043/11/15
T 4.75% 11/15/53	4.75	1,000	990	154,226	2053/11/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	100	103	16,098	2037/5/15
UAE 4.917% 09/25/33	4.917	200	197	30,810	2033/9/25
UAE 4.951% 07/07/52	4.951	200	180	28,056	2052/7/7
URUGUA 4.375% 10/27/27	4.375	100	98	15,361	2027/10/27
URUGUA 5.75% 10/28/34	5.75	200	203	31,723	2034/10/28
地方債証券					
ALTA 1.3% 07/22/30	1.3	200	160	25,053	2030/7/22
ALTA 3.3% 03/15/28	3.3	200	188	29,313	2028/3/15
ALTA 4.5% 01/24/34	4.5	200	191	29,773	2034/1/24
BRCOL 0.9% 07/20/26	0.9	100	91	14,204	2026/7/20
BRCOL 1.3% 01/29/31	1.3	100	79	12,371	2031/1/29
BRCOL 4.2% 07/06/33	4.2	500	468	72,969	2033/7/6
CADEPO 0.875% 06/10/25	0.875	250	237	37,067	2025/6/10
CADEPO 4.5% 02/13/26	4.5	250	246	38,420	2026/2/13
KOMMUN 3.75% 05/24/28	3.75	200	190	29,714	2028/5/24
MP 1.5% 10/25/28	1.5	200	172	26,827	2028/10/25
MP 4.3% 07/27/33	4.3	300	282	44,067	2033/7/27
NBRNS 3.625% 02/24/28	3.625	100	94	14,763	2028/2/24
ONT 1.125% 10/07/30	1.125	200	157	24,575	2030/10/7
ONT 1.6% 02/25/31	1.6	200	161	25,129	2031/2/25
ONT 1.8% 10/14/31	1.8	200	160	25,006	2031/10/14
ONT 2.125% 01/21/32	2.125	400	326	50,910	2032/1/21
ONT 5.05% 04/24/34	5.05	200	199	31,072	2034/4/24
Q 1.35% 05/28/30	1.35	300	243	37,979	2030/5/28
Q 1.9% 04/21/31	1.9	300	245	38,302	2031/4/21
Q 4.5% 09/08/33	4.5	400	383	59,695	2033/9/8
SCDA 3.25% 06/08/27	3.25	300	284	44,315	2027/6/8
特殊債券 (除く金融債)					
AFDB 0.875% 07/22/26	0.875	100	91	14,204	2026/7/22
AFDB 4.375% 03/14/28	4.375	100	98	15,286	2028/3/14
AFDB 5.75% PERP	5.75	200	188	29,317	—
AGFRNC 4.5% 02/17/26	4.5	200	197	30,696	2026/2/17
AIIB 0.5% 01/27/26	0.5	100	92	14,364	2026/1/27
AIIB 0.5% 05/28/25	0.5	200	189	29,543	2025/5/28
ASIA 0.5% 02/04/26	0.5	200	184	28,731	2026/2/4
ASIA 1% 04/14/26	1.0	100	92	14,393	2026/4/14
ASIA 1.75% 09/19/29	1.75	100	85	13,314	2029/9/19
ASIA 1.875% 01/24/30	1.875	200	170	26,550	2030/1/24
ASIA 3.75% 04/25/28	3.75	200	192	29,908	2028/4/25
ASIA 3.875% 09/28/32	3.875	100	93	14,543	2032/9/28
ASIA 4% 01/12/33	4.0	100	93	14,641	2033/1/12
BNG 0.875% 05/18/26	0.875	200	183	28,598	2026/5/18
CADES 1.375% 01/20/31	1.375	200	159	24,845	2031/1/20
CADES 3.75% 05/24/28	3.75	200	191	29,783	2028/5/24
CADES 4% 01/25/26	4.0	300	294	45,822	2026/1/25
CADES 4.625% 11/02/25	4.625	200	198	30,849	2025/11/2
CAF 4.75% 04/01/26	4.75	100	97	15,216	2026/4/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
COE 3% 06/16/25	3.0	100	97	15,168	2025/6/16
COE 3.625% 01/26/28	3.625	100	95	14,894	2028/1/26
DBJJP 1.25% 10/20/26	1.25	300	272	42,434	2026/10/20
DBJJP 4.375% 09/22/25	4.375	200	196	30,658	2025/9/22
DBJJP 4.5% 01/30/34	4.5	200	191	29,847	2034/1/30
EBRD 4.375% 03/09/28	4.375	100	98	15,302	2028/3/9
EDC 3.375% 08/26/25	3.375	200	195	30,395	2025/8/26
EIB 0.375% 03/26/26	0.375	500	457	71,275	2026/3/26
EIB 1.375% 03/15/27	1.375	400	362	56,427	2027/3/15
EIB 1.75% 03/15/29	1.75	100	86	13,517	2029/3/15
EIBKOR 1.25% 09/21/30	1.25	200	156	24,410	2030/9/21
EIBKOR 2.5% 06/29/41	2.5	200	135	21,045	2041/6/29
EIBKOR 5% 01/11/28	5.0	200	198	30,938	2028/1/11
ESM 0.375% 09/10/25	0.375	200	187	29,166	2025/9/10
FPCB 4.625% 04/10/26	4.625	500	495	77,223	2026/4/10
FPCB 6.08% 04/28/33	6.08	500	500	77,884	2033/4/28
FHLB 0.96% 03/05/26	0.96	200	185	28,898	2026/3/5
FNMA 0.56% 11/17/25	0.56	200	186	29,008	2025/11/17
FNMA 0.75% 10/08/27	0.75	200	174	27,138	2027/10/8
FNMA 1.875% 09/24/26	1.875	100	93	14,495	2026/9/24
FNMA 5.625% 07/15/37	5.625	200	212	33,035	2037/7/15
FNMA 7.125% 01/15/30	7.125	200	223	34,741	2030/1/15
IADB 0.875% 04/20/26	0.875	100	92	14,349	2026/4/20
IADB 1.125% 01/13/31	1.125	100	78	12,293	2031/1/13
IADB 3.5% 09/14/29	3.5	100	93	14,593	2029/9/14
IADB 4.375% 01/24/44	4.375	200	180	28,161	2044/1/24
IADB 4.5% 05/15/26	4.5	200	197	30,810	2026/5/15
IADB 4.5% 09/13/33	4.5	200	194	30,327	2033/9/13
IBRD 0.5% 10/28/25	0.5	200	186	29,047	2025/10/28
IBRD 0.875% 07/15/26	0.875	100	91	14,234	2026/7/15
IBRD 1.125% 09/13/28	1.125	200	170	26,621	2028/9/13
IBRD 1.375% 04/20/28	1.375	100	87	13,638	2028/4/20
IBRD 3.125% 06/15/27	3.125	500	474	73,905	2027/6/15
IBRD 3.5% 07/12/28	3.5	100	94	14,785	2028/7/12
IDBINV 4.125% 02/15/28	4.125	100	96	15,082	2028/2/15
IFC 0.375% 07/16/25	0.375	200	188	29,368	2025/7/16
IFC 0.75% 08/27/30	0.75	100	77	12,147	2030/8/27
IFC 3.625% 09/15/25	3.625	100	97	15,242	2025/9/15
JBIC 0.625% 07/15/25	0.625	200	188	29,402	2025/7/15
JBIC 2.75% 01/21/26	2.75	200	191	29,840	2026/1/21
JBIC 4.25% 01/26/26	4.25	200	196	30,601	2026/1/26
JBIC 4.25% 04/27/26	4.25	300	294	45,858	2026/4/27
JBIC 4.375% 10/05/27	4.375	200	195	30,483	2027/10/5
JICA 3.25% 05/25/27	3.25	200	189	29,440	2027/5/25
KBN 4% 01/19/28	4.0	200	193	30,106	2028/1/19
KBN 4.625% 10/24/25	4.625	200	197	30,836	2025/10/24
KDB 4.25% 09/08/32	4.25	200	186	28,997	2032/9/8
KFW 0.75% 09/30/30	0.75	100	78	12,162	2030/9/30
KFW 1% 10/01/26	1.0	500	455	70,912	2026/10/1
KFW 3.625% 04/01/26	3.625	100	97	15,167	2026/4/1
KFW 3.75% 02/15/28	3.75	200	192	29,989	2028/2/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
KFW 4.125% 07/15/33	4.125	300	284	44,286	2033/7/15
KOHNPW 1.25% 04/27/26	1.25	200	183	28,617	2026/4/27
KORELE 5.375% 07/31/26	5.375	200	199	31,046	2026/7/31
KORGAS 1.125% 07/13/26	1.125	200	182	28,349	2026/7/13
LBANK 1.375% 10/12/28	1.375	100	85	13,382	2028/10/12
NEDFIN 4.75% 11/15/28	4.75	200	198	30,854	2028/11/15
NEDWBK 1% 05/28/30	1.0	200	159	24,771	2030/5/28
NEDWBK 4% 06/01/28	4.0	200	193	30,066	2028/6/1
NIB 3.375% 09/08/27	3.375	200	190	29,651	2027/9/8
NIB 4.25% 02/28/29	4.25	200	195	30,380	2029/2/28
OKB 3.625% 09/09/27	3.625	200	191	29,896	2027/9/9
OKB 4.125% 01/20/26	4.125	100	98	15,306	2026/1/20
OKB 4.625% 11/03/25	4.625	200	198	30,862	2025/11/3
SDBC 2% 02/16/27	2.0	200	184	28,778	2027/2/16
SEK 2.25% 03/22/27	2.25	200	184	28,802	2027/3/22
TVA 3.875% 03/15/28	3.875	200	193	30,115	2028/3/15
TVA 4.25% 09/15/65	4.25	100	81	12,637	2065/9/15
TVA 7.125% 05/01/30	7.125	200	223	34,746	2030/5/1
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AAPL 0.7% 02/08/26	0.7	100	92	14,405	2026/2/8
AAPL 1.4% 08/05/28	1.4	100	86	13,451	2028/8/5
AAPL 2.65% 05/11/50	2.65	100	61	9,556	2050/5/11
AAPL 2.7% 08/05/51	2.7	200	122	19,090	2051/8/5
AAPL 3.35% 08/08/32	3.35	100	88	13,795	2032/8/8
AAPL 3.75% 11/13/47	3.75	100	76	11,988	2047/11/13
AAPL 4.1% 08/08/62	4.1	200	156	24,332	2062/8/8
AAPL 4.421% 05/08/26	4.421	200	197	30,813	2026/5/8
ABBV 4.45% 05/14/46	4.45	100	84	13,159	2046/5/14
ABBV 5.35% 03/15/44	5.35	200	192	29,990	2044/3/15
ABC 2.7% 03/15/31	2.7	100	83	12,997	2031/3/15
ABIBB 4% 04/13/28	4.0	100	96	14,986	2028/4/13
ABIBB 4.7% 02/01/36	4.7	100	92	14,435	2036/2/1
ABIBB 4.9% 02/01/46	4.9	100	89	13,937	2046/2/1
ABIBB 5% 06/15/34	5.0	200	193	30,074	2034/6/15
ABIBB 5.55% 01/23/49	5.55	100	97	15,249	2049/1/23
ABIBB 5.8% 01/23/59	5.8	100	100	15,685	2059/1/23
ABNAV 2.47% 12/13/29	2.47	200	172	26,842	2029/12/13
ABNAV 3.324% 03/13/37	3.324	200	160	24,949	2037/3/13
ABT 1.15% 01/30/28	1.15	100	86	13,545	2028/1/30
ABT 1.4% 06/30/30	1.4	100	81	12,629	2030/6/30
ACAPF 1.907% 06/16/26	1.907	250	238	37,205	2026/6/16
ACGL 3.635% 06/30/50	3.635	100	68	10,732	2050/6/30
ABDE 2.15% 02/01/27	2.15	100	92	14,405	2027/2/1
ADM 4.5% 08/15/33	4.5	100	92	14,463	2033/8/15
AEE 1.95% 03/15/27	1.95	100	90	14,137	2027/3/15
AEE 3.9% 04/01/52	3.9	100	74	11,599	2052/4/1
AEE 5.2% 04/01/34	5.2	200	193	30,110	2034/4/1
AEP 3.75% 07/01/47	3.75	100	71	11,107	2047/7/1
AEP 5.625% 04/01/53	5.625	200	191	29,773	2053/4/1
AER 1.75% 01/30/26	1.75	150	139	21,775	2026/1/30
AER 2.45% 10/29/26	2.45	150	138	21,589	2026/10/29

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AER 3.4% 10/29/33	3.4	150	121	18,963	2033/10/29
AER 3.85% 10/29/41	3.85	150	112	17,486	2041/10/29
AES 1.375% 01/15/26	1.375	100	92	14,414	2026/1/15
APL 1.125% 03/15/26	1.125	100	92	14,380	2026/3/15
AGR 3.8% 06/01/29	3.8	100	91	14,256	2029/6/1
AIA 5.625% 10/25/27	5.625	200	201	31,428	2027/10/25
AIG 3.4% 06/30/30	3.4	200	178	27,770	2030/6/30
AIRFP 3.95% 04/10/47	3.95	150	118	18,434	2047/4/10
AJG 5.5% 03/02/33	5.5	100	97	15,234	2033/3/2
AL 2.875% 01/15/26	2.875	100	95	14,822	2026/1/15
AL 3.125% 12/01/30	3.125	100	85	13,320	2030/12/1
AL 5.3% 02/01/28	5.3	100	98	15,322	2028/2/1
ALL 1.45% 12/15/30	1.45	100	77	12,008	2030/12/15
ALLY 4.75% 06/09/27	4.75	100	96	14,978	2027/6/9
AMG 3.3% 06/15/30	3.3	100	87	13,582	2030/6/15
AMGN 3.15% 02/21/40	3.15	100	72	11,299	2040/2/21
AMGN 3.375% 02/21/50	3.375	200	135	21,171	2050/2/21
AMGN 5.15% 03/02/28	5.15	100	99	15,430	2028/3/2
AMGN 5.507% 03/02/26	5.507	200	199	31,094	2026/3/2
AMGN 5.6% 03/02/43	5.6	200	192	29,913	2043/3/2
AMGN 5.75% 03/02/63	5.75	100	94	14,792	2063/3/2
AMP 5.15% 05/15/33	5.15	100	97	15,241	2033/5/15
AMT 1.6% 04/15/26	1.6	100	92	14,409	2026/4/15
AMT 1.875% 10/15/30	1.875	100	79	12,324	2030/10/15
AMT 2.95% 01/15/51	2.95	100	59	9,327	2051/1/15
AMT 3.8% 08/15/29	3.8	100	91	14,201	2029/8/15
AMT 5.65% 03/15/33	5.65	100	98	15,291	2033/3/15
AMXLMM 2.875% 05/07/30	2.875	200	171	26,780	2030/5/7
AMZN 3.875% 08/22/37	3.875	100	85	13,355	2037/8/22
AMZN 4.05% 08/22/47	4.05	100	81	12,675	2047/8/22
AMZN 4.25% 08/22/57	4.25	100	80	12,608	2057/8/22
AMZN 4.55% 12/01/27	4.55	100	98	15,343	2027/12/1
AMZN 4.6% 12/01/25	4.6	200	198	30,873	2025/12/1
AMZN 4.7% 12/01/32	4.7	200	194	30,218	2032/12/1
AN 1.95% 08/01/28	1.95	100	85	13,252	2028/8/1
ANZNZ 3.45% 01/21/28	3.45	200	186	29,044	2028/1/21
AON 3.875% 12/15/25	3.875	100	97	15,161	2025/12/15
APD 2.05% 05/15/30	2.05	100	83	13,033	2030/5/15
APD 2.7% 05/15/40	2.7	100	68	10,722	2040/5/15
APH 4.75% 03/30/26	4.75	100	98	15,380	2026/3/30
ARE 2.75% 12/15/29	2.75	100	86	13,408	2029/12/15
ARE 3.55% 03/15/52	3.55	100	65	10,175	2052/3/15
ARE 4.75% 04/15/35	4.75	100	90	14,152	2035/4/15
ATH 3.95% 05/25/51	3.95	100	69	10,873	2051/5/25
ATH 5.875% 01/15/34	5.875	200	194	30,306	2034/1/15
ATH 6.15% 04/03/30	6.15	100	101	15,837	2030/4/3
ATO 5.75% 10/15/52	5.75	100	99	15,511	2052/10/15
ATO 6.2% 11/15/53	6.2	100	105	16,468	2053/11/15
AVB 1.9% 12/01/28	1.9	100	86	13,434	2028/12/1
AVGO 1.95% 02/15/28	1.95	100	87	13,691	2028/2/15
AVGO 3.137% 11/15/35	3.137	200	154	24,131	2035/11/15

銘柄	利率 (%)	当 期		末		
		額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
AVGO 3.469% 04/15/34	3.469	200	165	25,754	2034/4/15	
AVGO 4.15% 04/15/32	4.15	100	90	14,022	2032/4/15	
AVOL 5.75% 03/01/29	5.75	200	196	30,542	2029/3/1	
AXP 2.55% 03/04/27	2.55	100	92	14,401	2027/3/4	
AXP 5.625% 07/28/34	5.625	200	195	30,446	2034/7/28	
AZN 0.7% 04/08/26	0.7	100	91	14,278	2026/4/8	
AZN 4.875% 03/03/33	4.875	100	96	15,038	2033/3/3	
AZO 4% 04/15/30	4.0	100	92	14,411	2030/4/15	
BA 2.196% 02/04/26	2.196	100	93	14,514	2026/2/4	
BA 2.75% 02/01/26	2.75	200	188	29,375	2026/2/1	
BA 3.25% 02/01/28	3.25	200	180	28,085	2028/2/1	
BA 3.25% 02/01/35	3.25	100	74	11,619	2035/2/1	
BA 5.15% 05/01/30	5.15	100	94	14,678	2030/5/1	
BA 5.805% 05/01/50	5.805	100	87	13,669	2050/5/1	
BABA 2.125% 02/09/31	2.125	200	161	25,165	2031/2/9	
BAC 1.734% 07/22/27	1.734	100	91	14,287	2027/7/22	
BAC 1.898% 07/23/31	1.898	100	79	12,436	2031/7/23	
BAC 2.087% 06/14/29	2.087	100	86	13,537	2029/6/14	
BAC 2.572% 10/20/32	2.572	100	80	12,558	2032/10/20	
BAC 2.676% 06/19/41	2.676	100	67	10,499	2041/6/19	
BAC 2.687% 04/22/32	2.687	200	164	25,584	2032/4/22	
BAC 3.483% 03/13/32	3.483	100	69	10,758	2052/3/13	
BAC 3.5% 04/19/26	3.5	100	96	15,032	2026/4/19	
BAC 3.946% 01/23/49	3.946	300	229	35,799	2049/1/23	
BAC 4.083% 03/20/51	4.083	100	76	11,958	2051/3/20	
BAC 4.827% 07/22/26	4.827	200	197	30,752	2026/7/22	
BAC 5.08% 01/20/27	5.08	500	494	77,017	2027/1/20	
BAC 5.468% 01/23/35	5.468	200	194	30,257	2035/1/23	
BACR 5.088% 06/20/30	5.088	200	188	29,339	2030/6/20	
BACR 7.385% 11/02/28	7.385	200	209	32,563	2028/11/2	
BALN 3.4% 04/15/30	3.4	200	178	27,748	2030/4/15	
BATSLN 1.668% 03/25/26	1.668	100	92	14,461	2026/3/25	
BATSLN 3.734% 09/25/40	3.734	100	72	11,241	2040/9/25	
BATSLN 4.54% 08/15/47	4.54	100	74	11,533	2047/8/15	
BATSLN 7.75% 10/19/32	7.75	200	220	34,347	2032/10/19	
BAX 1.915% 02/01/27	1.915	100	90	14,133	2027/2/1	
BAYGR 4.4% 07/15/44	4.4	200	147	23,050	2044/7/15	
BAYGR 4.7% 07/15/64	4.7	100	69	10,750	2064/7/15	
BCECN 2.15% 02/15/32	2.15	100	78	12,192	2032/2/15	
BDX 4.298% 08/22/32	4.298	100	91	14,278	2032/8/22	
BDX 4.693% 02/13/28	4.693	100	97	15,150	2028/2/13	
BFB 4.75% 04/15/33	4.75	100	95	14,901	2033/4/15	
BFCM 4.753% 07/13/27	4.753	200	195	30,417	2027/7/13	
BFCM 4.935% 01/26/26	4.935	200	197	30,797	2026/1/26	
BG 2.75% 05/14/31	2.75	100	83	13,015	2031/5/14	
BHF 5.625% 05/15/30	5.625	100	98	15,409	2030/5/15	
BHI 4.08% 12/15/47	4.08	100	77	12,043	2047/12/15	
BHP 4.75% 02/28/28	4.75	100	98	15,303	2028/2/28	
BIIB 3.15% 05/01/50	3.15	100	62	9,684	2050/5/1	
BK 4.414% 07/24/26	4.414	100	98	15,349	2026/7/24	
BK 4.596% 07/26/30	4.596	100	96	14,972	2030/7/26	

銘柄	利率 (%)	当 期		末		
		額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
BK 4.947% 04/26/27	4.947	200	197	30,833	2027/4/26	
BK 5.834% 10/25/33	5.834	100	101	15,784	2033/10/25	
BKH 3.05% 10/15/29	3.05	200	175	27,281	2029/10/15	
BKH 3.875% 10/15/49	3.875	100	69	10,749	2049/10/15	
BKH 6.15% 05/15/34	6.15	200	199	31,052	2034/5/15	
BKNG 4.625% 04/13/30	4.625	100	96	14,991	2030/4/13	
BLK 1.9% 01/28/31	1.9	100	80	12,605	2031/1/28	
BMO 0.949% 01/22/27	0.949	100	92	14,414	2027/1/22	
BMO 4.7% 09/14/27	4.7	100	97	15,222	2027/9/14	
BMW 3.45% 04/01/27	3.45	100	94	14,791	2027/4/1	
BMY 2.95% 03/15/32	2.95	100	84	13,157	2032/3/15	
BMY 3.55% 03/15/42	3.55	200	151	23,659	2042/3/15	
BMY 4.25% 10/26/49	4.25	100	79	12,424	2049/10/26	
BMY 4.625% 05/15/44	4.625	100	86	13,473	2044/5/15	
BMY 4.9% 02/22/29	4.9	200	197	30,690	2029/2/22	
BNP 1.904% 09/30/28	1.904	200	176	27,455	2028/9/30	
BNP 2.159% 09/15/29	2.159	200	171	26,702	2029/9/15	
BNP 5.738% 02/20/35	5.738	200	194	30,333	2035/2/20	
BNS 4.588% 05/04/37	4.588	100	88	13,726	2037/5/4	
BNS 4.75% 02/02/26	4.75	200	197	30,751	2026/2/2	
BNSF 2.875% 06/15/52	2.875	100	61	9,523	2052/6/15	
BNSF 3.05% 02/15/51	3.05	100	64	9,995	2051/2/15	
BNSF 4.05% 06/15/48	4.05	100	78	12,249	2048/6/15	
BOCAVI 2.625% 09/17/30	2.625	200	168	26,321	2030/9/17	
BOCAVI 4.875% 05/03/33	4.875	200	190	29,632	2033/5/3	
BOCAVI 1.652% 10/06/26	1.652	250	234	36,525	2026/10/6	
BPCEGP 3.116% 10/19/32	3.116	250	200	31,283	2032/10/19	
BPLN 3.001% 03/17/52	3.001	100	62	9,786	2052/3/17	
BPLN 3.06% 06/17/41	3.06	100	71	11,158	2041/6/17	
BPLN 3.543% 04/06/27	3.543	100	95	14,853	2027/4/6	
BPLN 4.893% 09/11/33	4.893	100	95	14,907	2033/9/11	
BRK 2.3% 03/15/27	2.3	100	93	14,493	2027/3/15	
BRK 2.875% 03/15/32	2.875	100	85	13,292	2032/3/15	
BRKHEC 2.85% 05/15/51	2.85	100	59	9,288	2051/5/15	
BRKHEC 3.65% 04/15/29	3.65	100	92	14,477	2029/4/15	
BRKHEC 3.7% 07/15/30	3.7	100	91	14,203	2030/7/15	
BRKHEC 3.95% 08/01/47	3.95	100	75	11,802	2047/8/1	
BRKHEC 4.45% 01/15/49	4.45	100	79	12,426	2049/1/15	
BRKHEC 5.3% 02/01/55	5.3	100	92	14,408	2055/2/1	
BRKHEC 5.35% 01/15/34	5.35	100	99	15,474	2034/1/15	
BRO 4.2% 03/17/32	4.2	200	177	27,674	2032/3/17	
BSX 1.9% 06/01/25	1.9	100	96	14,969	2025/6/1	
BWA 5% 10/01/25	5.0	200	197	30,694	2025/10/1	
BXP 3.25% 01/30/31	3.25	100	82	12,893	2031/1/30	
BXP 3.4% 06/21/29	3.4	100	87	13,597	2029/6/21	
EZLNZ 4.846% 02/07/28	4.846	250	244	38,062	2028/2/7	
C 1.122% 01/28/27	1.122	100	92	14,363	2027/1/28	
C 1.462% 06/09/27	1.462	100	91	14,248	2027/6/9	
C 2.904% 11/03/42	2.904	100	68	10,594	2042/11/3	
C 3.668% 07/24/28	3.668	100	94	14,661	2028/7/24	
C 4.65% 07/23/48	4.65	200	169	26,409	2048/7/23	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
C 4.658% 05/24/28	4.658	200	194	30,356	2028/5/24
C 4.75% 05/18/46	4.75	100	83	13,070	2046/5/18
C 5.61% 09/29/26	5.61	100	99	15,546	2026/9/29
C 5.875% 01/30/42	5.875	300	301	46,980	2042/1/30
C 6.27% 11/17/33	6.27	200	204	31,907	2033/11/17
CABKSM 5.673% 03/15/30	5.673	200	196	30,616	2030/3/15
CABKSM 6.684% 09/13/27	6.684	200	202	31,562	2027/9/13
CAG 1.375% 11/01/27	1.375	100	86	13,477	2027/11/1
CAG 5.3% 10/01/26	5.3	200	198	30,943	2026/10/1
CAG 5.3% 11/01/38	5.3	100	91	14,213	2038/11/1
CARGIL 3.25% 05/23/29	3.25	100	91	14,283	2029/5/23
CAT 3.25% 04/09/50	3.25	100	69	10,830	2050/4/9
CAT 3.6% 08/12/27	3.6	100	95	14,852	2027/8/12
CAT 4.85% 02/27/29	4.85	200	197	30,716	2029/2/27
CB 1.375% 09/15/30	1.375	100	79	12,360	2030/9/15
CB 2.85% 12/15/51	2.85	100	63	9,831	2051/12/15
CBAAU 3.305% 03/11/41	3.305	200	140	21,913	2041/3/11
CBAAU 3.9% 03/16/28	3.9	200	192	29,919	2028/3/16
CCI 1.05% 07/15/26	1.05	100	90	14,102	2026/7/15
CCI 3.25% 01/15/51	3.25	100	63	9,961	2051/1/15
CCI 4.8% 09/01/28	4.8	100	96	14,998	2028/9/1
CDEL 5.125% 02/02/33	5.125	200	185	28,819	2033/2/2
CDEL 5.95% 01/08/34	5.95	200	194	30,236	2034/1/8
CDEL 6.44% 01/26/36	6.44	200	198	30,890	2036/1/26
CEG 3.25% 06/01/25	3.25	100	97	15,179	2025/6/1
CENEP 1.169% 08/21/26	1.169	200	181	28,208	2026/8/21
CHD 5.6% 11/15/32	5.6	100	101	15,790	2032/11/15
CHH 3.7% 01/15/31	3.7	100	85	13,290	2031/1/15
CHTR 2.25% 01/15/29	2.25	100	83	12,977	2029/1/15
CHTR 3.5% 06/01/41	3.5	100	63	9,915	2041/6/1
CHTR 4.4% 04/01/33	4.4	100	85	13,249	2033/4/1
CHTR 5.5% 04/01/63	5.5	100	73	11,519	2063/4/1
CHTR 5.75% 04/01/48	5.75	100	79	12,456	2048/4/1
CI 1.25% 03/15/26	1.25	42	38	6,043	2026/3/15
CI 2.375% 03/15/31	2.375	100	81	12,703	2031/3/15
CI 4.8% 07/15/46	4.8	200	169	26,463	2046/7/15
CI 4.8% 08/15/38	4.8	100	89	13,921	2038/8/15
CIINAT 1.375% 05/06/26	1.375	200	183	28,638	2026/5/6
CL 4.8% 03/02/26	4.8	100	99	15,503	2026/3/2
CLR 5.75% 01/15/31	5.75	100	97	15,194	2031/1/15
CLX 1.8% 05/15/30	1.8	100	81	12,681	2030/5/15
CM 3.6% 04/07/32	3.6	100	87	13,631	2032/4/7
CMCSA 2.65% 02/01/30	2.65	100	86	13,488	2030/2/1
CMCSA 2.8% 01/15/51	2.8	100	59	9,265	2051/1/15
CMCSA 3.25% 11/01/39	3.25	100	73	11,513	2039/11/1
CMCSA 3.9% 03/01/38	3.9	100	82	12,870	2038/3/1
CMCSA 4% 03/01/48	4.0	100	76	11,871	2048/3/1
CMCSA 5.25% 11/07/25	5.25	100	99	15,556	2025/11/7
CMCSA 5.35% 05/15/53	5.35	100	92	14,427	2053/5/15
CMCSA 5.35% 11/15/27	5.35	200	201	31,312	2027/11/15
CMCSA 5.5% 05/15/64	5.5	100	92	14,470	2064/5/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CME 4.15% 06/15/48	4.15	100	82	12,774	2048/6/15
CMS 4.75% 06/01/50	4.75	100	90	14,083	2050/6/1
CNA 2.05% 08/15/30	2.05	100	81	12,684	2030/8/15
CNC 4.625% 12/15/29	4.625	200	185	28,942	2029/12/15
CNP 1.45% 06/01/26	1.45	100	92	14,335	2026/6/1
CNP 2.65% 06/01/31	2.65	100	82	12,853	2031/6/1
CNQCN 2.95% 07/15/30	2.95	100	85	13,364	2030/7/15
CNRCN 2.45% 05/01/50	2.45	100	58	9,087	2050/5/1
COF 3.273% 03/01/30	3.273	100	88	13,743	2030/3/1
COF 4.927% 05/10/28	4.927	100	97	15,211	2028/5/10
COF 5.268% 05/10/33	5.268	100	94	14,739	2033/5/10
COF 5.7% 02/01/30	5.7	200	197	30,724	2030/2/1
COP 3.8% 03/15/52	3.8	100	73	11,400	2052/3/15
COP 4.875% 10/01/47	4.875	300	267	41,636	2047/10/1
COST 1.375% 06/20/27	1.375	100	89	13,920	2027/6/20
CP 3% 12/02/41	3.0	100	84	13,144	2041/12/2
CP 4.95% 08/15/45	4.95	100	87	13,687	2045/8/15
CPB 2.375% 04/24/30	2.375	100	83	13,068	2030/4/24
CPPIBC 3.25% 06/15/27	3.25	250	237	36,950	2027/6/15
CRM 1.5% 07/15/28	1.5	100	86	13,449	2028/7/15
CSCO 2.5% 09/20/26	2.5	100	94	14,677	2026/9/20
CSX 3.8% 03/01/28	3.8	100	95	14,824	2028/3/1
CSX 4.1% 11/15/32	4.1	100	91	14,226	2032/11/15
CSX 5.2% 11/15/33	5.2	200	197	30,695	2033/11/15
CVECN 2.65% 01/15/32	2.65	100	80	12,579	2032/1/15
CVS 1.75% 08/21/30	1.75	100	79	12,422	2030/8/21
CVS 4.125% 04/01/40	4.125	100	79	12,373	2040/4/1
CVS 4.78% 03/25/38	4.78	100	87	13,642	2038/3/25
CVS 5% 02/20/26	5.0	100	98	15,414	2026/2/20
CVS 5.125% 02/21/30	5.125	200	195	30,423	2030/2/21
CVS 5.125% 07/20/45	5.125	100	86	13,492	2045/7/20
CVS 6% 06/01/63	6.0	100	94	14,793	2063/6/1
CVX 1.554% 05/11/25	1.554	100	96	14,967	2025/5/11
CVX 6% 03/01/41	6.0	100	105	16,454	2041/3/1
D 2.4% 03/30/32	2.4	100	80	12,467	2032/3/30
D 3.3% 04/15/41	3.3	100	71	11,079	2041/4/15
D 3.5% 03/15/27	3.5	100	94	14,782	2027/3/15
D 5.45% 04/01/53	5.45	200	186	29,070	2053/4/1
DAL 7% 05/01/25	7.0	100	100	15,695	2025/5/1
DANBNK 4.298% 04/01/28	4.298	200	191	29,790	2028/4/1
DB 4.875% 12/01/32	4.875	200	183	28,652	2032/12/1
DB 6.119% 07/14/26	6.119	150	149	23,559	2026/7/14
DB 7.146% 07/13/27	7.146	300	305	47,662	2027/7/13
DBSP 1.822% 03/10/31	1.822	200	185	28,950	2031/3/10
DD 4.725% 11/15/28	4.725	100	97	15,259	2028/11/15
DE 0.7% 01/15/26	0.7	100	92	14,437	2026/1/15
DE 2% 06/17/31	2.0	100	80	12,567	2031/6/17
DE 3.1% 04/15/30	3.1	100	89	13,915	2030/4/15
DE 4.75% 01/20/28	4.75	300	295	46,073	2028/1/20
DELL 3.45% 12/15/51	3.45	37	24	3,772	2051/12/15
DFS 4.5% 01/30/26	4.5	100	97	15,192	2026/1/30

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DG 4.125% 04/03/50	4.125	100	73	11,449	2050/4/3
DGELN 5.2% 10/24/25	5.2	200	199	31,079	2025/10/24
DGX 2.8% 06/30/31	2.8	100	83	12,985	2031/6/30
DHR 3.25% 11/15/39	3.25	100	76	11,922	2039/11/15
DIS 1.75% 01/13/26	1.75	200	188	29,355	2026/1/13
DIS 2.75% 09/01/49	2.75	100	61	9,603	2049/9/1
DIS 3.5% 05/13/40	3.5	100	77	12,085	2040/5/13
DIS 3.6% 01/13/51	3.6	100	72	11,274	2051/1/13
DIS 3.7% 03/23/27	3.7	100	96	14,994	2027/3/23
DIS 6.2% 12/15/34	6.2	100	106	16,627	2034/12/15
DKS 4.1% 01/15/52	4.1	100	67	10,534	2052/1/15
DLTR 4.2% 05/15/28	4.2	100	95	14,811	2028/5/15
DNBNO 1.535% 05/25/27	1.535	200	183	28,608	2027/5/25
DOW 3.6% 11/15/50	3.6	100	68	10,660	2050/11/15
DOW 6.3% 03/15/33	6.3	100	104	16,264	2033/3/15
DT 4.375% 06/21/28	4.375	150	144	22,432	2028/6/21
DT 4.75% 06/21/38	4.75	150	136	21,226	2038/6/21
DTE 3% 03/01/32	3.0	100	84	13,130	2032/3/1
DTE 5.4% 04/01/53	5.4	100	94	14,784	2053/4/1
DUK 3.25% 08/15/25	3.25	100	97	15,158	2025/8/15
DUK 3.3% 06/15/41	3.3	200	140	21,910	2041/6/15
DUK 3.64% 11/01/46	3.64	100	68	10,698	2046/11/1
DUK 3.7% 09/01/28	3.7	100	93	14,627	2028/9/1
DUK 5% 08/15/52	5.0	100	84	13,218	2052/8/15
DUK 5.25% 03/15/33	5.25	100	98	15,273	2033/3/15
DUK 5.25% 04/01/33	5.25	100	97	15,168	2033/4/1
DUK 5.35% 01/15/53	5.35	200	185	28,839	2053/1/15
DVN 4.5% 01/15/30	4.5	100	94	14,713	2030/1/15
EBAY 1.4% 05/10/26	1.4	100	92	14,348	2026/5/10
EBAY 3.65% 05/10/51	3.65	100	70	10,919	2051/5/10
ECL 3.95% 12/01/47	3.95	100	79	12,363	2047/12/1
ECL 5.25% 01/15/28	5.25	200	200	31,231	2028/1/15
EDF 4.875% 09/21/38	4.875	200	172	26,894	2038/9/21
EDF 5.7% 05/23/28	5.7	200	200	31,262	2028/5/23
EDF 6.9% 05/23/53	6.9	200	208	32,489	2053/5/23
EPX 2.35% 09/15/31	2.35	100	79	12,455	2031/9/15
EIX 2.25% 06/01/30	2.25	100	83	12,928	2030/6/1
EIX 4.125% 03/01/48	4.125	100	76	11,852	2048/3/1
EIX 4.9% 06/01/26	4.9	200	197	30,746	2026/6/1
EIX 5.2% 06/01/34	5.2	200	190	29,664	2034/6/1
EIX 5.95% 11/01/32	5.95	100	101	15,827	2032/11/1
EL 4.375% 05/15/28	4.375	200	194	30,261	2028/5/15
ELV 4.75% 02/15/33	4.75	100	94	14,696	2033/2/15
ELV 4.9% 02/08/26	4.9	100	98	15,390	2026/2/8
ELV 5.125% 02/15/53	5.125	100	89	13,955	2053/2/15
EMN 5.75% 03/08/33	5.75	100	88	15,369	2033/3/8
EMR 2.2% 12/21/31	2.2	100	81	12,678	2031/12/21
ENBCN 3.4% 08/01/51	3.4	100	65	10,175	2051/8/1
ENBCN 5.7% 03/08/33	5.7	100	98	15,364	2033/3/8
ENELIM 1.875% 07/12/28	1.875	200	173	26,996	2028/7/12
ENELIM 2.875% 07/12/41	2.875	200	127	19,926	2041/7/12

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ENELIM 4.75% 05/25/47	4.75	200	163	25,431	2047/5/25
ENIM 4.25% 05/09/29	4.25	200	188	29,434	2029/5/9
EOG 4.375% 04/15/30	4.375	100	95	14,877	2030/4/15
EPD 3.7% 01/31/51	3.7	100	71	11,167	2051/1/31
EPD 3.7% 02/15/26	3.7	100	97	15,148	2026/2/15
EPD 4.25% 02/15/48	4.25	100	80	12,479	2048/2/15
EPD 7.55% 04/15/38	7.55	100	115	17,967	2038/4/15
EQH 4.35% 04/20/28	4.35	100	95	14,841	2028/4/20
EQH 5% 04/20/48	5.0	100	85	13,376	2048/4/20
EQIX 1% 09/15/25	1.0	100	93	14,575	2025/9/15
EQIX 2.5% 05/15/31	2.5	100	81	12,677	2031/5/15
EQNR 3.625% 04/06/40	3.625	100	79	12,320	2040/4/6
EQNR 3.7% 04/06/50	3.7	200	147	22,937	2050/4/6
EQR 1.85% 08/01/31	1.85	100	79	12,362	2031/8/1
ES 3.45% 01/15/50	3.45	100	65	10,212	2050/1/15
ES 4.75% 05/15/26	4.75	100	98	15,309	2026/5/15
ES 5.45% 03/01/28	5.45	100	99	15,443	2028/3/1
ET 4.15% 09/15/29	4.15	100	93	14,493	2029/9/15
ET 5.55% 02/15/28	5.55	100	99	15,565	2028/2/15
ET 5.75% 02/15/33	5.75	100	98	15,364	2033/2/15
ET 5.8% 06/15/38	5.8	100	95	14,910	2038/6/15
ET 6% 06/15/48	6.0	100	93	14,640	2048/6/15
ET 6.05% 12/01/26	6.05	200	202	31,540	2026/12/1
ETR 1.9% 06/15/28	1.9	100	86	13,514	2028/6/15
ETR 2.4% 06/15/31	2.4	100	80	12,585	2031/6/15
EXC 3.35% 03/15/32	3.35	100	85	13,293	2032/3/15
EXC 4.1% 03/15/52	4.1	100	74	11,672	2052/3/15
EXC 5.15% 03/15/28	5.15	100	98	15,370	2028/3/15
EXPE 4.625% 08/01/27	4.625	200	194	30,221	2027/8/1
F 6.95% 06/10/26	6.95	200	202	31,605	2026/6/10
F 7.35% 03/06/30	7.35	200	208	32,431	2030/3/6
F 7.35% 11/04/27	7.35	400	413	64,481	2027/11/4
FANG 4.4% 03/24/51	4.4	100	78	12,188	2051/3/24
FCX 4.125% 03/01/28	4.125	100	93	14,638	2028/3/1
FCX 4.25% 03/01/30	4.25	100	92	14,379	2030/3/1
FDX 2.4% 05/15/31	2.4	100	82	12,866	2031/5/15
FDX 3.1% 08/05/29	3.1	100	89	13,975	2029/8/5
FDX 3.25% 05/15/41	3.25	200	141	21,977	2041/5/15
FDX 4.05% 02/15/48	4.05	100	74	11,603	2048/2/15
FE 4.55% 11/15/30	4.55	100	91	14,326	2030/11/15
FI 5.6% 03/02/33	5.6	100	98	15,372	2033/3/2
FIS 2.25% 03/01/31	2.25	100	81	12,757	2031/3/1
FIS 3.1% 03/01/41	3.1	100	69	10,784	2041/3/1
FISV 5.45% 03/02/28	5.45	100	99	15,510	2028/3/2
FITB 1.707% 11/01/27	1.707	100	90	14,073	2027/11/1
FITB 4.772% 07/28/30	4.772	100	94	14,686	2030/7/28
FLEX 6% 01/15/28	6.0	100	100	15,599	2028/1/15
FMC 3.45% 10/01/29	3.45	100	88	13,769	2029/10/1
FMC 5.15% 05/18/26	5.15	100	98	15,393	2026/5/18
FNF 2.45% 03/15/31	2.45	100	79	12,432	2031/3/15
FOXA 4.709% 01/25/29	4.709	100	96	15,028	2029/1/25

銘柄	利率 (%)	期		末		
		額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
FUKOKU 6.8% PERP	6.8	200	204	31,922	—	
GD 2.85% 06/01/41	2.85	100	69	10,859	2041/6/1	
GD 4.25% 04/01/40	4.25	100	85	13,325	2040/4/1	
GE 4.35% 05/01/50	4.35	100	81	12,713	2050/5/1	
GE 4.5% 03/11/44	4.5	100	85	13,326	2044/3/11	
GEHC 5.857% 03/15/30	5.857	100	101	15,791	2030/3/15	
GILD 1.2% 10/01/27	1.2	100	87	13,649	2027/10/1	
GILD 2.8% 10/01/50	2.8	100	60	9,434	2050/10/1	
GILD 5.25% 10/15/33	5.25	200	196	30,642	2033/10/15	
GIS 4.95% 03/29/33	4.95	100	95	14,879	2033/3/29	
GIS 5.5% 10/17/28	5.5	100	100	15,620	2028/10/17	
GLENLN 1.625% 04/27/26	1.625	100	92	14,388	2026/4/27	
GLW 5.45% 11/15/79	5.45	100	88	13,716	2079/11/15	
GM 1.25% 01/08/26	1.25	200	185	28,960	2026/1/8	
GM 3.1% 01/12/32	3.1	100	82	12,787	2032/1/12	
GM 5% 04/09/27	5.0	100	98	15,306	2027/4/9	
GM 5.25% 03/01/26	5.25	100	99	15,446	2026/3/1	
GM 5.4% 04/01/48	5.4	100	86	13,547	2048/4/1	
GM 5.4% 10/15/29	5.4	100	98	15,288	2029/10/15	
GMT 3.5% 06/01/32	3.5	100	84	13,188	2032/6/1	
GMT 4% 06/30/30	4.0	100	90	14,154	2030/6/30	
GMT 5.45% 09/15/33	5.45	100	95	14,937	2033/9/15	
GOOGL 1.9% 08/15/40	1.9	100	63	9,868	2040/8/15	
GOOGL 2.05% 08/15/50	2.05	100	55	8,626	2050/8/15	
GPN 1.2% 03/01/26	1.2	200	184	28,754	2026/3/1	
GPN 4.95% 08/15/27	4.95	100	98	15,265	2027/8/15	
GPN 5.95% 08/15/52	5.95	100	94	14,775	2052/8/15	
GS 1.431% 03/09/27	1.431	400	369	57,545	2027/3/9	
GS 2.6% 02/07/30	2.6	100	85	13,323	2030/2/7	
GS 3.102% 02/24/33	3.102	200	165	25,823	2033/2/24	
GS 3.8% 03/15/30	3.8	200	182	28,459	2030/3/15	
GS 3.85% 01/26/27	3.85	100	95	14,940	2027/1/26	
GS 4.411% 04/23/39	4.411	100	85	13,362	2039/4/23	
GS 4.482% 08/23/28	4.482	500	482	75,181	2028/8/23	
GS 6.75% 10/01/37	6.75	100	105	16,367	2037/10/1	
GSK 3.375% 06/01/29	3.375	100	92	14,398	2029/6/1	
HAL 2.92% 03/01/30	2.92	200	175	27,302	2030/3/1	
HAS 3.55% 11/19/26	3.55	100	94	14,752	2026/11/19	
HBAN 4.443% 08/04/28	4.443	100	95	14,922	2028/8/4	
HCA 2.375% 07/15/31	2.375	100	79	12,448	2031/7/15	
HCA 3.125% 03/15/27	3.125	200	187	29,145	2027/3/15	
HCA 4.375% 03/15/42	4.375	100	79	12,341	2042/3/15	
HCA 5.6% 04/01/34	5.6	200	194	30,276	2034/4/1	
HCA 5.625% 09/01/28	5.625	100	99	15,488	2028/9/1	
HD 0.9% 03/15/28	0.9	100	85	13,331	2028/3/15	
HD 3.3% 04/15/40	3.3	100	75	11,767	2040/4/15	
HD 3.625% 04/15/52	3.625	100	71	11,185	2052/4/15	
HD 4% 09/15/25	4.0	100	98	15,298	2025/9/15	
HES 5.8% 04/01/47	5.8	100	97	15,145	2047/4/1	
HIG 4.4% 03/15/48	4.4	100	81	12,724	2048/3/15	
HNDIA 1.8% 01/13/31	1.8	100	80	12,535	2031/1/13	

銘柄	利率 (%)	期		末		
		額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
HNDA 4.7% 01/12/28	4.7	100	98	15,275	2028/1/12	
HNDA 4.75% 01/12/26	4.75	100	98	15,416	2026/1/12	
HON 2.5% 11/01/26	2.5	100	93	14,621	2026/11/1	
HON 4.5% 01/15/34	4.5	300	281	43,822	2034/1/15	
HPQ 4% 04/15/29	4.0	100	93	14,537	2029/4/15	
HSBC 6.161% 03/09/29	6.161	200	202	31,479	2029/3/9	
HSBC 6.5% 09/15/37	6.5	100	100	15,677	2037/9/15	
HSBC 7.336% 11/03/26	7.336	200	204	31,859	2026/11/3	
HSY 2.65% 06/01/50	2.65	100	60	9,408	2050/6/1	
HUM 5.7% 03/13/26	5.7	100	99	15,473	2026/3/13	
HYMTR 1.5% 06/15/26	1.5	100	91	14,265	2026/6/15	
HYMTR 5.8% 04/01/30	5.8	100	99	15,550	2030/4/1	
HVUELE 1.5% 01/19/26	1.5	200	185	28,923	2026/1/19	
IBM 3.5% 05/15/29	3.5	100	91	14,320	2029/5/15	
IBM 4.15% 07/27/27	4.15	100	96	15,037	2027/7/27	
IBM 4.5% 02/06/26	4.5	100	98	15,387	2026/2/6	
IBM 4.5% 02/06/28	4.5	200	195	30,389	2028/2/6	
IBM 4.75% 02/06/33	4.75	100	95	14,833	2033/2/6	
IBM 5.1% 02/06/53	5.1	100	90	14,094	2053/2/6	
ICE 2.65% 09/15/40	2.65	100	67	10,581	2040/9/15	
ICE 5.2% 06/15/62	5.2	100	90	14,086	2062/6/15	
IFCN 5.459% 09/22/32	5.459	100	97	15,138	2032/9/22	
IFF 1.23% 10/01/25	1.23	100	93	14,576	2025/10/1	
IFF 3.268% 11/15/40	3.268	100	67	10,546	2040/11/15	
IMBLN 3.875% 07/26/29	3.875	200	183	28,547	2029/7/26	
INTC 2.45% 11/15/29	2.45	100	86	13,447	2029/11/15	
INTC 4.875% 02/10/26	4.875	100	99	15,441	2026/2/10	
INTC 5.2% 02/10/33	5.2	100	97	15,231	2033/2/10	
INTC 5.625% 02/10/43	5.625	100	97	15,129	2043/2/10	
INTC 5.7% 02/10/53	5.7	100	95	14,903	2053/2/10	
IPG 3.375% 03/01/41	3.375	100	70	11,018	2041/3/1	
ISPIIM 7% 11/21/25	7.0	200	202	31,563	2025/11/21	
ISPM 8.248% 11/21/33	8.248	200	216	33,728	2033/11/21	
J 5.9% 03/01/33	5.9	100	98	15,398	2033/3/1	
J 6.35% 08/18/28	6.35	200	203	31,647	2028/8/18	
JAPTOB 2.25% 09/14/31	2.25	200	160	24,950	2031/9/14	
JBL 1.7% 04/15/26	1.7	200	185	28,871	2026/4/15	
JCI 4.5% 02/15/47	4.5	100	80	12,588	2047/2/15	
JD 3.375% 01/14/30	3.375	200	179	27,908	2030/1/14	
JEF 2.625% 10/15/31	2.625	100	78	12,297	2031/10/15	
JEF 2.75% 10/15/32	2.75	200	155	24,195	2032/10/15	
JNJ 0.55% 09/01/25	0.55	100	94	14,664	2025/9/1	
JNJ 1.3% 09/01/30	1.3	200	160	25,070	2030/9/1	
JNJ 2.1% 09/01/40	2.1	100	64	10,079	2040/9/1	
JPM 1.04% 02/04/27	1.04	200	184	28,713	2027/2/4	
JPM 1.47% 09/22/27	1.47	100	90	14,123	2027/9/22	
JPM 2.963% 01/25/33	2.963	200	166	25,887	2033/1/25	
JPM 3.157% 04/22/42	3.157	200	143	22,383	2042/4/22	
JPM 3.782% 02/01/28	3.782	100	95	14,867	2028/2/1	
JPM 3.897% 01/23/49	3.897	400	304	47,366	2049/1/23	
JPM 3.96% 01/29/27	3.96	400	388	60,496	2027/1/29	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
JPM 4.26% 02/22/48	4.26	200	161	25,082	2048/2/22
JPM 4.323% 04/26/28	4.323	300	289	45,149	2028/4/26
JPM 4.565% 06/14/30	4.565	100	95	14,872	2030/6/14
JPM 5.625% 08/16/33	5.625	200	197	30,724	2043/8/16
K 5.25% 03/01/33	5.25	100	97	15,151	2033/3/1
KD 4.1% 10/15/41	4.1	100	72	11,367	2041/10/15
KDP 3.95% 04/15/29	3.95	100	93	14,549	2029/4/15
KEY 4.7% 01/26/26	4.7	250	243	37,898	2026/1/26
KHC 4.875% 10/01/49	4.875	100	85	13,283	2049/10/1
KHC 6.5% 02/09/40	6.5	100	104	16,279	2040/2/9
KIM 1.9% 03/01/28	1.9	100	87	13,604	2028/3/1
KLAC 5% 03/15/49	5.0	100	90	14,118	2049/3/15
KMB 3.2% 04/25/29	3.2	100	91	14,247	2029/4/25
KMI 1.75% 11/15/26	1.75	100	91	14,208	2026/11/15
KMI 3.6% 02/15/51	3.6	200	131	20,528	2051/2/15
KMI 5.2% 03/01/48	5.2	100	86	13,418	2048/3/1
KMI 5.2% 06/01/33	5.2	100	95	14,821	2033/6/1
KO 1.375% 03/15/31	1.375	100	78	12,243	2031/3/15
KO 1.45% 06/01/27	1.45	100	90	14,029	2027/6/1
KO 2.5% 06/01/40	2.5	100	68	10,633	2040/6/1
KO 3% 03/05/51	3.0	100	65	10,279	2051/3/5
KO 3.375% 03/25/27	3.375	100	95	14,951	2027/3/25
KOROIL 4.75% 04/03/26	4.75	200	197	30,693	2026/4/3
KR 4.45% 02/01/47	4.45	100	80	12,483	2047/2/1
LH 2.95% 12/01/29	2.95	100	87	13,661	2029/12/1
LHX 1.8% 01/15/31	1.8	100	78	12,298	2031/1/15
LIN 1.1% 08/10/30	1.1	100	79	12,334	2030/8/10
LIN 2% 08/10/50	2.0	100	51	8,097	2050/8/10
LLOIDS 4.716% 08/11/26	4.716	400	393	61,345	2026/8/11
LLY 3.375% 03/15/29	3.375	100	92	14,466	2029/3/15
LLY 4.15% 03/15/59	4.15	100	79	12,336	2059/3/15
LLY 5.1% 02/09/64	5.1	200	185	28,819	2064/2/9
LMT 4.95% 10/15/25	4.95	200	199	31,028	2025/10/15
LMT 5.2% 02/15/64	5.2	200	184	28,743	2064/2/15
LMT 5.7% 11/15/54	5.7	100	100	15,675	2054/11/15
LNC 4.35% 03/01/48	4.35	100	73	11,459	2048/3/1
LNG 5.65% 04/15/34	5.65	200	194	30,310	2034/4/15
LOW 2.8% 09/15/41	2.8	200	134	20,900	2041/9/15
LOW 4.05% 05/03/47	4.05	100	75	11,736	2047/5/3
LOW 5.15% 07/01/33	5.15	100	97	15,187	2033/7/1
LOW 5.625% 04/15/53	5.625	100	94	14,760	2053/4/15
LOW 5.75% 07/01/53	5.75	200	193	30,135	2053/7/1
LRXC 4% 03/15/29	4.0	100	94	14,787	2029/3/15
LUV 5.125% 06/15/27	5.125	100	98	15,366	2027/6/15
LYB 3.375% 10/01/40	3.375	100	71	11,103	2040/10/1
LYB 4.2% 05/01/50	4.2	100	74	11,557	2050/5/1
MA 2.95% 03/15/51	2.95	100	64	10,122	2051/3/15
MA 3.3% 03/26/27	3.3	100	94	14,790	2027/3/26
MA 3.95% 02/26/48	3.95	100	79	12,403	2048/2/26
MAERSK 4.5% 06/20/29	4.5	100	96	14,975	2029/6/20
MAR 2.75% 10/15/33	2.75	200	157	24,499	2033/10/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MAR 4.625% 06/15/30	4.625	100	94	14,784	2030/6/15
MARUB 1.577% 09/17/26	1.577	200	181	28,266	2026/9/17
MBGGR 5.375% 11/26/25	5.375	150	149	23,340	2025/11/26
MCD 2.125% 03/01/30	2.125	100	84	13,084	2030/3/1
MCD 3.5% 07/01/27	3.5	100	94	14,766	2027/7/1
MCD 3.625% 09/01/49	3.625	100	71	11,076	2049/9/1
MCD 4.2% 04/01/50	4.2	100	78	12,181	2050/4/1
MCD 4.6% 09/09/32	4.6	100	95	14,816	2032/9/9
MCO 5.25% 02/15/26	5.25	100	99	15,536	2026/2/15
MCO 2.75% 08/19/41	2.75	100	67	10,440	2041/8/19
MDLZ 1.5% 02/04/31	1.5	100	77	12,080	2031/2/4
MDLZ 2.625% 03/17/27	2.625	100	92	14,460	2027/3/17
MDT 4.25% 03/30/28	4.25	100	96	15,034	2028/3/30
MDT 4.375% 03/15/35	4.375	100	91	14,295	2035/3/15
MET 5% 01/06/26	5.0	150	148	23,192	2026/1/6
MET 5.25% 01/15/54	5.25	200	184	28,811	2054/1/15
META 4.6% 05/15/28	4.6	100	98	15,300	2028/5/15
META 4.65% 08/15/62	4.65	100	82	12,877	2062/8/15
META 5.6% 05/15/53	5.6	100	98	15,358	2053/5/15
MFCX 3.703% 03/16/32	3.703	100	89	13,939	2032/3/16
MITCO 1.125% 07/15/26	1.125	200	181	28,346	2026/7/15
MITHCC 3.967% 04/13/30	3.967	200	181	28,277	2030/4/13
MITHCC 5.08% 09/15/27	5.08	200	197	30,709	2027/9/15
MIZUHO 2.564% 09/13/31	2.564	200	158	24,743	2031/9/13
MIZUHO 5.414% 09/13/28	5.414	200	199	31,000	2028/9/13
MKC 0.9% 02/15/26	0.9	100	92	14,378	2026/2/15
MKC 2.5% 04/15/30	2.5	100	84	13,167	2030/4/15
MKL 5% 05/20/49	5.0	100	86	13,407	2049/5/20
MLM 4.25% 12/15/47	4.25	100	79	12,335	2047/12/15
MMC 4.2% 03/01/48	4.2	100	79	12,308	2048/3/1
MMC 4.75% 03/15/39	4.75	100	90	14,108	2039/3/15
MMM 2.375% 08/26/29	2.375	200	171	26,669	2029/8/26
MO 3.4% 02/04/41	3.4	100	69	10,864	2041/2/4
MO 4.4% 02/14/26	4.4	100	98	15,273	2026/2/14
MO 5.8% 02/14/39	5.8	100	97	15,161	2039/2/14
MO 5.95% 02/14/49	5.95	100	95	14,932	2049/2/14
MPC 3.8% 04/01/28	3.8	100	94	14,673	2028/4/1
MPLX 2.65% 08/15/30	2.65	100	83	13,071	2030/8/15
MPLX 4.5% 04/15/38	4.5	200	170	26,508	2038/4/15
MPLX 5.2% 12/01/47	5.2	100	86	13,526	2047/12/1
MQGAU 2.871% 01/14/33	2.871	100	80	12,597	2033/1/14
MQGAU 4.098% 06/21/28	4.098	100	95	14,879	2048/6/21
MRK 2.15% 12/10/31	2.15	200	161	25,221	2031/12/10
MRK 3.4% 03/07/29	3.4	100	92	14,438	2029/3/7
MRO 6.6% 10/01/37	6.6	200	202	31,532	2037/10/1
MRVL 5.75% 02/15/29	5.75	200	200	31,290	2029/2/15
MS 1.593% 05/04/27	1.593	200	184	28,696	2027/5/4
MS 2.475% 01/21/28	2.475	300	276	43,083	2028/1/21
MS 3.217% 04/22/42	3.217	100	72	11,251	2042/4/22
MS 3.622% 04/01/31	3.622	200	179	27,909	2031/4/1
MS 4.457% 04/22/39	4.457	100	87	13,559	2039/4/22

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MS 4.679% 07/17/26	4.679	200	197	30,744	2026/7/17
MS 5.449% 07/20/29	5.449	200	198	30,926	2029/7/20
MS 5.597% 03/24/51	5.597	100	98	15,307	2051/3/24
MS 6.138% 10/16/26	6.138	100	100	15,658	2026/10/16
MS 6.296% 10/18/28	6.296	100	102	15,900	2028/10/18
MSCI 3.25% 08/15/33	3.25	100	79	12,423	2033/8/15
MSFT 1.35% 09/15/30	1.35	100	80	12,503	2030/9/15
MSFT 2.525% 06/01/50	2.525	200	121	18,985	2050/6/1
MSFT 2.921% 03/17/52	2.921	100	65	10,217	2052/3/17
MSFT 3.3% 02/06/27	3.3	100	95	14,935	2027/2/6
MSFT 4.1% 02/06/37	4.1	100	91	14,206	2037/2/6
MSI 5.6% 06/01/32	5.6	100	99	15,448	2032/6/1
MTB 6.082% 03/13/32	6.082	100	97	15,149	2032/3/13
MTNA 4.25% 07/16/29	4.25	100	93	14,615	2029/7/16
MTNA 4.55% 03/11/26	4.55	100	97	15,230	2026/3/11
MTNA 6.55% 11/29/27	6.55	100	102	15,966	2027/11/29
MU 4.185% 02/15/27	4.185	100	96	15,054	2027/2/15
MU 5.875% 09/15/33	5.875	100	100	15,617	2033/9/15
MUFG 4.286% 07/26/38	4.286	100	87	13,673	2038/7/26
MUFG 4.7% 03/10/44	4.7	200	172	26,803	2044/3/10
MUFG 5.133% 07/20/33	5.133	200	193	30,133	2033/7/20
MUNRE 5.875% 05/23/42	5.875	200	198	30,942	2042/5/23
MYLIFE 5.1% 04/26/48	5.1	200	194	30,363	2048/4/26
NAB 4.966% 01/12/26	4.966	250	248	38,710	2026/1/12
NDAQ 1.65% 01/15/31	1.65	100	78	12,188	2031/1/15
NDAQ 5.35% 06/28/28	5.35	200	198	30,956	2028/6/28
NDASS 4.75% 09/22/25	4.75	200	197	30,835	2025/9/22
NEE 1.875% 01/15/27	1.875	100	90	14,154	2027/1/15
NEE 2.45% 02/03/32	2.45	100	81	12,720	2032/2/3
NEE 3.95% 03/01/48	3.95	100	76	11,988	2048/3/1
NEE 5.05% 04/01/28	5.05	100	99	15,484	2028/4/1
NEE 5.25% 02/28/53	5.25	100	89	13,932	2053/2/28
NEM 5.875% 04/01/35	5.875	100	100	15,688	2035/4/1
NESNVX 4% 09/24/48	4.0	150	118	18,469	2048/9/24
NESNVX 4.95% 03/14/30	4.95	150	148	23,116	2030/3/14
NESNVX 5.25% 03/13/26	5.25	150	150	23,368	2026/3/13
NFG 5.5% 01/15/26	5.5	100	99	15,475	2026/1/15
NFLX 4.875% 06/15/30	4.875	100	96	15,096	2030/6/15
NFLX 5.875% 11/15/28	5.875	100	101	15,885	2028/11/15
NI 0.95% 08/15/25	0.95	100	94	14,655	2025/8/15
NI 4.375% 05/14/47	4.375	100	78	12,290	2047/5/15
NIPLIF 2.75% 01/21/51	2.75	200	163	25,451	2051/1/21
NIPLIF 2.9% 09/16/51	2.9	200	161	25,197	2051/9/16
NKE 3.25% 03/27/40	3.25	100	76	11,863	2040/3/27
NKE 3.375% 03/27/50	3.375	100	70	10,977	2050/3/27
NNN 3.5% 04/15/51	3.5	100	67	10,456	2051/4/15
NOC 5.15% 05/01/40	5.15	100	93	14,554	2040/5/1
NOMURA 1.653% 07/14/26	1.653	200	182	28,475	2026/7/14
NOMURA 5.605% 07/06/29	5.605	200	198	30,846	2029/7/6
NOMURA 6.087% 07/12/33	6.087	200	204	31,897	2033/7/12
NOV 3.6% 12/01/29	3.6	100	89	14,007	2029/12/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NOVNVX 2% 02/14/27	2.0	100	92	14,375	2027/2/14
NOVNVX 2.2% 08/14/30	2.2	100	84	13,143	2030/8/14
NRG 2.45% 12/02/27	2.45	100	89	13,902	2027/12/2
NRUC 2.75% 04/15/32	2.75	200	164	25,628	2032/4/15
NRUC 4.3% 03/15/49	4.3	100	79	12,434	2049/3/15
NSC 3% 03/15/32	3.0	100	84	13,142	2032/3/15
NSC 4.15% 02/28/48	4.15	100	77	12,113	2048/2/28
NTRCN 5.8% 03/27/53	5.8	100	95	14,944	2053/3/27
NTRS 3.65% 08/03/28	3.65	100	94	14,666	2028/8/3
NTT 2.065% 04/03/31	2.065	200	161	25,094	2031/4/3
NUE 3.85% 04/01/52	3.85	100	74	11,555	2052/4/1
NVDA 3.5% 04/01/50	3.5	100	73	11,466	2050/4/1
NWG 5.516% 09/30/28	5.516	200	197	30,837	2028/9/30
NWIDE 4.85% 07/27/27	4.85	200	196	30,537	2027/7/27
OC 3.95% 08/15/29	3.95	100	92	14,478	2029/8/15
OGS 4.25% 09/01/32	4.25	100	92	14,393	2032/9/1
OHI 3.625% 10/01/29	3.625	100	87	13,631	2029/10/1
OKE 5.2% 07/15/48	5.2	100	86	13,444	2048/7/15
OKE 6.1% 11/15/32	6.1	100	101	15,754	2032/11/15
OMC 2.6% 08/01/31	2.6	100	82	12,830	2031/8/1
ORCL 1.65% 03/25/26	1.65	200	185	28,960	2026/3/25
ORCL 2.875% 03/25/31	2.875	200	168	26,269	2031/3/25
ORCL 3.65% 03/25/41	3.65	200	148	23,100	2041/3/25
ORCL 4.1% 03/25/61	4.1	100	69	10,821	2061/3/25
ORCL 4.5% 05/06/28	4.5	100	96	15,095	2028/5/6
ORCL 4.9% 02/06/33	4.9	100	94	14,760	2033/2/6
ORCL 6.9% 11/09/52	6.9	100	107	16,789	2052/11/9
ORIX 2.25% 03/09/31	2.25	100	82	12,784	2031/3/9
ORIX 5% 09/13/27	5.0	100	98	15,354	2027/9/13
OTIS 3.112% 02/15/40	3.112	100	72	11,279	2040/2/15
OXY 5.5% 12/01/25	5.5	100	99	15,512	2025/12/1
OXY 6.45% 09/15/36	6.45	100	102	15,978	2036/9/15
OXY 6.6% 03/15/46	6.6	100	102	15,959	2046/3/15
PARA 4.95% 01/15/31	4.95	100	86	13,548	2031/1/15
PCG 3.3% 08/01/40	3.3	100	69	10,828	2040/8/1
PCG 4.2% 06/01/41	4.2	200	153	23,857	2041/6/1
PCG 4.55% 07/01/30	4.55	100	92	14,451	2030/7/1
PCG 4.95% 07/01/50	4.95	100	80	12,599	2050/7/1
PCG 5.45% 06/15/27	5.45	200	198	30,937	2027/6/15
PCP 4.375% 06/15/45	4.375	100	84	13,101	2045/6/15
PEAK 2.125% 12/01/28	2.125	100	86	13,468	2028/12/1
PEAK 5.25% 12/15/32	5.25	200	192	29,926	2032/12/15
PEG 0.95% 03/15/26	0.95	100	92	14,404	2026/3/15
PEG 4.05% 05/01/48	4.05	100	79	12,313	2048/5/1
PEG 5.2% 08/01/33	5.2	100	97	15,215	2033/8/1
PEP 1.95% 10/21/31	1.95	100	80	12,507	2031/10/21
PEP 3.6% 02/18/28	3.6	100	95	14,820	2028/2/18
PEP 4% 05/02/47	4.0	100	79	12,399	2047/5/2
PEP 4.65% 02/15/53	4.65	100	87	13,685	2053/2/15
PERTIJ 1.4% 02/09/26	1.4	200	184	28,775	2026/2/9
PERTIJ 2.3% 02/09/31	2.3	200	161	25,096	2031/2/9

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
PETMK 4.55% 04/21/50	4.55	200	165	25,805	2050/4/21
PFE 2.55% 05/28/40	2.55	100	67	10,521	2040/5/28
PFE 3.9% 03/15/39	3.9	100	82	12,841	2039/3/15
PFE 4% 03/15/49	4.0	100	78	12,207	2049/3/15
PFE 4.45% 05/19/26	4.45	200	196	30,627	2026/5/19
PFE 4.65% 05/19/30	4.65	100	96	15,041	2030/5/19
PPG 3.7% 05/15/29	3.7	100	91	14,313	2029/5/15
PPG 5.5% 03/15/53	5.5	200	184	28,671	2053/3/15
PG 1% 04/23/26	1.0	100	92	14,408	2026/4/23
PG 3.55% 03/25/40	3.55	100	80	12,572	2040/3/25
PGR 2.5% 03/15/27	2.5	100	92	14,460	2027/3/15
PH 4.5% 09/15/29	4.5	100	96	14,991	2029/9/15
PKG 4.05% 12/15/49	4.05	100	75	11,769	2049/12/15
PLD 4.75% 06/15/33	4.75	100	94	14,673	2033/6/15
PLD 4.875% 06/15/28	4.875	200	196	30,611	2028/6/15
PLD 5.25% 06/15/53	5.25	100	91	14,236	2053/6/15
PM 4.875% 02/13/26	4.875	100	99	15,440	2026/2/13
PM 5.375% 02/15/33	5.375	100	97	15,197	2033/2/15
PM 5.75% 11/17/32	5.75	200	200	31,220	2032/11/17
PNC 2.55% 01/22/30	2.55	100	85	13,270	2030/1/22
PNC 4.758% 01/26/27	4.758	100	98	15,354	2027/1/26
POHANG 5.75% 01/17/28	5.75	200	200	31,195	2028/1/17
POWFIN 3.95% 04/23/30	3.95	200	178	27,763	2030/4/23
PPG 2.55% 06/15/30	2.55	100	85	13,338	2030/6/15
PPL 4.125% 04/15/30	4.125	100	92	14,438	2030/4/15
PRU 1.5% 03/10/26	1.5	100	93	14,517	2026/3/10
PRU 3.935% 12/07/49	3.935	100	73	11,502	2049/12/7
PRU 6.75% 03/01/53	6.75	100	102	15,915	2053/3/1
PRUFIN 3.625% 03/24/32	3.625	200	175	27,411	2032/3/24
PSA 1.5% 11/09/26	1.5	100	91	14,183	2026/11/9
PSA 5.1% 08/01/33	5.1	100	96	15,052	2033/8/1
PSPCAP 1.625% 10/26/28	1.625	250	216	33,720	2028/10/26
PSX 3.3% 03/15/52	3.3	100	64	10,066	2052/3/15
PSX 4.68% 02/15/45	4.68	100	83	13,039	2045/2/15
PSX 4.95% 12/01/27	4.95	100	98	15,358	2027/12/1
PTTEPT 2.993% 01/15/30	2.993	200	175	27,391	2030/1/15
PXD 5.1% 03/29/26	5.1	100	99	15,460	2026/3/29
PYPL 4.4% 06/01/32	4.4	100	93	14,638	2032/6/1
QCOM 1.65% 05/20/32	1.65	100	76	11,908	2032/5/20
QCOM 6% 05/20/53	6.0	100	104	16,291	2053/5/20
R 2.85% 03/01/27	2.85	100	93	14,499	2027/3/1
R 3.35% 09/01/25	3.35	100	96	15,080	2025/9/1
RABORK 1.106% 02/24/27	1.106	250	229	35,810	2027/2/24
RABORK 4.655% 08/22/28	4.655	250	241	37,678	2028/8/22
RCICN 4.5% 03/15/42	4.5	200	163	25,525	2042/3/15
RDSALN 2.75% 04/06/30	2.75	100	87	13,656	2030/4/6
RDSALN 2.875% 11/26/41	2.875	100	69	10,856	2041/11/26
RDSALN 3.25% 04/06/50	3.25	200	134	20,944	2050/4/6
RECLIN 5.625% 04/11/28	5.625	200	198	30,884	2028/4/11
RGA 6% 09/15/33	6.0	100	100	15,625	2033/9/15
RILIN 3.625% 01/12/52	3.625	250	168	26,215	2052/1/12

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
RIOLN 5.125% 03/09/53	5.125	100	91	14,275	2053/3/9
ROP 1% 09/15/25	1.0	100	93	14,623	2025/9/15
ROSW 0.991% 03/05/26	0.991	200	185	28,849	2026/3/5
ROSW 2.076% 12/13/31	2.076	200	160	24,926	2031/12/13
RPRX 1.2% 09/02/25	1.2	100	94	14,666	2025/9/2
RPRX 2.2% 09/02/30	2.2	100	81	12,626	2030/9/2
RRX 6.05% 02/15/26	6.05	100	100	15,591	2026/2/15
RSG 5% 04/01/34	5.0	100	96	14,972	2034/4/1
RTX 1.9% 09/01/31	1.9	100	78	12,203	2031/9/1
RTX 4.35% 04/15/47	4.35	100	80	12,497	2047/4/15
RTX 5% 02/27/26	5.0	100	99	15,464	2026/2/27
RTX 5.75% 01/15/29	5.75	200	202	31,567	2029/1/15
RVTY 2.55% 03/15/31	2.55	100	82	12,819	2031/3/15
RY 1.2% 04/27/26	1.2	200	184	28,693	2026/4/27
RY 3.625% 05/04/27	3.625	100	95	14,825	2027/5/4
RY 4.875% 01/12/26	4.875	100	99	15,432	2026/1/12
RY 6% 11/01/27	6.0	100	102	15,897	2027/11/1
SANUK 6.534% 01/10/29	6.534	200	203	31,718	2029/1/10
SANUSA 6.499% 03/09/29	6.499	100	100	15,706	2029/3/9
SBUX 4.45% 08/15/49	4.45	100	81	12,651	2049/8/15
SBUX 4.8% 02/15/33	4.8	100	95	14,933	2033/2/15
SCHW 2.45% 03/03/27	2.45	100	92	14,352	2027/3/3
SCHW 3.25% 05/22/29	3.25	100	90	14,139	2029/5/22
SCHW 5.853% 05/19/34	5.853	100	99	15,441	2034/5/19
SF 4% 05/15/30	4.0	100	90	14,025	2030/5/15
SHBASS 1.418% 06/11/27	1.418	250	227	35,461	2027/6/11
SHBASS 3.95% 06/10/27	3.95	250	239	37,284	2027/6/10
SHW 2.3% 05/15/30	2.3	100	83	13,036	2030/5/15
SHW 3.45% 06/01/27	3.45	100	94	14,702	2027/6/1
SJM 2.75% 09/15/41	2.75	300	193	30,175	2041/9/15
SLB 2.65% 06/26/30	2.65	100	86	13,469	2030/6/26
SNA 4.1% 03/01/48	4.1	100	79	12,454	2048/3/1
SNX 1.75% 08/09/26	1.75	200	182	28,403	2026/8/9
SO 3.7% 04/30/30	3.7	100	90	14,096	2030/4/30
SO 3.7% 12/01/47	3.7	100	73	11,387	2047/12/1
SO 4.25% 07/01/36	4.25	100	86	13,424	2036/7/1
SO 4.65% 05/16/28	4.65	200	194	30,281	2028/5/16
SO 4.7% 05/15/32	4.7	100	94	14,691	2032/5/15
SOGGEN 3.653% 07/08/35	3.653	200	165	25,855	2035/7/8
SOGGEN 4.027% 01/21/43	4.027	200	135	21,409	2043/1/21
SOGGEN 6.447% 01/12/27	6.447	200	201	31,362	2027/1/12
SPG 1.375% 01/15/27	1.375	100	89	14,017	2027/1/15
SPG 2.45% 09/13/29	2.45	100	85	13,361	2029/9/13
SPG 3.8% 07/15/50	3.8	300	214	33,348	2050/7/15
SPGI 4.75% 08/01/28	4.75	100	97	15,240	2028/8/1
SPLLLC 5.9% 09/15/37	5.9	100	100	15,653	2037/9/15
SRE 3.7% 04/01/29	3.7	100	91	14,292	2029/4/1
SRE 4% 02/01/48	4.0	100	73	11,449	2048/2/1
SRE 5.35% 04/01/53	5.35	100	92	14,364	2053/4/1
STLD 1.65% 10/15/27	1.65	100	88	13,719	2027/10/15
STT 2.203% 02/07/28	2.203	100	91	14,298	2028/2/7

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
STT 5.104% 05/18/26	5.104	100	99	15,481	2026/5/18
STZ 2.25% 08/01/31	2.25	100	79	12,456	2031/8/1
STZ 4.1% 02/15/48	4.1	100	76	11,977	2048/2/15
STZ 4.35% 05/09/27	4.35	100	97	15,109	2027/5/9
SUCN 3.75% 03/04/51	3.75	100	69	10,776	2051/3/4
SUMI 5.55% 03/09/28	5.55	200	201	31,363	2028/3/9
SUMIBK 2.296% 01/12/41	2.296	200	129	20,157	2041/1/12
SUMIBK 3.784% 03/09/26	3.784	200	194	30,219	2026/3/9
SUMIBK 5.464% 01/13/26	5.464	200	199	31,089	2026/1/13
SUMIFL 5.353% 04/25/28	5.353	200	197	30,803	2028/4/25
SUMILF 3.375% 04/15/81	3.375	200	169	26,326	2081/4/15
SWK 6% 03/06/28	6.0	100	101	15,822	2028/3/6
SYK 1.15% 06/15/25	1.15	100	95	14,809	2025/6/15
SYK 1.95% 06/15/30	1.95	100	82	12,821	2030/6/15
SYK 6.6% 04/01/50	6.6	100	107	16,804	2050/4/1
T(AT&T) 05/15/35	4.5	100	89	13,929	2035/5/15
T(AT&T) 09/15/53	3.5	100	65	10,161	2053/9/15
T(AT&T) 1.7% 03/25/26	1.7	100	93	14,511	2026/3/25
T(AT&T) 2.25% 02/01/32	2.25	100	78	12,276	2032/2/1
T(AT&T) 2.55% 12/01/33	2.55	200	153	23,983	2033/12/1
T(AT&T) 3.65% 09/15/59	3.65	100	64	10,073	2059/9/15
T(AT&T) 3.8% 12/01/57	3.8	100	67	10,470	2057/12/1
T(AT&T) 4.35% 03/01/29	4.35	100	95	14,862	2029/3/1
T(AT&T) 4.85% 07/15/45	4.85	300	258	40,237	2045/7/15
T(AT&T) 4.9% 08/15/37	4.9	200	181	28,194	2037/8/15
TACHEM 5.25% 06/23/45	5.25	200	184	28,682	2045/6/23
TAISEM 1.75% 10/25/26	1.75	200	183	28,534	2026/10/25
TCKBCN 3.9% 07/15/30	3.9	100	90	14,050	2030/7/15
TD 4.108% 06/08/27	4.108	100	96	14,983	2027/6/8
TD 5.103% 01/09/26	5.103	100	99	15,522	2026/1/9
TD 5.532% 07/17/26	5.532	100	100	15,593	2026/7/17
TDY 2.25% 04/01/28	2.25	100	88	13,762	2028/4/1
TELEFO 5.52% 03/01/49	5.52	150	135	21,068	2049/3/1
TEMASE 2.375% 08/02/41	2.375	250	175	27,290	2041/8/2
TEMASE 2.75% 08/02/61	2.75	250	158	24,612	2061/8/2
TENCNT 1.81% 01/26/26	1.81	200	187	29,262	2026/1/26
TENCNT 3.975% 04/11/29	3.975	200	186	29,092	2029/4/11
TFC 1.95% 06/05/30	1.95	100	80	12,591	2030/6/5
TFC 4.873% 01/26/29	4.873	100	96	15,086	2029/1/26
TFC 5.9% 10/28/26	5.9	100	99	15,567	2026/10/28
TGT 1.95% 01/15/27	1.95	100	92	14,363	2027/1/15
TGT 4.8% 01/15/53	4.8	300	266	41,520	2053/1/15
TMUS 2.05% 02/15/28	2.05	200	176	27,490	2028/2/15
TMUS 2.25% 02/15/26	2.25	100	94	14,684	2026/2/15
TMUS 3.375% 04/15/29	3.375	100	90	14,135	2029/4/15
TMUS 3.6% 11/15/60	3.6	100	65	10,150	2060/11/15
TMUS 4.5% 04/15/50	4.5	200	162	25,252	2050/4/15
TMUS 5.2% 01/15/33	5.2	100	96	15,091	2033/1/15
TMUS 5.75% 01/15/54	5.75	100	96	15,072	2054/1/15
TOYOTA 1.125% 06/18/26	1.125	200	183	28,555	2026/6/18
TOYOTA 1.9% 09/12/31	1.9	100	79	12,352	2031/9/12

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
TOYOTA 3.05% 03/22/27	3.05	100	94	14,669	2027/3/22
TOYOTA 3.375% 04/01/30	3.375	100	90	14,071	2030/4/1
TPR 7.85% 11/27/33	7.85	200	207	32,345	2033/11/27
TRPCN 4.75% 05/15/38	4.75	100	87	13,612	2038/5/15
TRV 4.05% 03/07/48	4.05	100	78	12,287	2048/3/7
TSN 4.35% 03/01/29	4.35	100	94	14,763	2029/3/1
TTEFP 2.986% 06/29/41	2.986	100	70	11,029	2041/6/29
TTEFP 3.386% 06/29/60	3.386	100	65	10,168	2060/6/29
TTEFP 3.455% 02/19/29	3.455	100	92	14,462	2029/2/19
TTEFP 4.95% 03/28/28	4.95	100	97	15,239	2028/3/28
TXN 3.875% 03/15/39	3.875	100	84	13,233	2039/3/15
TXN 4.15% 05/15/48	4.15	100	80	12,561	2048/5/15
UBS 1.305% 02/02/27	1.305	250	230	35,895	2027/2/2
UBS 4.194% 04/01/31	4.194	250	227	35,467	2031/4/1
UBS 6.442% 08/11/28	6.442	250	253	39,562	2028/8/11
UBS 9.016% 11/15/33	9.016	250	295	45,979	2033/11/15
UCGM 1.982% 06/03/27	1.982	200	184	28,722	2027/6/3
UDR 2.1% 08/01/32	2.1	100	75	11,777	2032/8/1
UHS 2.65% 10/15/30	2.65	100	82	12,874	2030/10/15
UNANA 1.375% 09/14/30	1.375	100	79	12,351	2030/9/14
UNH 1.15% 05/15/26	1.15	200	184	28,687	2026/5/15
UNH 4.25% 06/15/48	4.25	100	80	12,594	2048/6/15
UNH 4.5% 04/15/33	4.5	100	93	14,582	2033/4/15
UNH 4.75% 05/15/52	4.75	100	86	13,498	2052/5/15
UNH 5% 04/15/34	5.0	200	192	30,047	2034/4/15
UNH 5.15% 10/15/25	5.15	100	99	15,535	2025/10/15
UNH 5.2% 04/15/63	5.2	200	181	28,289	2063/4/15
UNM 4% 06/15/29	4.0	100	92	14,394	2029/6/15
UNP 2.891% 04/06/36	2.891	200	156	24,325	2036/4/6
UNP 3.799% 04/06/71	3.799	100	68	10,683	2071/4/6
UNP 4.75% 02/21/26	4.75	100	99	15,448	2026/2/21
UNP 4.95% 05/15/53	4.95	100	90	14,125	2053/5/15
UPS 5.05% 03/03/53	5.05	100	91	14,271	2053/3/3
UPS 5.3% 04/01/50	5.3	200	190	29,633	2050/4/1
USB 4.548% 07/22/28	4.548	200	193	30,136	2028/7/22
USB 4.967% 07/22/33	4.967	100	91	14,308	2033/7/22
USB 5.727% 10/21/26	5.727	400	399	62,299	2026/10/21
V 1.1% 02/15/31	1.1	100	77	12,060	2031/2/15
V 1.9% 04/15/27	1.9	100	91	14,250	2027/4/15
V 3.65% 09/15/47	3.65	100	75	11,753	2047/9/15
VALEBZ 3.75% 07/08/30	3.75	100	88	13,735	2030/7/8
VLO 2.15% 09/15/27	2.15	100	90	14,024	2027/9/15
VLO 3.65% 12/01/51	3.65	100	67	10,512	2051/12/1
VMC 4.7% 03/01/48	4.7	100	84	13,129	2048/3/1
VMD 4.65% 05/15/27	4.65	100	97	15,160	2027/5/15
VOD 5.25% 05/30/48	5.25	100	89	13,958	2048/5/30
VOD 5.625% 02/10/53	5.625	100	93	14,511	2053/2/10
VTR 2.5% 09/01/31	2.5	100	80	12,470	2031/9/1
VTR 3% 01/15/30	3.0	100	85	13,382	2030/1/15
VTRS 3.85% 06/22/40	3.85	100	70	10,929	2040/6/22
VTRS 5.2% 04/15/48	5.2	100	78	12,201	2048/4/15

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
VZ 1.45% 03/20/26	1.45	200	185	28,951	2026/3/20	
VZ 2.1% 03/22/28	2.1	200	176	27,558	2028/3/22	
VZ 2.55% 03/21/31	2.55	100	82	12,897	2031/3/21	
VZ 3.15% 03/22/30	3.15	100	88	13,735	2030/3/22	
VZ 3.4% 03/22/41	3.4	100	74	11,555	2041/3/22	
VZ 3.7% 03/22/61	3.7	100	67	10,588	2061/3/22	
VZ 4.812% 03/15/39	4.812	200	180	28,139	2039/3/15	
VZ 4.862% 08/21/46	4.862	100	87	13,694	2046/8/21	
WBD 3.625% 05/10/30	3.625	100	86	13,545	2030/5/15	
WBD 3.95% 03/20/28	3.95	200	185	28,939	2028/3/20	
WBD 4.65% 05/15/50	4.65	100	72	11,287	2050/5/15	
WBD 5.2% 09/20/47	5.2	100	78	12,228	2047/9/20	
WDAY 3.5% 04/01/27	3.5	100	94	14,764	2027/4/1	
WEC 1.8% 10/15/30	1.8	100	79	12,441	2030/10/15	
WELL 2.7% 02/15/27	2.7	100	92	14,467	2027/2/15	
WFC 2.572% 02/11/31	2.572	100	84	13,154	2031/2/11	
WFC 3.526% 03/24/28	3.526	100	94	14,688	2028/3/24	
WFC 4.54% 08/15/26	4.54	200	196	30,638	2026/8/15	
WFC 4.611% 04/25/53	4.611	100	82	12,887	2053/4/25	
WFC 4.808% 07/25/28	4.808	100	97	15,184	2028/7/25	
WFC 4.897% 07/25/33	4.897	200	187	29,166	2033/7/25	
WFC 5.557% 07/25/34	5.557	200	194	30,332	2034/7/25	
WFC 5.574% 07/25/29	5.574	200	199	31,007	2029/7/25	
WFC 5.95% 12/15/36	5.95	200	197	30,741	2036/12/15	
WHR 4.6% 05/15/50	4.6	100	76	11,977	2050/5/15	
WLK 2.875% 08/15/41	2.875	100	65	10,206	2041/8/15	
WM 0.75% 11/15/25	0.75	100	93	14,515	2025/11/15	
WM 4.875% 02/15/34	4.875	100	95	14,930	2034/2/15	
WMB 3.95% 05/15/50	3.95	100	73	11,500	2050/5/15	
WMB 4% 03/15/28	4.0	100	94	14,751	2028/3/15	
WMB 4.85% 03/01/48	4.85	100	83	13,066	2048/3/1	
WMT 1.05% 09/17/26	1.05	300	273	42,635	2026/9/17	
WMT 1.8% 09/22/31	1.8	100	80	12,532	2031/9/22	
WMT 2.65% 09/22/51	2.65	100	61	9,514	2051/9/22	
WMT 3.95% 06/28/38	3.95	100	87	13,555	2038/6/28	
WMT 4% 04/15/26	4.0	200	196	30,585	2026/4/15	
WMT 4.05% 06/29/48	4.05	100	81	12,709	2048/6/29	
WPC 2.4% 02/01/31	2.4	100	81	12,663	2031/2/1	
WSTP 1.15% 06/03/26	1.15	200	183	28,607	2026/6/3	
WSTP 3.02% 11/18/36	3.02	200	160	25,072	2036/11/18	
WSTP 3.133% 11/18/41	3.133	100	67	10,533	2041/11/18	
WSTP 5.457% 11/18/27	5.457	100	100	15,690	2027/11/18	
WTRG 2.4% 05/01/31	2.4	100	80	12,576	2031/5/1	
WTRG 5.3% 05/01/52	5.3	100	88	13,730	2052/5/1	
WY 4.75% 05/15/26	4.75	100	98	15,338	2026/5/15	
XEL 3.6% 09/15/47	3.6	100	71	11,086	2047/9/15	
XEL 4% 06/15/28	4.0	100	93	14,631	2028/6/15	
XEL 4.1% 06/01/32	4.1	200	181	28,229	2032/6/1	
XOM 3.482% 03/19/30	3.482	100	91	14,304	2030/3/19	
XOM 4.227% 03/19/40	4.227	100	86	13,480	2040/3/19	
XOM 4.327% 03/19/50	4.327	100	82	12,858	2050/3/19	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ZBH 3.05% 01/15/26	3.05	100	95	14,928	2026/1/15	
ZTS 5.4% 11/14/25	5.4	100	99	15,545	2025/11/14	
小計				44,853,044		
(カナダ)						
国債証券						
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	300	278	31,769	2026/3/1	
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	290	274	31,349	2025/9/1	
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	540	436	49,753	2030/12/1	
CAN 1% 09/01/26	1.0	300	278	31,781	2026/9/1	
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	200	184	21,076	2027/3/1	
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	430	370	42,235	2030/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	250	236	26,946	2026/6/1	
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	840	718	81,998	2031/6/1	
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	790	668	76,270	2031/12/1	
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	630	407	46,469	2053/12/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	360	334	38,176	2028/6/1	
CAN 2% 06/01/32	2.0	690	601	68,631	2032/6/1	
CAN 2% 12/01/51	2.0	250	175	19,965	2051/12/1	
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	200	185	21,211	2029/6/1	
CAN 2.25% 12/01/29	2.25	270	249	28,479	2029/12/1	
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	350	315	35,990	2032/12/1	
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	40	36	4,179	2033/6/1	
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	150	144	16,434	2027/9/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	270	226	25,844	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	300	246	28,119	2055/12/1	
CAN 3% 04/01/26	3.0	70	68	7,787	2026/4/1	
CAN 3% 06/01/34	3.0	300	278	31,788	2034/6/1	
CAN 3% 10/01/25	3.0	540	528	60,257	2025/10/1	
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	410	399	45,531	2028/9/1	
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	300	285	32,565	2033/12/1	
CAN 3.5% 08/01/25	3.5	430	424	48,361	2025/8/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	330	316	36,073	2045/12/1	
CAN 3.75% 05/01/25	3.75	430	425	48,566	2025/5/1	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	400	409	46,699	2041/6/1	
CAN 4.5% 11/01/25	4.5	470	469	53,559	2025/11/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	450	502	57,339	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	150	163	18,641	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	180	205	23,483	2033/6/1	
地方債証券						
ALTA 1.65% 06/01/31	1.65	100	83	9,531	2031/6/1	
ALTA 2.55% 06/01/27	2.55	200	189	21,652	2027/6/1	
ALTA 2.9% 09/20/29	2.9	100	93	10,665	2029/9/20	
ALTA 2.95% 06/01/52	2.95	200	145	16,630	2052/6/1	
ALTA 4.15% 06/01/33	4.15	100	97	11,093	2033/6/1	
BRCOL 1.55% 06/18/31	1.55	200	165	18,887	2031/6/18	
BRCOL 2.95% 06/18/50	2.95	200	146	16,657	2050/6/18	
BRCOL 2.95% 12/18/28	2.95	100	94	10,787	2028/12/18	
BRCOL 3.2% 06/18/44	3.2	100	79	9,067	2044/6/18	
BRCOL 5.62% 08/17/28	5.62	100	105	11,987	2028/8/17	
MP 2.85% 09/05/46	2.85	100	72	8,215	2046/9/5	
MP 3.2% 03/05/50	3.2	200	150	17,213	2050/3/5	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MP 3.25% 09/05/29	3.25	100	95	10,835	2029/9/5
MP 6.3% 03/05/31	6.3	100	111	12,662	2031/3/5
NBRNS 2.9% 08/14/52	2.9	100	70	8,041	2052/8/14
NBRNS 5.5% 01/27/34	5.5	100	106	12,153	2034/1/27
NF 1.25% 06/02/27	1.25	100	90	10,375	2027/6/2
NF 2.65% 10/17/50	2.65	100	64	7,396	2050/10/17
NF 3.15% 12/02/52	3.15	200	143	16,320	2052/12/2
NF 3.7% 10/17/48	3.7	200	160	18,323	2048/10/17
NS 3.15% 12/01/51	3.15	100	74	8,506	2051/12/1
NS 4.05% 06/01/29	4.05	200	197	22,578	2029/6/1
NS 4.4% 06/01/42	4.4	100	94	10,772	2042/6/1
ONT 1.35% 09/08/26	1.35	300	279	31,878	2026/9/8
ONT 1.55% 11/01/29	1.55	300	260	29,693	2029/11/1
ONT 1.9% 12/02/51	1.9	200	114	13,039	2051/12/2
ONT 2.25% 12/02/31	2.25	100	86	9,825	2031/12/2
ONT 2.55% 12/02/52	2.55	100	66	7,587	2052/12/2
ONT 2.6% 06/02/27	2.6	200	190	21,687	2027/6/2
ONT 2.65% 12/02/50	2.65	100	68	7,857	2050/12/2
ONT 2.8% 06/02/48	2.8	200	144	16,434	2048/6/2
ONT 2.9% 12/02/46	2.9	400	296	33,858	2046/12/2
ONT 3.4% 09/08/28	3.4	200	193	22,051	2028/9/8
ONT 3.45% 06/02/45	3.45	200	165	18,824	2045/6/2
ONT 3.5% 06/02/43	3.5	400	336	38,417	2043/6/2
ONT 3.65% 06/02/33	3.65	100	93	10,666	2033/6/2
ONT 3.75% 06/02/32	3.75	100	95	10,854	2032/6/2
ONT 4.15% 06/02/34	4.15	500	482	55,050	2034/6/2
ONT 4.65% 06/02/41	4.65	200	197	22,541	2041/6/2
ONT 5.6% 06/02/35	5.6	300	325	37,154	2035/6/2
ONT 6.2% 06/02/31	6.2	100	110	12,653	2031/6/2
ONT 6.5% 03/08/29	6.5	100	109	12,514	2029/3/8
ONT 8% 06/02/26	8.0	400	427	48,790	2026/6/2
Q 1.9% 09/01/30	1.9	100	86	9,890	2030/9/1
Q 2.6% 07/06/25	2.6	200	195	22,261	2025/7/6
Q 2.75% 09/01/25	2.75	200	195	22,243	2025/9/1
Q 2.75% 09/01/28	2.75	200	188	21,476	2028/9/1
Q 3.1% 12/01/51	3.1	300	225	25,711	2051/12/1
Q 3.25% 09/01/32	3.25	200	183	20,875	2032/9/1
Q 3.5% 12/01/45	3.5	300	248	28,288	2045/12/1
Q 3.6% 09/01/33	3.6	300	278	31,746	2033/9/1
Q 3.65% 05/20/32	3.65	100	94	10,811	2032/5/20
Q 4.4% 12/01/55	4.4	200	190	21,704	2055/12/1
Q 5% 12/01/41	5.0	200	205	23,416	2041/12/1
Q 6% 10/01/29	6.0	100	108	12,341	2029/10/1
SCDA 2.65% 06/02/27	2.65	200	190	21,711	2027/6/2
SCDA 3.75% 03/05/54	3.75	100	84	9,628	2054/3/5
SCDA 4.2% 12/02/54	4.2	100	91	10,451	2054/12/2
SCDA 4.75% 06/01/40	4.75	100	99	11,366	2040/6/1
特殊債券(除く金融債)					
ASIA 0.75% 02/10/26	0.75	100	93	10,661	2026/2/10
ASIA 1.5% 05/04/28	1.5	100	89	10,263	2028/5/4
CANHOU 0.95% 06/15/25	0.95	100	95	10,937	2025/6/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CANHOU 1.1% 03/15/31	1.1	200	163	18,681	2031/3/15
CANHOU 1.1% 12/15/26	1.1	400	368	41,997	2026/12/15
CANHOU 1.25% 06/15/26	1.25	100	93	10,674	2026/6/15
CANHOU 1.4% 03/15/31	1.4	300	251	28,630	2031/3/15
CANHOU 1.75% 06/15/30	1.75	300	267	29,814	2030/6/15
CANHOU 1.95% 12/15/25	1.95	200	191	21,884	2025/12/15
CANHOU 2.15% 12/15/31	2.15	100	86	9,910	2031/12/15
CANHOU 2.65% 12/15/28	2.65	100	93	10,697	2028/12/15
CANHOU 3.1% 06/15/28	3.1	100	95	10,945	2028/6/15
CANHOU 3.55% 09/15/32	3.55	200	190	21,757	2032/9/15
CANHOU 3.6% 12/15/27	3.6	300	293	33,524	2027/12/15
CANHOU 3.65% 06/15/33	3.65	100	95	10,891	2033/6/15
CANHOU 3.8% 06/15/27	3.8	100	98	11,258	2027/6/15
CANHOU 3.95% 06/15/28	3.95	200	198	22,621	2028/6/15
CANHOU 4.15% 06/15/33	4.15	200	198	22,639	2033/6/15
CANHOU 4.25% 03/15/34	4.25	400	399	45,524	2034/3/15
IADB 1% 06/29/26	1.0	100	92	10,583	2026/6/29
IBRD 4.25% 09/18/30	4.25	100	99	11,401	2030/9/18
KFW 0.75% 02/19/26	0.75	100	93	10,651	2026/2/19
QHEL 2% 09/01/28	2.0	100	91	10,386	2028/9/1
QHEL 3.4% 09/01/29	3.4	200	191	21,850	2029/9/1
QHEL 4% 02/15/55	4.0	100	88	10,066	2055/2/15
QHEL 4% 02/15/63	4.0	400	351	40,144	2063/2/15
QHEL 5% 02/15/50	5.0	100	103	11,839	2050/2/15
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ALACN 4.638% 05/15/26	4.638	100	99	11,296	2026/5/15
BAC 3.615% 03/16/28	3.615	100	96	10,953	2028/3/16
BCECN 3% 03/17/31	3.0	100	87	10,008	2031/3/17
BCECN 5.15% 02/09/53	5.15	100	92	10,507	2053/2/9
BMO 1.928% 07/22/31	1.928	100	93	10,623	2031/7/22
BMO 4.537% 12/18/28	4.537	100	98	11,222	2028/12/18
BMO 4.709% 12/07/27	4.709	100	99	11,325	2027/12/7
BNCN 4.82% 01/28/26	4.82	100	99	11,360	2026/1/28
BNP 2.538% 07/13/29	2.538	200	181	20,746	2029/7/13
BNS 5.5% 05/08/26	5.5	100	100	11,509	2026/5/8
BNS 5.679% 08/02/33	5.679	200	202	23,079	2033/8/2
CAECN 5.541% 06/12/28	5.541	100	100	11,480	2028/6/12
CM 2.25% 01/07/27	2.25	200	186	21,290	2027/1/7
CM 4.95% 06/29/27	4.95	100	100	11,407	2027/6/29
CNQCEN 2.5% 01/17/28	2.5	100	91	10,458	2028/1/17
CNQCEN 4.85% 05/30/47	4.85	100	88	10,041	2047/5/30
CNRCN 3.2% 07/31/28	3.2	100	94	10,796	2028/7/31
CNRCN 3.6% 02/08/49	3.6	100	78	8,953	2049/2/8
CP 2.54% 02/28/28	2.54	100	92	10,545	2028/2/28
CPXCN 4.424% 02/08/30	4.424	200	189	21,646	2030/2/8
CUCN 4.851% 06/03/52	4.851	200	188	21,478	2052/6/3
CVECN 3.5% 02/07/28	3.5	100	94	10,833	2028/2/7
ENBNCN 5.7% 11/09/27	5.7	100	102	11,655	2027/11/9
ENBNCN 6.1% 11/09/32	6.1	100	104	11,964	2032/11/9
FFHCN 3.95% 03/03/31	3.95	100	91	10,436	2031/3/3
FTSCN 4.431% 05/31/29	4.431	100	98	11,214	2029/5/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
GWOCN 2.981% 07/08/50	2.981	100	69	7,871	2050/7/8
HYDONE 4.17% 06/06/44	4.17	100	88	10,067	2044/6/6
HYDONE 4.91% 01/27/28	4.91	100	100	11,502	2028/1/27
LCN 2.284% 05/07/30	2.284	100	86	9,911	2030/5/7
MBGGR 5.14% 06/29/26	5.14	100	100	11,448	2026/6/29
MFCFN 5.409% 03/10/33	5.409	100	100	11,494	2033/3/10
MGCN 4.95% 01/31/31	4.95	100	99	11,330	2031/1/31
MRUCN 4.27% 12/04/47	4.27	100	84	9,636	2047/12/4
NACN 5.296% 11/03/25	5.296	100	100	11,428	2025/11/3
NESNW 2.192% 01/26/29	2.192	100	90	10,288	2029/1/26
NGLN 5.221% 09/16/31	5.221	100	99	11,358	2031/9/16
PPLCN 5.21% 01/12/34	5.21	100	97	11,152	2034/1/12
PSPCAP 3% 11/05/25	3.0	150	146	16,687	2025/11/5
RCICN 5.25% 04/15/52	5.25	100	92	10,563	2052/4/15
RCICN 6.75% 11/09/39	6.75	100	109	12,432	2039/11/9
REIUCN 4.628% 05/01/29	4.628	100	95	10,934	2029/5/1
REIUCN 6.488% 09/29/26	6.488	200	200	22,852	2026/9/29
RY 2.088% 06/30/30	2.088	100	96	10,987	2030/6/30
RY 2.328% 01/28/27	2.328	100	93	10,673	2027/1/28
SLFCN 2.58% 05/10/32	2.58	100	93	10,623	2032/5/10
SRUCN 3.192% 06/11/27	3.192	100	93	10,654	2027/6/11
T(AT&T) 4% 11/25/25	4.0	150	147	16,788	2025/11/25
TCN 2.35% 01/27/28	2.35	100	91	10,405	2028/1/27
TCN 5.65% 09/13/52	5.65	100	97	11,175	2052/9/13
TD 1.896% 09/11/28	1.896	300	267	30,532	2028/9/11
TD 2.26% 01/07/27	2.26	100	93	10,663	2027/1/7
TD 2.667% 09/09/25	2.667	100	96	11,038	2025/9/9
TD 4.68% 01/08/29	4.68	100	99	11,307	2029/1/8
TD 5.177% 04/09/34	5.177	200	198	22,659	2034/4/9
TD 5.423% 07/10/26	5.423	100	100	11,509	2026/7/10
TOYOTA 5.16% 07/12/28	5.16	200	202	23,101	2028/7/12
TOYOTA 5.29% 07/13/26	5.29	200	201	22,986	2026/7/13
TRPCN 3.3% 07/17/25	3.3	100	97	11,160	2025/7/17
TRPCN 5.92% 05/12/52	5.92	100	101	11,534	2052/5/12
WFC 2.568% 05/01/26	2.568	100	97	11,101	2026/5/1
小 計				3,609,942	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	1,300	1,307	11,849	2036/11/20
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	3,200	2,830	25,648	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	4,000	3,672	33,273	2026/3/5
MBONO 7% 09/03/26	7.0	3,600	3,338	30,248	2026/9/3
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	3,700	3,164	28,677	2033/5/26
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	5,850	5,429	49,199	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	5,750	5,102	46,232	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	4,600	3,726	33,768	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	2,000	1,715	15,543	2034/11/23
MBONO 8% 07/31/53	8.0	3,000	2,442	22,132	2053/7/31
MBONO 8% 11/07/47	8.0	4,220	3,469	31,434	2047/11/7
MBONO 8.5% 03/01/29	8.5	1,000	942	8,543	2029/3/1
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	7,100	6,679	60,517	2029/5/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	2,150	1,909	17,300	2038/11/18
小 計				414,370	
(コロンビア)		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
国債証券					
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	1,300,000	1,256,063	49,403	2027/6/28
COLTES 13.25% 02/09/33	13.25	1,000,000	1,131,293	44,496	2033/2/9
COLTES 9.25% 05/28/42	9.25	1,200,000	1,010,017	39,726	2042/5/28
小 計				133,625	
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
DBR 0% 02/15/30	—	500	432	72,173	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	890	750	125,366	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	1,220	1,002	167,431	2032/2/15
DBR 0% 05/15/36	—	500	363	60,646	2036/5/15
DBR 0% 08/15/29	—	1,030	900	150,471	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	1,000	853	142,653	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	950	791	132,156	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	700	345	57,718	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	510	239	39,943	2052/8/15
DBR 0% 11/15/28	—	350	311	52,014	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	300	279	46,738	2027/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	550	497	83,168	2028/8/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	400	372	62,215	2027/8/15
DBR 1% 05/15/38	1.0	420	335	55,966	2038/5/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	220	161	27,409	2048/8/15
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	220	205	34,395	2032/8/15
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	390	316	52,800	2053/8/15
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	1,230	1,198	200,201	2029/11/15
DBR 2.2% 02/15/34	2.2	500	481	80,500	2034/2/15
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	200	195	32,671	2033/2/15
DBR 2.4% 11/15/30	2.4	550	543	90,832	2030/11/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	470	448	74,975	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	260	247	41,417	2046/8/15
DBR 2.5% 08/15/54	2.5	220	208	34,850	2054/8/15
DBR 2.6% 08/15/33	2.6	520	519	86,831	2033/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	40	42	7,110	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	280	317	53,108	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	370	437	73,025	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,150	1,243	207,795	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,050	1,245	208,073	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	150	188	31,432	2040/7/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	450	495	82,804	2028/1/4
OBL 0% 04/16/27	—	400	368	61,611	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	740	690	115,367	2026/10/9
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	500	477	79,687	2027/10/15
OBL 2.4% 10/19/28	2.4	810	801	133,857	2028/10/19
地方債証券					
BAYERN 0.01% 01/18/35	0.01	100	72	12,111	2035/1/18
BAYERN 0.01% 05/07/29	0.01	100	86	14,374	2029/5/7
BAYERN 0.03% 04/03/28	0.03	100	88	14,844	2028/4/3
BERGER 0.01% 03/25/26	0.01	200	188	31,408	2026/3/25

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BERGER 0.01% 07/02/30	0.01	100	83	13,891	2030/7/2
BERGER 0.125% 06/04/35	0.125	100	72	12,049	2035/6/4
BERGER 0.125% 11/24/45	0.125	200	102	17,069	2045/11/24
BERGER 0.625% 01/26/52	0.625	100	51	8,604	2052/1/26
BERGER 0.625% 07/15/39	0.625	100	68	11,426	2039/7/15
HESLAN 2.375% 09/21/26	2.375	100	97	16,332	2026/9/21
HESLAN 2.625% 08/24/27	2.625	100	96	16,078	2027/8/24
HESLAN 4% 02/04/30	4.0	100	101	16,917	2030/2/4
HESSEN 0% 06/10/26	—	200	186	31,209	2026/6/10
HESSEN 1.3% 10/10/33	1.3	100	85	14,328	2033/10/10
HESSEN 2.875% 01/10/33	2.875	100	98	16,504	2033/1/10
LANDER 0.01% 02/04/31	0.01	100	81	13,653	2031/2/4
LANDER 1.25% 05/04/29	1.25	100	91	15,332	2029/5/4
NIESA 0% 02/11/27	—	100	91	15,297	2027/2/11
NIESA 0% 09/15/25	—	100	95	15,951	2025/9/15
NIESA 0.01% 03/17/26	0.01	300	282	47,133	2026/3/17
NIESA 0.05% 03/09/35	0.05	100	71	12,004	2035/3/9
NIESA 1.125% 09/12/33	1.125	100	84	14,081	2033/9/12
NRW 0% 05/05/25	—	100	96	16,123	2025/5/5
NRW 0% 10/12/35	—	100	69	11,669	2035/10/12
NRW 0.25% 03/13/26	0.25	300	283	47,352	2026/3/13
NRW 0.375% 09/02/50	0.375	100	48	8,049	2050/9/2
NRW 0.5% 11/25/39	0.5	100	66	11,043	2039/11/25
NRW 0.6% 06/04/41	0.6	100	64	10,777	2041/6/4
NRW 1.45% 01/19/22	1.45	200	99	16,676	2122/1/19
NRW 1.65% 05/16/47	1.65	100	72	12,177	2047/5/16
NRW 2.25% 06/14/52	2.25	100	79	13,332	2052/6/14
NRW 2.75% 01/15/32	2.75	100	98	16,377	2032/1/15
NRW 3% 01/27/28	3.0	200	199	33,294	2028/1/27
NRW 3.4% 03/07/2073	3.4	100	102	17,064	2073/3/7
SACHAN 0.125% 06/21/29	0.125	100	86	14,417	2029/6/21
SACHAN 3.15% 02/06/54	3.15	200	194	32,417	2054/2/6
特殊債券 (除く金融債)					
DBHNGR 1.875% 05/24/30	1.875	100	92	15,534	2030/5/24
DBHNGR 4% 11/23/43	4.0	200	204	34,185	2043/11/23
KFW 0% 01/10/31	—	200	164	27,420	2031/1/10
KFW 0% 03/31/27	—	100	91	15,281	2027/3/31
KFW 0% 09/30/26	—	100	92	15,497	2026/9/30
KFW 0.125% 01/09/32	0.125	300	241	40,388	2032/1/9
KFW 0.125% 06/30/25	0.125	200	192	32,163	2025/6/30
KFW 0.375% 05/20/36	0.375	100	72	12,121	2036/5/20
KFW 1.25% 06/30/27	1.25	200	189	31,605	2027/6/30
KFW 2% 11/15/29	2.0	100	95	15,883	2029/11/15
KFW 2.5% 11/19/25	2.5	200	197	33,020	2025/11/19
KFW 2.75% 02/14/33	2.75	100	98	16,380	2033/2/14
KFW 2.75% 03/15/28	2.75	800	792	132,387	2028/3/15
KFW 2.875% 05/29/26	2.875	600	596	99,591	2026/5/29
LBANK 0.375% 02/25/27	0.375	100	92	15,437	2027/2/25
LBANK 0.75% 03/16/32	0.75	100	84	14,062	2032/3/16
NRWBK 0% 05/14/29	—	100	85	14,326	2029/5/14
NRWBK 0.1% 07/09/35	0.1	100	71	11,867	2035/7/9

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NRWBK 0.75% 06/30/28	0.75	100	90	15,180	2028/6/30
NRWBK 1.25% 05/13/49	1.25	100	63	10,634	2049/5/13
NRWBK 1.625% 08/03/32	1.625	100	89	14,961	2032/8/3
NRWBK 2.875% 04/05/33	2.875	100	98	16,425	2033/4/5
RENTEN 0% 12/13/28	—	100	87	14,550	2028/12/13
RENTEN 0.01% 11/26/40	0.01	100	58	9,773	2040/11/26
RENTEN 0.05% 01/31/31	0.05	100	81	13,681	2031/1/31
RENTEN 0.1% 03/08/27	0.1	100	91	15,341	2027/3/8
RENTEN 2.75% 02/16/32	2.75	200	195	32,713	2032/2/16
RENTEN 3% 11/14/34	3.0	100	99	16,571	2034/11/14
RENTEN 3.25% 09/06/30	3.25	500	506	84,612	2030/9/6
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ALVGR 2.121% 07/08/50	2.121	100	87	14,632	2050/7/8
ALVGR 4.252% 07/05/52	4.252	100	97	16,356	2052/7/5
ANNGR 0.375% 06/16/27	0.375	100	89	14,924	2027/6/16
ANNGR 0.625% 12/14/29	0.625	100	82	13,698	2029/12/14
ANNGR 1.375% 01/28/26	1.375	300	286	47,860	2026/1/28
BASGR 3.125% 06/29/28	3.125	100	99	16,541	2028/6/29
BASGR 3.75% 06/29/32	3.75	100	99	16,689	2032/6/29
BAYNGR 0.75% 01/06/27	0.75	100	91	15,318	2027/1/6
BAYNGR 1% 01/12/36	1.0	100	69	11,537	2036/1/12
BAYNGR 1.125% 01/06/30	1.125	100	84	14,161	2030/1/6
BERTEL 2% 04/01/28	2.0	100	94	15,801	2028/4/1
BYLAN 1.375% 11/22/32	1.375	100	85	14,362	2032/11/22
CMZB 2.75% 12/08/25	2.75	200	197	33,052	2025/12/8
CMZB 2.875% 04/28/26	2.875	100	99	16,547	2026/4/28
CMZB 3.125% 04/20/29	3.125	100	99	16,626	2029/4/20
CONGR 3.625% 11/30/27	3.625	100	99	16,668	2027/11/30
DAIGR 0.75% 09/10/30	0.75	100	85	14,321	2030/9/10
DAIGR 2% 08/22/26	2.0	100	96	16,183	2026/8/22
DB 0.75% 02/17/27	0.75	200	188	31,490	2027/2/17
DB 2.625% 06/30/37	2.625	200	185	30,915	2037/6/30
DB 4% 11/29/27	4.0	100	101	16,878	2027/11/29
DBOERS 1.625% 10/08/25	1.625	100	97	16,307	2025/10/8
DHLGR 0.375% 05/20/26	0.375	100	94	15,773	2026/5/20
DWINIGY 1.5% 04/30/30	1.5	200	172	28,760	2030/4/30
ENBW 1.625% 08/05/79	1.625	100	90	15,180	2079/8/5
ENBW 2.125% 08/31/2081	2.125	100	80	13,482	2081/8/31
EOANGR 0.375% 09/29/27	0.375	100	90	15,073	2027/9/29
EOANGR 1% 10/07/25	1.0	100	96	16,109	2025/10/7
EOANGR 2.875% 08/26/28	2.875	100	97	16,370	2028/8/26
EOANGR 3.875% 01/12/35	3.875	100	100	16,758	2035/1/12
EOANGR 4% 08/29/33	4.0	100	102	17,043	2033/8/29
EVKGR 2.25% 09/25/27	2.25	100	95	15,937	2027/9/25
FREGR 1.875% 05/24/25	1.875	100	98	16,373	2025/5/24
FREGR 4.25% 05/28/26	4.25	100	100	16,817	2026/5/28
HEIGR 3.75% 05/31/32	3.75	200	197	33,012	2032/5/31
HYB 0.375% 01/17/33	0.375	100	78	13,141	2033/1/17
HYB 3% 07/13/26	3.0	100	99	16,544	2026/7/13
IFXGR 2% 06/24/32	2.0	100	89	14,868	2032/6/24
LBWB 0.375% 02/21/31	0.375	100	78	13,114	2031/2/21

銘柄	利率 (%)	期	末		
			額面金額	評価額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
LBBW 0.375% 02/28/28	0.375	100	87	14,627	2028/2/28
LBBW 0.375% 05/07/29	0.375	100	84	14,085	2029/5/7
LEGR 0.375% 01/17/26	0.375	100	93	15,700	2026/1/17
LEGR 0.875% 11/28/27	0.875	100	90	15,149	2027/11/28
LXSG 0.625% 12/01/29	0.625	100	81	13,630	2029/12/1
MBGG 0.75% 02/08/30	0.75	100	86	14,507	2030/2/8
MBGR 1.625% 09/09/2080	1.625	100	94	15,785	2080/9/9
MUNRE 1% 05/26/42	1.0	100	78	13,081	2042/5/26
NDB 2.25% 09/20/27	2.25	500	482	80,681	2027/9/20
NDB 2.875% 03/19/30	2.875	200	195	32,734	2030/3/19
NDB 4.875% 07/11/28	4.875	100	104	17,479	2028/7/11
RWE 2.125% 05/24/26	2.125	100	97	16,228	2026/5/24
RWE 2.75% 05/24/30	2.75	100	94	15,802	2030/5/24
SAPGR 0.375% 05/18/29	0.375	100	86	14,518	2029/5/18
VW 4.75% 09/25/31	4.75	100	104	17,476	2031/9/25
(イタリヤ)					
国債証券					
BTPS 0% 04/01/26	—	100	93	15,641	2026/4/1
BTPS 0% 08/01/26	—	160	148	24,752	2026/8/1
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	190	168	28,121	2028/3/15
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	100	86	14,497	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	250	237	39,664	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	210	186	31,091	2028/7/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	150	120	20,199	2031/8/1
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	200	186	31,221	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	270	224	37,576	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	250	172	28,762	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	270	217	36,416	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	200	170	28,483	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	90	83	13,872	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	230	188	31,493	2031/12/1
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	300	280	46,916	2027/4/1
BTPS 1.2% 08/15/25	1.2	330	320	53,511	2025/8/15
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	300	284	47,481	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	350	308	51,611	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	100	75	12,642	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	620	607	101,416	2025/5/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	170	105	17,577	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	250	244	40,863	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	150	144	24,145	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	320	275	46,009	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	300	265	44,312	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	210	124	20,764	2051/9/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	330	232	38,833	2041/3/1
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	300	294	49,164	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	200	190	31,769	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	200	195	32,673	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	560	536	89,702	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	170	165	27,609	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	110	65	11,000	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	160	103	17,276	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	420	405	67,731	2027/6/1

銘柄	利率 (%)	期	末		
			額面金額	評価額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	490	403	67,452	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	100	89	14,893	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	280	197	33,001	2050/9/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	530	522	87,301	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	290	262	43,927	2032/12/1
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	390	380	63,503	2027/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	220	168	28,142	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	140	99	16,697	2067/3/1
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	150	145	24,232	2029/6/15
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	300	291	48,771	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	180	156	26,069	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	280	273	45,660	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	260	225	37,668	2040/3/1
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	240	216	36,130	2038/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	310	261	43,749	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	220	207	34,643	2035/3/1
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	100	99	16,684	2028/4/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	280	242	40,502	2048/3/1
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	600	600	100,231	2026/1/15
BTPS 3.5% 02/15/31	3.5	150	148	24,797	2031/2/15
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	450	449	75,008	2030/3/1
BTPS 3.6% 09/29/25	3.6	300	300	50,157	2025/9/29
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	180	180	30,205	2030/6/15
BTPS 3.8% 04/15/26	3.8	300	301	50,427	2026/4/15
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	200	202	33,851	2028/8/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	210	192	32,208	2049/9/1
BTPS 3.85% 09/15/26	3.85	180	181	30,346	2026/9/15
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	350	355	59,323	2029/12/15
BTPS 4% 02/01/37	4.0	440	436	72,997	2037/2/1
BTPS 4% 04/30/35	4.0	140	140	23,430	2035/4/30
BTPS 4% 10/30/31	4.0	150	153	25,572	2031/10/30
BTPS 4% 11/15/30	4.0	250	255	42,613	2030/11/15
BTPS 4.1% 02/01/29	4.1	400	410	68,611	2029/2/1
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	150	147	24,651	2039/10/1
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	240	245	40,949	2034/3/1
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	520	538	89,944	2033/11/1
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	450	469	78,347	2033/5/1
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	100	100	16,842	2043/9/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	80	81	13,604	2026/3/1
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	160	161	26,915	2053/10/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	400	420	70,276	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	230	241	40,385	2044/9/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	330	358	59,957	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	310	335	55,968	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	330	356	59,631	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	430	467	78,084	2029/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	350	399	66,711	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	400	458	76,587	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	200	220	36,815	2027/11/1
普通社債券					
(含む投資法人債券)					
ACEIM 3.875% 01/24/31	3.875	200	199	33,326	2031/1/24

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AEMSPA 0.625% 07/15/31	0.625	100	79	13,230	2031/7/15
ASSGEN 3.875% 01/29/29	3.875	100	99	16,595	2029/1/29
ASSGEN 5.272% 09/12/33	5.272	200	208	34,863	2033/9/12
ATIM 1% 11/25/26	1.0	100	92	15,534	2026/11/25
ATIM 1.5% 01/25/30	1.5	100	87	14,552	2030/1/25
ATOSTR 1.625% 01/25/28	1.625	100	91	15,290	2028/1/25
ATOSTR 2% 01/15/30	2.0	100	89	14,881	2030/1/15
ATOSTR 4.75% 01/24/31	4.75	100	102	17,057	2031/1/24
BACRED 4.75% 03/14/28	4.75	100	102	17,092	2028/3/14
BAMIM 4.875% 01/17/30	4.875	200	203	33,962	2030/1/17
ENELIM 6.625% PERP	6.625	100	108	18,043	—
ENIIM 2.625% PERP	2.625	100	97	16,208	—
ENIM 4.25% 05/19/33	4.25	100	102	17,052	2033/5/19
HERIM 0.25% 12/03/30	0.25	100	79	13,278	2030/12/3
HERIM 4.25% 04/20/33	4.25	100	100	16,860	2033/4/20
IGIM 0.5% 02/16/33	0.5	100	74	12,397	2033/2/16
IGIM 3.125% 02/08/29	3.125	100	96	16,176	2029/2/8
ISPIM 5% 03/08/28	5.0	150	153	25,721	2028/3/8
ISPIM 5.625% 03/08/33	5.625	150	163	27,263	2033/3/8
SRGIM 1% 09/12/34	1.0	100	74	12,504	2034/9/12
SRGIM 3.375% 12/05/26	3.375	100	98	16,536	2026/12/5
TRNIM 0.375% 06/23/29	0.375	100	85	14,232	2029/6/23
UCGIM 0.325% 01/19/26	0.325	100	94	15,746	2026/1/19
UCGIM 0.925% 01/18/28	0.925	100	92	15,468	2028/1/18
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/26	—	400	377	63,124	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	600	551	92,142	2027/2/25
FRTR 0% 05/25/32	—	400	314	52,594	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	1,000	851	142,238	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	670	553	92,464	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	630	504	84,210	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	490	456	76,277	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	1,380	1,337	223,449	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	580	550	91,879	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	800	709	118,527	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	450	290	48,575	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	200	72	12,091	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	290	167	28,027	2044/6/25
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	900	829	138,505	2028/2/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	650	596	99,588	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	520	268	44,773	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	490	246	41,183	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	940	853	142,550	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	750	706	118,045	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	500	482	80,680	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	810	679	113,477	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	660	530	88,538	2036/5/25
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	300	230	38,457	2038/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	800	726	121,356	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	470	310	51,940	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	190	121	20,245	2066/5/25

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	470	382	63,890	2039/6/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	400	303	50,773	2048/5/25
FRTR 2% 11/25/32	2.0	730	673	112,441	2032/11/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	630	614	102,705	2030/5/25
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	210	181	30,372	2043/5/25
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	610	601	100,537	2026/9/24
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	450	445	74,499	2029/2/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	850	843	140,933	2027/10/25
FRTR 3% 05/25/33	3.0	760	755	126,170	2033/5/25
FRTR 3% 05/25/54	3.0	240	215	35,991	2054/5/25
FRTR 3% 06/25/49	3.0	130	119	19,960	2049/6/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	450	435	72,798	2045/5/25
FRTR 3.25% 05/25/55	3.25	150	140	23,496	2055/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	710	715	119,474	2026/4/25
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	410	422	70,619	2033/11/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	220	238	39,777	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	300	327	54,711	2029/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	320	344	57,550	2038/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	510	582	97,228	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	330	377	63,037	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	490	546	91,310	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	560	670	112,046	2032/10/25
特殊債券 (除く金融債)					
AGFRNC 0.125% 09/29/31	0.125	100	79	13,222	2031/9/29
AGFRNC 3.5% 02/25/33	3.5	200	201	33,692	2033/2/25
AGFRNC 3.75% 02/15/27	3.75	100	100	16,850	2027/2/15
CADES 0% 02/25/26	—	300	282	47,174	2026/2/25
CADES 0% 02/25/28	—	300	266	44,554	2028/2/25
CADES 0% 05/25/29	—	100	85	14,312	2029/5/25
CADES 0% 05/25/31	—	100	80	13,465	2031/5/25
CADES 0.45% 01/19/32	0.45	300	245	41,055	2032/1/19
CADES 2.75% 11/25/32	2.75	100	97	16,215	2032/11/25
CADES 2.875% 05/25/27	2.875	100	99	16,558	2027/5/25
CADES 3.125% 03/01/30	3.125	100	100	16,739	2030/3/1
EDF 3.875% 01/12/27	3.875	100	99	16,699	2027/1/12
EDF 4.375% 10/12/29	4.375	200	205	34,289	2029/10/12
EDF 4.625% 01/25/43	4.625	100	100	16,851	2043/1/25
RESFER 0.875% 01/22/29	0.875	400	358	59,829	2029/1/22
RESFER 2.25% 12/20/47	2.25	100	74	12,480	2047/12/20
RESFER 2.625% 12/29/25	2.625	100	98	16,460	2025/12/29
RESFER 3.125% 10/25/28	3.125	100	99	16,597	2028/10/25
SNCF 0.625% 04/17/30	0.625	100	85	14,304	2030/4/17
SNCF 1% 01/19/61	1.0	100	40	6,837	2061/1/19
SNCF 3.375% 05/25/33	3.375	200	199	33,396	2033/5/25
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ACACB 0.01% 04/12/28	0.01	100	88	14,710	2028/4/12
ACACB 3.25% 09/28/32	3.25	100	99	16,688	2032/9/28
ACACB 3.375% 09/04/28	3.375	500	502	83,876	2028/9/4
ACAFP 1% 07/03/29	1.0	100	88	14,705	2029/7/3
ACAFP 1% 09/18/25	1.0	100	96	16,124	2025/9/18
ACAFP 1.5% 10/06/31	1.5	200	163	27,247	2031/10/6

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ACAFP 1.875% 04/22/27	1.875	100	96	16,059	2027/4/22
ACAFP 2% 07/17/30	2.0	100	86	14,491	2030/7/17
ACAFP 4.125% 03/07/30	4.125	100	102	17,152	2030/3/7
ADFPF 1.125% 10/02/26	1.125	100	96	16,166	2026/10/2
AIFP 2.875% 09/16/32	2.875	100	96	16,054	2032/9/16
AKEFP 0.75% 12/03/29	0.75	200	170	28,455	2029/12/3
ALOPF 0.125% 07/27/27	0.125	100	88	14,812	2027/7/27
ARRFP 0% 06/19/28	—	100	86	14,500	2028/6/19
AXASA 1.875% 07/10/42	1.875	100	82	13,750	2042/7/10
AXASA 3.625% 01/10/33	3.625	100	101	17,017	2033/1/10
BFCM 0.01% 05/11/26	0.01	100	92	15,503	2026/5/11
BFCM 3.875% 01/26/28	3.875	100	100	16,706	2028/1/26
BFCM 4% 11/21/29	4.0	100	101	16,951	2029/11/21
BFCM 4.375% 01/11/34	4.375	100	97	16,244	2034/1/11
BNFP 0% 12/01/25	—	100	94	15,803	2025/12/1
BNFP 1% PERP	1.0	100	91	15,359	—
BNFP 3.071% 09/07/32	3.071	100	96	16,107	2032/9/7
BNP 0.625% 12/03/32	0.625	100	75	12,654	2032/12/3
BNP 2.125% 01/23/27	2.125	100	97	16,208	2027/1/23
BNP 2.5% 03/31/32	2.5	100	94	15,785	2032/3/31
BPCECB 1.75% 05/27/32	1.75	100	89	14,909	2032/5/27
BPCECB 3% 10/17/29	3.0	100	98	16,475	2029/10/17
BPCECB 3.125% 07/20/27	3.125	200	198	33,219	2027/7/20
BPCECB 3.25% 04/12/28	3.25	200	199	33,350	2028/4/12
BPCEGP 0.5% 09/15/27	0.5	100	92	15,400	2027/9/15
BPCEGP 0.75% 03/03/31	0.75	100	81	13,598	2031/3/3
BPCEGP 2.25% 03/02/32	2.25	100	94	15,728	2032/3/2
BPCEGP 3.625% 04/17/26	3.625	200	199	33,347	2026/4/17
CAFFIL 0.01% 02/22/28	0.01	100	88	14,746	2028/2/22
CAFFIL 0.01% 03/18/31	0.01	500	400	66,951	2031/3/18
CAFFIL 0.125% 06/30/31	0.125	100	80	13,388	2031/6/30
CAFFIL 0.5% 10/01/46	0.5	200	111	18,630	2046/10/1
CAFFIL 3.125% 11/24/33	3.125	400	394	65,916	2033/11/24
CAPP 1.875% 10/30/26	1.875	100	95	16,010	2026/10/30
CAPP 1.625% 04/15/26	1.625	100	96	16,119	2026/4/15
CAPP 2% 04/15/29	2.0	100	93	15,663	2029/4/15
CFF 0.01% 10/25/27	0.01	100	89	14,901	2027/10/25
CFF 0.01% 10/29/35	0.01	100	68	11,430	2035/10/29
CFF 0.6% 10/25/41	0.6	100	63	10,569	2041/10/25
CFF 3.375% 09/16/31	3.375	100	100	16,810	2031/9/16
CMCIB 3.125% 06/22/27	3.125	100	99	16,617	2027/6/22
CNPP 1.25% 01/23/29	1.25	100	87	14,669	2029/1/23
CNPP 5.25% 07/18/53	5.25	100	103	17,209	2053/7/18
COVFP 1.125% 09/17/31	1.125	100	82	13,723	2031/9/17
CRH 3% 01/11/30	3.0	100	98	16,484	2030/1/11
CRH 3.125% 02/23/33	3.125	400	394	65,968	2033/2/23
DECFP 1.625% 02/07/30	1.625	100	86	14,449	2030/2/7
DEXGRP 0% 01/21/28	—	100	88	14,830	2028/1/21
DEXGRP 0.01% 01/22/27	0.01	100	91	15,279	2027/1/22
DGFP 0% 11/27/28	—	100	86	14,461	2028/11/27
DGFP 0.5% 01/09/32	0.5	100	79	13,356	2032/1/9

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DSYFP 0.375% 09/16/29	0.375	100	85	14,266	2029/9/16
EDENFP 3.625% 12/13/26	3.625	100	99	16,652	2026/12/13
EFPP 0.375% 01/05/26	0.375	100	95	15,874	2026/1/5
ENFP 2.25% 06/29/29	2.25	100	94	15,724	2029/6/29
ENFP 3.25% 06/30/37	3.25	100	94	15,711	2037/6/30
ENGFP 1.75% 03/27/28	1.75	100	93	15,599	2028/3/27
ENGFP 2.125% 03/30/32	2.125	100	89	14,892	2032/3/30
ENGFP 3.625% 01/11/30	3.625	100	99	16,699	2030/1/11
ENGFP 4.5% 09/06/42	4.5	100	102	17,119	2042/9/6
GRCFP 0.875% 01/25/33	0.875	100	78	13,129	2033/1/25
HOFP 0% 03/26/26	—	100	93	15,592	2026/3/26
KERFP 3.25% 02/27/29	3.25	100	98	16,464	2029/2/27
KERFP 3.375% 02/27/33	3.375	100	96	16,188	2033/2/27
LIFP 2% 05/12/29	2.0	100	91	15,340	2029/5/12
LRFP 0.75% 05/20/30	0.75	100	86	14,408	2030/5/20
MCFP 0.375% 02/11/31	0.375	100	82	13,824	2031/2/11
NK 1% 07/15/31	1.0	100	79	13,262	2031/7/15
ORAFP 0% 06/29/26	—	100	92	15,475	2026/6/29
ORAFP 1.25% 07/07/27	1.25	100	93	15,626	2027/7/7
ORAFP 3.625% 11/16/31	3.625	100	100	16,844	2031/11/16
ORFP 0.875% 06/29/26	0.875	100	94	15,846	2026/6/29
RENAU 4.125% 12/01/25	4.125	200	200	33,455	2025/12/1
RIFP 1.375% 04/07/29	1.375	100	90	15,121	2029/4/7
RIFP 1.75% 04/08/30	1.75	100	90	15,124	2030/4/8
SANFP 1% 03/21/26	1.0	100	95	15,971	2026/3/21
SANFP 1.25% 03/21/34	1.25	100	83	13,897	2034/3/21
SOFP 1.625% 08/10/25	1.625	100	97	16,260	2025/8/10
SOFP 3.875% 11/29/30	3.875	100	100	16,850	2030/11/29
SOGEN 0.5% 06/12/29	0.5	100	86	14,434	2029/6/12
SOGEN 1.125% 06/30/31	1.125	100	92	15,505	2031/6/30
SOGEN 5.25% 09/06/32	5.25	100	102	17,078	2032/9/6
SOCFSH 0.01% 12/02/26	0.01	100	91	15,353	2026/12/2
SOCFSH 1.75% 05/05/34	1.75	100	86	14,517	2034/5/5
SOCFSH 3.125% 02/24/32	3.125	100	99	16,555	2032/2/24
SOCFSH 3.375% 07/31/30	3.375	500	503	84,154	2030/7/31
SUPP 3.375% 04/13/34	3.375	100	98	16,444	2034/4/13
SWFP 1% 07/17/28	1.0	100	90	15,468	2028/7/17
TOTAL 1.491% 04/08/27	1.491	100	94	15,770	2027/4/8
TTEFP 2.125% PERP	2.125	100	81	13,695	—
ULFP 0.625% 05/04/27	0.625	100	91	15,209	2027/5/4
ULFP 0.875% 03/29/32	0.875	100	78	13,179	2032/3/29
ULFP 1.375% 05/25/33	1.375	200	158	26,465	2033/5/25
ULFP 1.75% 02/27/34	1.75	100	82	13,710	2034/2/27
VIEFP 0% 06/09/26	—	100	92	15,480	2026/6/9
VIEFP 1.625% 09/17/30	1.625	100	88	14,782	2030/9/17
VIEFP 1.94% 01/07/30	1.94	100	91	15,250	2030/1/7
VIVFP 1.125% 12/11/28	1.125	100	94	15,809	2028/12/11
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/26	—	360	341	57,079	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	130	120	20,100	2027/1/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NETHER 0% 01/15/29	—	100	87	14,662	2029/1/15
NETHER 0% 01/15/38	—	160	106	17,804	2038/1/15
NETHER 0% 01/15/52	—	300	137	22,967	2052/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	130	109	18,311	2030/7/15
NETHER 0% 07/15/31	—	210	172	28,780	2031/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	240	231	38,655	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	170	149	24,957	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	210	145	24,279	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	170	161	26,902	2026/7/15
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	110	91	15,275	2032/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	250	234	39,115	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	330	303	50,703	2028/7/15
NETHER 2% 01/15/54	2.0	80	65	10,907	2054/1/15
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	220	216	36,160	2030/1/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	340	331	55,298	2033/1/15
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	110	106	17,825	2033/7/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	230	222	37,142	2047/1/15
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	120	124	20,801	2044/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	270	297	49,686	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	240	265	44,391	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	170	185	31,015	2028/1/15
特殊債券(除く金融債)					
BNG 0.01% 10/05/32	0.01	200	154	25,751	2032/10/5
BNG 0.125% 04/11/26	0.125	200	188	31,459	2026/4/11
BNG 0.125% 07/09/35	0.125	100	71	11,900	2035/7/9
BNG 0.75% 01/24/29	0.75	100	89	14,991	2029/1/24
BNG 0.805% 06/28/49	0.805	100	55	9,229	2049/6/28
BNG 1.25% 03/30/37	1.25	100	78	13,036	2037/3/30
BNG 2.75% 10/04/27	2.75	100	98	16,519	2027/10/4
BNG 3% 04/23/30	3.0	100	99	16,607	2030/4/23
NEDFIN 0.125% 04/03/27	0.125	100	91	15,321	2027/4/3
NEDWBK 0% 02/16/37	—	300	197	32,970	2037/2/16
NEDWBK 0.5% 04/26/51	0.5	100	49	8,206	2051/4/26
NEDWBK 0.75% 10/04/41	0.75	100	64	10,757	2041/10/4
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABNAV 0.375% 01/14/35	0.375	100	73	12,357	2035/1/14
ABNAV 3.625% 01/10/26	3.625	100	100	16,717	2026/1/10
ABNAV 5.125% 02/22/33	5.125	100	101	16,989	2033/2/22
ADNA 3.5% 04/04/28	3.5	100	100	16,730	2028/4/4
AIRFP 1.625% 06/09/30	1.625	200	180	30,164	2030/6/9
AIRFP 2.375% 06/09/40	2.375	100	82	13,776	2040/6/9
AKZANA 1.5% 03/28/28	1.5	100	92	15,372	2028/3/28
ASRVED 7% 12/07/43	7.0	100	111	18,617	2043/12/7
BATSLN 3.125% 04/07/28	3.125	100	97	16,251	2028/4/7
BMW 0% 01/11/26	—	200	189	31,662	2026/1/11
BMW 0.2% 01/11/33	0.2	100	76	12,748	2033/1/11
BMW 1% 05/22/28	1.0	100	91	15,265	2028/5/22
EDPPL 1.625% 01/26/26	1.625	100	96	16,163	2026/1/26
ENELIM 1.25% 01/17/35	1.25	100	76	12,826	2035/1/17
ENELIM 3.875% 03/09/29	3.875	100	100	16,827	2029/3/9
ENXFP 0.75% 05/17/31	0.75	100	82	13,778	2031/5/17

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
EXOIM 0.875% 01/19/31	0.875	100	83	13,904	2031/1/19
HEIANA 2.25% 03/30/30	2.25	200	186	31,122	2030/3/30
IBESM 1.874% PERP	1.874	100	95	15,933	—
INTND 0.5% 02/17/27	0.5	500	462	77,208	2027/2/17
INTND 1% 02/17/37	1.0	200	151	25,237	2037/2/17
INTND 2.75% 11/21/25	2.75	100	98	16,526	2025/11/21
INTND 3% 02/15/26	3.0	200	198	33,149	2026/2/15
INTND 3% 02/15/33	3.0	100	98	16,426	2033/2/15
INTND 4.5% 05/23/29	4.5	100	102	17,051	2029/5/23
JAPTOB 2.375 04/07/81	2.375	100	96	16,042	2081/4/7
JDFPNA 0% 01/16/26	—	200	187	31,250	2026/1/16
KPN 3.875% 02/16/36	3.875	100	97	16,327	2036/2/16
MBGR 1.375% 06/26/26	1.375	100	95	16,029	2026/6/26
NGRMV 0.875% 11/23/31	0.875	100	83	13,898	2031/11/23
NTGYSM 1.25% 01/15/26	1.25	100	95	16,013	2026/1/15
PHIANA 2.625% 05/05/33	2.625	100	88	14,787	2033/5/5
PKNA 2.031% 08/03/32	2.031	100	80	13,428	2032/8/3
RABOBK 3.064% 02/01/34	3.064	200	197	33,038	2034/2/1
RABOBK 3.822% 07/26/34	3.822	200	199	33,264	2034/7/26
RABOBK 3.875% 11/30/32	3.875	100	98	16,499	2032/11/30
RDSALN 1.5% 04/07/28	1.5	100	92	15,508	2028/4/7
RDSALN 1.875% 04/07/32	1.875	100	88	14,771	2032/4/7
SIEGR 0.375% 06/05/26	0.375	100	94	15,715	2026/6/5
SIEGR 1% 02/25/30	1.0	100	88	14,718	2030/2/25
SIEGR 3.5% 02/24/36	3.5	100	99	16,611	2036/2/24
SIEGR 3.625% 02/24/43	3.625	100	98	16,382	2043/2/24
STLA 1.25% 06/20/33	1.25	100	79	13,317	2033/6/20
STLA 2.75% 05/15/26	2.75	100	98	16,379	2026/5/15
STLA 3.75% 03/19/36	3.75	200	195	32,594	2036/3/19
TENN 0.125% 12/09/27	0.125	100	92	15,525	2027/12/9
TENN 0.875% 06/16/35	0.875	100	84	14,167	2035/6/16
TENN 2.125% 11/17/29	2.125	200	190	31,807	2029/11/17
UNANA 0.75% 02/28/26	0.75	100	95	15,937	2026/2/28
UNANA 3.25% 02/23/31	3.25	100	99	16,596	2031/2/23
VW 1.5% 01/21/41	1.5	200	135	22,637	2041/1/21
VW 3.75% 09/28/27	3.75	100	99	16,691	2027/9/28
VW 3.875% 03/29/26	3.875	300	300	50,137	2026/3/29
VW 4.125% 11/15/25	4.125	100	100	16,765	2025/11/15
VW 4.25% 02/15/28	4.25	100	101	16,943	2028/2/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/26	—	330	312	52,124	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/27	—	230	211	35,279	2027/1/31
SPGB 0% 01/31/28	—	400	356	59,633	2028/1/31
SPGB 0% 05/31/25	—	220	211	35,407	2025/5/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	260	210	35,212	2031/4/30
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	350	300	50,249	2030/4/30
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	670	551	92,091	2031/10/31
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	400	350	58,512	2029/10/31
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	370	304	50,917	2032/4/30
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	300	278	46,602	2027/7/30
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	350	311	52,043	2029/7/30

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	200	142	23,743	2037/7/30
SPGB 1% 07/30/42	1.0	100	63	10,657	2042/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	330	174	29,214	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	390	268	44,808	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	300	267	44,612	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	300	286	47,918	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	260	243	40,737	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	600	561	93,723	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	320	296	49,501	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	280	265	44,281	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	160	76	12,739	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	510	486	81,319	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/29	1.6	180	176	29,532	2029/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	290	246	41,174	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	250	163	27,349	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	290	282	47,258	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	430	401	67,149	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	360	354	59,159	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	350	322	53,931	2033/7/30
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	300	284	47,442	2032/10/31
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	270	220	36,757	2048/10/31
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	850	842	140,736	2026/5/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	270	231	38,712	2046/10/31
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	350	345	57,669	2033/4/30
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	280	275	46,104	2034/4/30
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	210	198	33,146	2043/7/30
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	200	177	29,626	2066/7/30
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	410	417	69,788	2029/5/31
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	230	233	38,945	2033/10/31
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	240	244	40,832	2039/7/30
SPGB 4% 10/31/54	4.0	90	89	14,990	2054/10/31
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	310	329	55,113	2037/1/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	350	355	59,369	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	250	279	46,702	2041/7/30
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	270	306	51,239	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	580	630	105,352	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	210	248	41,540	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	230	271	45,340	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	210	221	37,082	2026/7/30
地方債証券					
MADRID 0.16% 07/30/28	0.16	100	87	14,678	2028/7/30
MADRID 3.596% 04/30/33	3.596	100	100	16,820	2033/4/30
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABESM 1.25% 02/07/28	1.25	100	90	15,160	2028/2/7
BBVASM 1.75% 11/26/25	1.75	100	97	16,209	2025/11/26
BBVASM 3.875% 01/15/34	3.875	200	200	33,558	2034/1/15
BBVASM 5.75% 09/15/33	5.75	100	104	17,412	2033/9/15
BKTSM 1.25% 12/23/32	1.25	100	89	15,006	2032/12/23
CABKSM 0.375% 11/18/26	0.375	100	94	15,797	2026/11/18
CABKSM 0.75% 07/09/26	0.75	100	93	15,665	2026/7/9
CABKSM 5.375% 11/14/30	5.375	100	106	17,812	2030/11/14

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CABKSM 6.25% 02/23/33	6.25	100	104	17,532	2033/2/23
COLSM 0.75% 06/22/29	0.75	100	85	14,282	2029/6/22
IBESM 3.375% 11/22/32	3.375	100	98	16,376	2032/11/22
IBESM 3.625% 07/13/33	3.625	100	99	16,624	2033/7/13
MAPSM 2.875% 04/13/30	2.875	100	91	15,338	2030/4/13
MRELSM 1.75% 05/26/25	1.75	100	97	16,325	2025/5/26
REESM 4.625% PERP	4.625	200	203	33,961	—
SABSM 1.125% 03/11/27	1.125	100	95	15,890	2027/3/11
SABSM 1.75% 05/30/29	1.75	200	183	30,669	2029/5/30
SANTAN 1.625% 10/22/30	1.625	100	84	14,144	2030/10/22
SANTAN 3.375% 01/11/26	3.375	500	498	83,203	2026/1/11
SANTAN 3.375% 01/11/30	3.375	200	199	33,274	2030/1/11
SANTAN 3.75% 01/16/26	3.75	100	100	16,720	2026/1/16
SANTAN 4.25% 06/12/30	4.25	100	102	17,177	2030/6/12
TELEFO 1.788% 03/12/29	1.788	100	92	15,410	2029/3/12
TELEFO 4.055% 01/24/36	4.055	100	99	16,546	2036/1/24
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	200	180	30,209	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	—	50	40	6,900	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	170	143	23,740	2030/6/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	460	371	62,095	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	90	56	9,446	2040/6/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	60	23	4,004	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	330	320	53,521	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	210	196	32,834	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	170	156	26,110	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	200	181	30,266	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	120	114	19,191	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	180	157	26,303	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	210	180	30,229	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	110	67	11,252	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	50	40	6,720	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	120	83	14,014	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	270	186	31,075	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	130	108	18,185	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	140	101	16,894	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	60	44	7,501	2057/6/22
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	80	74	12,391	2039/4/22
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	150	145	24,350	2034/10/22
BGB 3% 06/22/33	3.0	100	99	16,583	2033/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	140	138	23,124	2034/6/22
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	100	94	15,793	2054/6/22
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	90	89	14,928	2043/6/22
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	80	78	13,064	2055/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	160	165	27,095	2045/6/22
BGB 4% 03/28/32	4.0	140	149	24,992	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	230	253	42,366	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	210	215	35,970	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	280	326	54,466	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	320	350	58,498	2028/3/28

銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABIBB 2.125% 12/02/27	2.125	100	96	16,084	2027/12/2
ABIBB 2.875% 04/02/32	2.875	100	95	15,946	2032/4/2
COFBBS 1% 01/24/28	1.0	100	89	14,934	2028/1/24
GBLEBB 0.125% 01/28/31	0.125	100	79	13,242	2031/1/28
KBCBB 0.125% 01/14/29	0.125	100	87	14,587	2029/1/14
KBCBB 4.375% 11/23/27	4.375	100	101	16,943	2027/11/23
PROXBB 4% 03/08/30	4.0	100	101	16,986	2030/3/8
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	100	84	14,112	2030/2/20
RAGB 0% 02/20/31	—	180	147	24,618	2031/2/20
RAGB 0% 04/20/25	—	90	87	14,542	2025/4/20
RAGB 0% 10/20/28	—	130	114	19,109	2028/10/20
RAGB 0% 10/20/40	—	80	47	7,872	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	120	83	14,016	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	280	249	41,756	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	160	148	24,867	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	70	29	4,982	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	280	258	43,169	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	150	83	14,018	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	320	303	50,642	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	30	12	2,123	2120/6/30
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	180	153	25,678	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	40	38	6,487	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	110	78	13,164	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	20	11	1,900	2086/11/2
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	90	68	11,393	2049/5/23
RAGB 2% 07/15/26	2.0	150	146	24,508	2026/7/15
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	100	71	11,944	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	130	122	20,417	2034/5/23
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	200	197	32,959	2033/2/20
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	80	78	13,124	2034/2/20
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	60	60	10,032	2029/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	120	117	19,635	2044/6/20
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	50	48	8,107	2053/10/20
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	120	123	20,609	2030/10/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	70	77	12,917	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	190	208	34,856	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	70	72	12,058	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	100	109	18,360	2027/7/15
特殊債券 (除く金融債)					
ASFLNG 0.125% 06/02/31	0.125	100	81	13,615	2031/6/2
OKB 1.5% 07/13/27	1.5	100	94	15,868	2027/7/13
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ERSTBK 0.875% 05/22/26	0.875	200	188	31,498	2026/5/22
ERSTBK 4% 01/16/31	4.0	100	101	16,892	2031/1/16
OMVAV 2.375% 04/09/32	2.375	100	92	15,515	2032/4/9
OMVAV 2.5% PERP	2.5	100	95	15,922	—
RBIIV 4.125% 09/08/25	4.125	100	99	16,699	2025/9/8
RBIIV 7.375% 12/20/32	7.375	100	103	17,265	2032/12/20

銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(ルクセンブルク)					
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ARNDIN 0.375% 04/15/27	0.375	100	84	14,099	2027/4/15
DHR 0.2% 03/18/26	0.2	100	93	15,678	2026/3/18
ERFFP 4% 07/06/29	4.0	100	99	16,631	2029/7/6
HOLNSW 0.125% 07/19/27	0.125	100	89	14,956	2027/7/19
HOLNSW 0.5% 09/03/30	0.5	100	81	13,659	2030/9/3
NESNVX 0% 06/14/26	—	100	93	15,585	2026/6/14
NESNVX 0.875% 06/14/41	0.875	100	67	11,219	2041/6/14
NESNVX 3.5% 12/13/27	3.5	100	100	16,852	2027/12/13
NOVNVX 0% 09/23/28	—	100	86	14,503	2028/9/23
SESGFP 3.5% 01/14/29	3.5	100	97	16,209	2029/1/14
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/26	—	70	65	10,890	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	100	83	13,873	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	50	34	5,834	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	70	31	5,203	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	130	105	17,653	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	30	18	3,114	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	40	38	6,355	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	30	18	3,069	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	70	64	10,785	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	160	144	24,092	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	50	44	7,357	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	50	43	7,202	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	140	135	22,666	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	80	66	11,144	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	50	47	7,976	2027/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	70	49	8,207	2047/4/15
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	90	79	13,349	2032/9/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	90	82	13,714	2042/7/4
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	80	75	12,591	2038/4/15
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	100	99	16,601	2028/7/4
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	40	39	6,663	2029/4/15
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	60	56	9,429	2055/4/15
RFGB 3% 09/15/33	3.0	50	49	8,305	2033/9/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	50	50	8,418	2025/7/4
普通社債券 (含む投資法人債券)					
NDAFH 0.5% 05/14/27	0.5	200	183	30,709	2027/5/14
NDASS 1% 03/30/29	1.0	200	180	30,085	2029/3/30
NDASS 1.125% 02/16/27	1.125	100	93	15,595	2027/2/16
NESVH 3.875% 03/16/29	3.875	100	100	16,843	2029/3/16
NOKIA 4.375% 08/21/31	4.375	100	100	16,791	2031/8/21
OPBANK 0.375% 06/16/28	0.375	200	174	29,232	2028/6/16
OPBANK 2.875% 12/15/25	2.875	100	98	16,507	2025/12/15
OPBANK 4.125% 04/18/27	4.125	100	101	16,972	2027/4/18
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	—	120	97	16,227	2031/10/18

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	60	55	9,245	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	60	50	8,480	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	40	32	5,417	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	50	37	6,308	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	80	52	8,780	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	170	157	26,346	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	180	172	28,878	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	170	156	26,110	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	110	95	16,025	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	100	90	15,169	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	120	83	13,985	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	130	110	18,432	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	200	163	27,361	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	140	136	22,808	2030/5/15
IRISH 3% 10/18/43	3.0	20	19	3,248	2043/10/18
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AIB 3.625% 07/04/26	3.625	100	99	16,653	2026/7/4
DELL 0.5% 10/27/26	0.5	100	92	15,472	2026/10/27
DELL 4.5% 10/18/27	4.5	100	102	17,079	2027/10/18
FREGR 0.5% 10/01/28	0.5	100	87	14,615	2028/10/1
JCI 4.25% 05/23/35	4.25	100	102	17,046	2035/5/23
LIN 1.625% 03/31/35	1.625	100	82	13,784	2035/3/31
(ギリシャ)					
国債証券					
GGB 3.875% 06/15/28	3.875	300	308	51,476	2028/6/15
GGB 4.25% 06/15/33	4.25	300	315	52,774	2033/6/15
GGB 4.375% 07/18/38	4.375	250	261	43,662	2038/7/18
(ポルトガル)					
国債証券					
PGB 0.3% 10/17/31	0.3	70	57	9,640	2031/10/17
PGB 0.475% 10/18/30	0.475	70	60	10,059	2030/10/18
PGB 0.7% 10/15/27	0.7	100	93	15,554	2027/10/15
PGB 1% 04/12/52	1.0	80	43	7,202	2052/4/12
PGB 1.15% 04/11/42	1.15	70	47	7,999	2042/4/11
PGB 1.65% 07/16/32	1.65	150	134	22,547	2032/7/16
PGB 1.95% 06/15/29	1.95	100	95	16,025	2029/6/15
PGB 2.125% 10/17/28	2.125	200	194	32,549	2028/10/17
PGB 2.875% 07/21/26	2.875	240	239	40,008	2026/7/21
PGB 2.875% 10/15/25	2.875	100	99	16,638	2025/10/15
PGB 2.875% 10/20/34	2.875	250	241	40,364	2034/10/20
PGB 3.5% 06/18/38	3.5	100	100	16,737	2038/6/18
PGB 3.875% 02/15/30	3.875	180	189	31,723	2030/2/15
PGB 4.1% 02/15/45	4.1	50	53	8,871	2045/2/15
PGB 4.1% 04/15/37	4.1	120	128	21,517	2037/4/15
PGB 4.125% 04/14/27	4.125	100	103	17,309	2027/4/14
(その他)					
国債証券					
BGARIA 4.125% 09/23/29	4.125	100	103	17,211	2029/9/23
CHILE 0.555% 01/21/29	0.555	200	174	29,102	2029/1/21
CHILE 1.3% 07/26/36	1.3	100	74	12,478	2036/7/26
ICELND 0% 04/15/28	—	100	87	14,628	2028/4/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ISRAEL 1.5% 01/16/29	1.5	100	88	14,740	2029/1/16
ISRAEL 2.5% 01/16/49	2.5	100	75	12,572	2049/1/16
KSA 0.75% 07/09/27	0.75	100	91	15,266	2027/7/9
MEX 2.125% 10/25/51	2.125	100	57	9,611	2051/10/25
POLAND 2.375% 01/18/36	2.375	100	86	14,404	2036/1/18
POLAND 3.875% 02/14/33	3.875	100	102	17,087	2033/2/14
POLAND 4.125% 01/11/44	4.125	100	98	16,476	2044/1/11
REPHUN 5% 02/22/27	5.0	100	102	17,188	2027/2/22
ROMANI 2% 01/28/32	2.0	100	77	13,024	2032/1/28
ROMANI 2% 04/14/33	2.0	100	74	12,519	2033/4/14
ROMANI 2.125% 03/07/28	2.125	100	91	15,329	2028/3/7
ROMANI 2.625% 12/02/40	2.625	100	65	10,866	2040/12/2
ROMANI 2.75% 02/26/26	2.75	300	293	49,073	2026/2/26
ROMANI 2.75% 04/14/41	2.75	100	65	10,926	2041/4/14
ROMANI 3.624% 05/26/30	3.624	100	91	15,258	2030/5/26
ROMANI 3.875% 10/29/35	3.875	100	83	14,010	2035/10/29
ROMANI 5% 09/27/26	5.0	100	102	17,108	2026/9/27
ROMANI 6.375% 09/18/33	6.375	100	104	17,498	2033/9/18
地方債証券					
ALTA 0.625% 01/16/26	0.625	200	190	31,891	2026/1/16
KOMINS 0.875% 09/01/29	0.875	100	89	14,981	2029/9/1
KOMINS 2.875% 05/23/30	2.875	100	99	16,587	2030/5/23
KOMINS 3.375% 03/15/27	3.375	400	402	67,236	2027/3/15
KOMMUN 0% 11/17/29	—	100	84	14,134	2029/11/17
KOMMUN 3.375% 04/26/43	3.375	200	198	33,196	2043/4/26
ONT 0.01% 11/25/30	0.01	100	80	13,525	2030/11/25
ONT 0.25% 06/09/31	0.25	100	80	13,513	2031/6/9
Q 0.875% 05/04/27	0.875	100	93	15,548	2027/5/4
Q 1.125% 10/28/25	1.125	100	96	16,134	2025/10/28
Q 3% 01/24/33	3.0	100	97	16,320	2033/1/24
特殊債券 (除く金融債)					
AFDB 0.5% 03/22/27	0.5	100	92	15,470	2027/3/22
AFDB 2.25% 09/14/29	2.25	100	95	16,019	2029/9/14
ASIA 0.025% 01/31/30	0.025	100	84	14,066	2030/1/31
ASIA 1.95% 07/22/32	1.95	200	183	30,652	2032/7/22
CAF 0.25% 02/04/26	0.25	200	187	31,277	2026/2/4
COE 0.25% 01/19/32	0.25	100	81	13,549	2032/1/19
COE 1% 04/13/29	1.0	100	90	15,167	2029/4/13
DBJJP 3.125% 04/13/28	3.125	100	99	16,574	2028/4/13
EDC 0.25% 03/07/26	0.25	200	189	31,585	2026/3/7
EFSF 0% 01/20/31	—	100	81	13,654	2031/1/20
EFSF 0% 07/20/26	—	300	279	46,722	2026/7/20
EFSF 0% 10/15/25	—	100	95	15,926	2025/10/15
EFSF 0.05% 10/17/29	0.05	100	85	14,224	2029/10/17
EFSF 0.7% 01/17/53	0.7	200	103	17,273	2053/1/17
EFSF 0.875% 04/10/35	0.875	100	78	13,172	2035/4/10
EFSF 0.875% 09/05/28	0.875	100	91	15,244	2028/9/5
EFSF 1.5% 12/15/25	1.5	100	97	16,234	2025/12/15
EFSF 1.75% 07/17/53	1.75	200	140	23,509	2053/7/17
EFSF 2.375% 06/21/32	2.375	300	285	47,634	2032/6/21
EFSF 2.875% 02/16/33	2.875	200	196	32,885	2033/2/16
EFSF 3% 09/04/34	3.0	42	41	6,930	2034/9/4

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
EIB 0% 03/13/26	—	100	94	15,756	2026/3/13
EIB 0% 05/15/28	—	200	177	29,615	2028/5/15
EIB 0% 06/17/27	—	100	90	15,196	2027/6/17
EIB 0% 09/09/30	—	100	82	13,827	2030/9/9
EIB 0.01% 05/15/41	0.01	500	288	48,246	2041/5/15
EIB 0.01% 11/15/35	0.01	100	69	11,671	2035/11/15
EIB 0.05% 10/13/34	0.05	100	73	12,195	2034/10/13
EIB 0.05% 11/15/29	0.05	100	85	14,224	2029/11/15
EIB 0.2% 03/17/36	0.2	300	211	35,405	2036/3/17
EIB 0.25% 01/20/32	0.25	100	81	13,567	2032/1/20
EIB 0.25% 06/15/40	0.25	100	62	10,427	2040/6/15
EIB 0.375% 05/15/26	0.375	500	472	79,003	2026/5/15
EIB 0.375% 09/15/27	0.375	100	91	15,287	2027/9/15
EIB 0.625% 01/22/29	0.625	100	89	14,971	2029/1/22
EIB 2.75% 01/16/34	2.75	200	194	32,470	2034/1/16
EIB 2.75% 07/28/28	2.75	100	99	16,546	2028/7/28
EIB 3% 07/15/33	3.0	300	298	49,793	2033/7/15
EIB 3.625% 03/14/42	3.625	100	103	17,330	2042/3/14
EIBKOR 1.375% 11/24/25	1.375	100	96	16,088	2025/11/24
EIBKOR 3.5% 06/07/26	3.5	200	199	33,255	2026/6/7
ESM 0% 12/15/26	—	200	184	30,796	2026/12/15
ESM 0.01% 10/15/31	0.01	100	80	13,413	2031/10/15
ESM 0.5% 03/05/29	0.5	200	177	29,664	2029/3/5
ESM 3% 03/15/28	3.0	200	199	33,339	2028/3/15
ESM 3% 08/23/33	3.0	100	99	16,631	2033/8/23
EU 0% 03/04/26	—	300	283	47,282	2026/3/4
EU 0% 07/04/31	—	100	80	13,511	2031/7/4
EU 0% 07/04/35	—	400	281	46,989	2035/7/4
EU 0% 07/06/26	—	100	93	15,628	2026/7/6
EU 0% 10/04/28	—	800	702	117,315	2028/10/4
EU 0% 10/04/30	—	100	82	13,824	2030/10/4
EU 0% 11/04/25	—	600	571	95,417	2025/11/4
EU 0.25% 04/22/36	0.25	100	70	11,825	2036/4/22
EU 0.3% 11/04/50	0.3	200	94	15,844	2050/11/4
EU 0.4% 02/04/37	0.4	100	70	11,857	2037/2/4
EU 0.45% 05/02/46	0.45	700	386	64,630	2046/5/2
EU 0.45% 07/04/41	0.45	200	124	20,864	2041/7/4
EU 0.7% 07/06/51	0.7	400	212	35,494	2051/7/6
EU 0.75% 01/04/47	0.75	100	59	9,902	2047/1/4
EU 0.8% 07/04/25	0.8	100	97	16,208	2025/7/4
EU 1% 07/06/32	1.0	100	85	14,283	2032/7/6
EU 1.125% 06/04/37	1.125	200	154	25,798	2037/6/4
EU 1.625% 12/04/29	1.625	100	93	15,549	2029/12/4
EU 2% 10/04/27	2.0	100	96	16,159	2027/10/4
EU 2.5% 10/04/52	2.5	100	82	13,832	2052/10/4
EU 2.625% 02/04/48	2.625	100	87	14,631	2048/2/4
EU 2.75% 02/04/33	2.75	100	97	16,326	2033/2/4
EU 2.75% 10/05/26	2.75	500	495	82,805	2026/10/5
EU 2.75% 12/04/37	2.75	200	188	31,442	2037/12/4
EU 3.375% 11/04/42	3.375	100	99	16,631	2042/11/4
EU 4% 04/04/44	4.0	200	215	36,080	2044/4/4

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
EUROF 0.01% 06/23/28	0.01	100	87	14,664	2028/6/23
EUROF 0.15% 10/10/34	0.15	100	73	12,297	2034/10/10
IBRD 0% 01/15/27	—	100	91	15,363	2027/1/15
IBRD 0% 02/21/30	—	200	168	28,067	2030/2/21
IBRD 0.01% 04/24/28	0.01	300	266	44,464	2028/4/24
IBRD 0.1% 09/17/35	0.1	100	71	11,860	2035/9/17
IBRD 0.2% 01/21/61	0.2	100	35	5,906	2061/1/21
IBRD 0.25% 01/10/50	0.25	200	95	16,035	2050/1/10
IBRD 0.5% 04/16/30	0.5	100	86	14,422	2030/4/16
IBRD 0.7% 10/22/46	0.7	100	59	9,897	2046/10/22
IBRD 2.9% 01/19/33	2.9	100	98	16,476	2033/1/19
IBRD 3.1% 04/14/38	3.1	100	97	16,300	2038/4/14
IDAWBG 0.7% 01/17/42	0.7	100	64	10,717	2042/1/17
IDAWBG 1.75% 05/05/37	1.75	100	83	13,992	2037/5/5
IDAWBG 2.5% 01/15/38	2.5	100	90	15,147	2038/1/15
IDBINV 3.125% 06/07/30	3.125	200	199	33,336	2030/6/7
IDBINV 3.125% 11/15/27	3.125	100	99	16,642	2027/11/15
JBIC 3.125% 02/15/28	3.125	100	99	16,582	2028/2/15
KDB 3.375% 05/23/28	3.375	200	198	33,204	2028/5/23
NIB 2.5% 01/30/30	2.5	100	97	16,279	2030/1/30
SBAB 0.5% 02/08/27	0.5	200	183	30,648	2027/2/8
SBAB 1.875% 12/10/25	1.875	100	97	16,228	2025/12/10
SEK 3.25% 04/13/26	3.25	100	99	16,644	2026/4/13
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AALLN 4.125% 03/15/32	4.125	100	99	16,647	2032/3/15
AALLN 4.5% 09/15/28	4.5	100	102	17,085	2028/9/15
AAPL 0.5% 11/15/31	0.5	100	82	13,743	2031/11/15
ABBV 0.75% 11/18/27	0.75	200	182	30,507	2027/11/18
ABBV 1.25% 11/18/31	1.25	100	85	14,316	2031/11/18
ABBV 2.125% 06/01/29	2.125	100	93	15,697	2029/6/1
ATA 0.88% 09/09/33	0.88	100	85	14,307	2033/9/9
AKERBP 1.125% 05/12/29	1.125	100	87	14,640	2029/5/12
AMT 0.875% 05/21/29	0.875	100	85	14,305	2029/5/21
AMXLM 0.75% 06/26/27	0.75	100	91	15,337	2027/6/26
ANZNZ 0.2% 09/23/27	0.2	200	177	29,712	2027/9/23
ASABRE 0.336% 04/19/27	0.336	100	90	15,146	2027/4/19
ATBCN 4.011% 02/12/36	4.011	200	196	32,753	2036/2/12
BAC 0.694% 03/22/31	0.694	100	83	13,916	2031/3/22
BAC 1.949% 10/27/26	1.949	400	388	64,918	2026/10/27
BACR 0.877% 01/28/28	0.877	200	183	30,731	2028/1/28
BACR 1.125% 03/22/31	1.125	100	93	15,562	2031/3/22
BHP 3.25% 09/24/27	3.25	100	99	16,545	2027/9/24
BMO 0.05% 06/08/29	0.05	100	84	14,113	2029/6/8
BMO 0.125% 01/26/27	0.125	200	182	30,491	2027/1/26
BMO 1% 04/05/26	1.0	200	190	31,868	2026/4/5
BMO 2.75% 10/13/26	2.75	1,000	983	164,226	2026/10/13
BNS 0.01% 09/14/29	0.01	100	83	13,960	2029/9/14
BNS 3.25% 01/18/28	3.25	200	198	33,181	2028/1/18
BPLN 3.25 PERP	3.25	100	97	16,253	—
BPLN 3.625% PERP	3.625	100	95	15,895	—
BRITEL 0.5% 09/12/25	0.5	100	95	15,963	2025/9/12

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BRK 1.625% 03/16/35	1.625	100	81	13,629	2035/3/16
C 3.713% 09/22/28	3.713	100	99	16,691	2028/9/22
CARLB 4.25% 10/05/33	4.25	100	103	17,271	2033/10/5
CB 0.875% 06/15/27	0.875	100	92	15,386	2027/6/15
CCEP 1.75% 03/27/26	1.75	100	96	16,135	2026/3/27
CKHH 2% 04/13/30	2.0	100	89	14,941	2030/4/13
CM 0.01% 10/07/26	0.01	200	183	30,705	2026/10/7
CM 0.375% 03/10/26	0.375	400	377	63,052	2026/3/10
CMCSA 0.25% 05/20/27	0.25	100	90	15,151	2027/5/20
CPPIBC 0.75% 02/02/37	0.75	250	180	30,225	2037/2/2
DANBNK 0.75% 06/09/29	0.75	100	87	14,698	2029/6/9
DANBNK 4% 01/12/27	4.0	100	100	16,760	2027/1/12
DNBNO 0.01% 01/21/31	0.01	100	80	13,485	2031/1/21
DNBNO 3.625% 02/16/27	3.625	100	99	16,629	2027/2/16
DNBNO 4.5% 07/19/28	4.5	100	101	17,035	2028/7/19
DNBNO 5% 09/13/33	5.0	200	204	34,177	2033/9/13
EJRAIL 1.85% 04/13/33	1.85	100	87	14,597	2033/4/13
EJRAIL 3.245% 09/08/30	3.245	200	197	32,970	2030/9/8
EQNR 0.75% 05/22/26	0.75	100	94	15,766	2026/5/22
EQNR 1.375% 05/22/32	1.375	100	85	14,259	2032/5/22
FI 4.5% 05/24/31	4.5	100	103	17,241	2031/5/24
GM 0.85% 02/26/26	0.85	100	95	15,876	2026/2/26
GM 4.5% 11/22/27	4.5	100	102	17,039	2027/11/22
GS 0.25% 01/26/28	0.25	100	88	14,756	2028/1/26
GS 4% 09/21/29	4.0	100	101	17,017	2029/9/21
GSK 1.75% 05/21/30	1.75	100	90	15,188	2030/5/21
HNDA 3.75% 10/25/27	3.75	100	100	16,802	2027/10/25
HSBC 0.309% 11/13/26	0.309	100	94	15,817	2026/11/13
HSBC 3.019% 06/15/27	3.019	200	196	32,772	2027/6/15
HSBC 4.599% 03/22/35	4.599	200	198	33,186	2035/3/22
HSBC 4.787% 03/10/32	4.787	100	103	17,360	2032/3/10
HSBC 6.364% 11/16/32	6.364	100	106	17,726	2032/11/16
IMBLN 2.125% 02/12/27	2.125	100	95	15,961	2027/2/12
INFLN 2.125% 10/06/25	2.125	100	97	16,292	2025/10/6
JPM 0.389% 02/24/28	0.389	100	91	15,223	2028/2/24
JPM 1.963% 03/23/30	1.963	100	91	15,358	2030/3/23
KO 0.95% 05/06/36	0.95	100	74	12,505	2036/5/6
LLOYDS 3.125% 08/24/30	3.125	100	96	16,091	2030/8/24
LSELN 1.75% 12/06/27	1.75	200	188	31,529	2027/12/6
MAERSK 0.75% 11/25/31	0.75	100	80	13,430	2031/11/25
MDLZ 0.25% 03/17/28	0.25	100	88	14,740	2028/3/17
MET 4% 04/05/28	4.0	100	101	16,968	2028/4/5
MIZUHO 4.157% 05/20/28	4.157	100	101	17,008	2028/5/20
MO 2.2% 06/15/27	2.2	100	94	15,854	2027/6/15
MS 2.95% 05/07/32	2.95	200	188	31,492	2032/5/7
MS 4.813% 10/25/28	4.813	100	103	17,221	2028/10/25
MSFT 2.625% 05/02/33	2.625	100	96	16,183	2033/5/2
MUFG 0.337% 06/08/27	0.337	200	186	31,122	2027/6/8
MUFG 0.848% 07/19/29	0.848	200	176	29,521	2029/7/19
NAB 0.01% 01/06/29	0.01	100	85	14,277	2029/1/6
NAB 2.125% 05/24/28	2.125	100	94	15,858	2028/5/24

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NAB 3.146% 02/05/31	3.146	500	495	82,748	2031/2/5
NAB 3.2627% 02/13/26	3.2627	1,000	994	166,183	2026/2/13
NACN 3.5% 04/25/28	3.5	200	200	33,486	2028/4/25
NDQA 0.875% 02/13/30	0.875	100	85	14,324	2030/2/13
NGGLN 0.163% 01/20/28	0.163	100	87	14,639	2028/1/20
NGGLN 2.949% 03/30/30	2.949	100	95	15,928	2030/3/30
NSANY 2.652% 03/17/26	2.652	100	97	16,295	2026/3/17
NTT 0.342% 03/03/30	0.342	100	83	13,932	2030/3/3
NTT 0.399% 12/13/28	0.399	100	87	14,559	2028/12/13
NWG 0.125% 11/12/25	0.125	100	94	15,790	2025/11/12
NWG 5.763% 02/28/34	5.763	100	104	17,393	2034/2/28
NWIDE 2% 04/28/27	2.0	100	95	15,909	2027/4/28
ORIX 4.477% 06/01/28	4.477	100	102	17,143	2028/6/1
ORSTED 3.75% 03/01/30	3.75	100	100	16,786	2030/3/1
PEP 0.5% 05/06/28	0.5	100	89	14,946	2028/5/6
PLD 4.25% 01/31/43	4.25	100	96	16,133	2043/1/31
PLNJ 1.875% 11/05/31	1.875	100	82	13,710	2031/11/5
PLNJ 2.875% 10/25/25	2.875	100	98	16,411	2025/10/25
POWFIN 1.841% 09/21/28	1.841	100	88	14,852	2028/9/21
RELLN 1.3% 05/12/25	1.3	100	97	16,294	2025/5/12
RY 0.01% 10/05/28	0.01	100	86	14,399	2028/10/5
RY 0.625% 03/23/26	0.625	200	189	31,667	2026/3/23
RY 2.375% 09/13/27	2.375	1,000	966	161,427	2027/9/13
SEB 3.25% 05/04/28	3.25	100	99	16,654	2028/5/4
SEB 3.25% 11/24/25	3.25	100	99	16,586	2025/11/24
SEB 4% 11/09/26	4.0	100	100	16,770	2026/11/9
SHBASS 0.01% 09/30/30	0.01	100	81	13,551	2030/9/30
SHBASS 3.75% 05/05/26	3.75	200	200	33,473	2026/5/5
SHBASS 3.75% 11/01/27	3.75	100	100	16,829	2027/11/1
SMINLN 2% 02/23/27	2.0	100	95	15,872	2027/2/23
SSELN 4% PERP	4.0	100	97	16,250	-
STANLN 1.2% 09/23/31	1.2	100	91	15,247	2031/9/23
STANLN 2.5% 09/09/30	2.5	100	97	16,293	2030/9/9
SWEDA 1.3% 02/17/27	1.3	100	93	15,593	2027/2/17
SWEDA 3.125% 07/05/28	3.125	100	99	16,582	2028/7/5
T(AT&T) 1.6% 05/19/28	1.6	200	184	30,898	2028/5/19
T(AT&T) 4.3% 11/18/34	4.3	100	102	17,248	2034/11/18
TACHEM 0.75% 07/09/27	0.75	100	91	15,198	2027/7/9
TCLAU 4.225% 04/26/33	4.225	100	102	17,053	2033/4/26
TD 3.715% 03/13/30	3.715	200	203	34,019	2030/3/13
TD 3.879% 03/13/26	3.879	100	100	16,812	2026/3/13
TEBSS 0.75% 03/23/31	0.75	200	168	28,199	2031/3/23
TELNO 1.75% 05/31/34	1.75	100	84	14,167	2034/5/31
TELNO 4.25% 10/03/35	4.25	200	209	34,959	2035/10/3
TEMASE 3.25% 02/15/27	3.25	150	149	24,891	2027/2/15
TMO 1.875% 10/01/49	1.875	100	68	11,424	2049/10/1
TMO 3.2% 01/21/26	3.2	300	298	49,875	2026/1/21
TOYOTA 0.25% 07/16/26	0.25	100	93	15,571	2026/7/16
TOYOTA 4.05% 09/13/29	4.05	100	102	17,084	2029/9/13
UBS 4.375% 01/11/31	4.375	200	203	33,931	2031/1/11
UBS 7.75% 03/01/29	7.75	200	225	37,692	2029/3/1

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UNANA 3.3% 06/06/29	3.3	100	99	16,670	2029/6/6
VATFAL 0.125% 02/12/29	0.125	100	84	14,187	2029/2/12
VOD 2.5% 05/24/39	2.5	100	83	13,952	2039/5/24
VZ 0.375% 03/22/29	0.375	100	86	14,384	2029/3/22
VZ 0.75% 03/22/32	0.75	100	80	13,406	2032/3/22
VZ 4.75% 10/31/34	4.75	100	107	17,936	2034/10/31
WFC 1.741% 05/04/30	1.741	100	89	15,012	2030/5/4
XOM 0.524% 06/26/28	0.524	100	89	14,894	2028/6/26
ユ ー ロ 計				30,128,878	
(イギリス)		千イリスポンド	千イリスポンド		
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	250	231	45,155	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	430	368	71,757	2028/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	430	324	63,143	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	250	226	44,069	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	560	439	85,690	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	520	436	85,053	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	290	82	15,991	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	430	411	80,062	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	280	186	36,324	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	440	168	32,829	2050/10/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	350	166	32,481	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	400	295	57,582	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	170	142	27,762	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	320	251	49,022	2032/1/31
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	230	144	28,141	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	320	110	21,526	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	660	599	116,688	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	320	149	29,073	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	260	153	29,978	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	310	290	56,660	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	290	157	30,637	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	270	131	25,612	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	450	403	78,492	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	380	189	36,959	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	330	144	28,132	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	370	208	40,605	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	590	298	58,201	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	600	433	84,454	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	830	800	155,871	2025/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	230	139	27,212	2065/7/22
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	340	274	53,419	2044/1/22
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	400	369	71,981	2033/1/31
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	470	390	76,129	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	290	228	44,410	2068/7/22
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	940	922	179,646	2025/10/22
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	300	274	53,496	2038/1/29
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	160	156	30,504	2027/3/7
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	370	310	60,473	2052/7/22
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	350	292	56,898	2053/10/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	390	341	66,423	2060/1/22

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UKT 4% 10/22/31	4.0	220	216	42,105	2031/10/22
UKT 4% 10/22/63	4.0	180	156	30,519	2063/10/22
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	380	376	73,240	2027/1/29
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	580	568	110,767	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	510	510	99,519	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	510	488	95,076	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	370	369	71,912	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	400	380	74,016	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	420	388	75,610	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	270	248	48,329	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	410	374	72,888	2055/12/7
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	50	46	9,060	2054/7/31
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	320	321	62,642	2028/6/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	670	676	131,738	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	450	437	85,117	2042/12/7
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	330	337	65,636	2034/1/31
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	600	619	120,573	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	290	294	57,355	2038/12/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	440	472	91,994	2028/12/7
特殊債券 (除く金融債)					
ALIB 1.125% 09/15/26	1.125	100	91	17,888	2026/9/15
ASIA 0.75% 12/07/27	0.75	100	87	17,048	2027/12/7
BNG 0.5% 12/21/26	0.5	100	89	17,421	2026/12/21
COE 4.25% 03/16/26	4.25	100	98	19,243	2026/3/16
DEXGRP 0.25% 12/10/26	0.25	100	88	17,264	2026/12/10
EIB 0.75% 07/22/27	0.75	100	88	17,274	2027/7/22
EIB 0.875% 05/15/26	0.875	200	185	36,069	2026/5/15
EIB 3.875% 04/12/28	3.875	200	195	38,053	2028/4/12
EIB 4.875% 12/16/30	4.875	200	205	39,964	2030/12/16
EIB 5.625% 06/07/32	5.625	100	108	21,116	2032/6/7
IADB 2.125% 12/15/28	2.125	100	90	17,556	2028/12/15
IADB 5% 07/20/30	5.0	100	102	20,029	2030/7/20
IBRD 0.25% 07/22/26	0.25	100	90	17,661	2026/7/22
KFW 1.125% 07/04/25	1.125	100	95	18,618	2025/7/4
KFW 3.75% 07/30/27	3.75	100	97	18,968	2027/7/30
KFW 3.875% 09/02/25	3.875	200	197	38,371	2025/9/2
KFW 4.875% 02/03/31	4.875	100	102	19,988	2031/2/3
NEDWKB 0.875% 09/30/26	0.875	200	182	35,466	2026/9/30
RENTEN 2.125% 12/15/28	2.125	100	90	17,561	2028/12/15
普通社債券 (含む投資法人債券)					
AAPL 3.05% 07/31/29	3.05	100	92	18,065	2029/7/31
ALVGR 4.5% 03/13/43	4.5	100	91	17,747	2043/3/13
ANFND 2.308% 10/06/32	2.308	200	152	29,732	2032/10/6
ANFND 2.924% 10/06/51	2.924	100	57	11,128	2051/10/6
ANFND 3.685% 07/12/34	3.685	100	82	16,018	2034/7/12
ANFND 4.75% 08/09/33	4.75	200	182	35,484	2033/8/9
AVLN 4% 06/03/55	4.0	100	80	15,656	2055/6/3
BACR 3.75% 11/22/30	3.75	100	95	18,650	2030/11/22
BACR 5.851% 03/21/35	5.851	100	98	19,086	2035/3/21
BATSLN 2.25% 09/09/52	2.25	100	44	8,680	2052/9/9
BATSLN 5.75% 07/05/40	5.75	100	90	17,588	2040/7/5

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BFCM 1% 07/16/26	1.0	100	91	17,751	2026/7/16
BNP 3.375% 01/23/26	3.375	200	192	37,575	2026/1/23
BPLN 4.25% PERP	4.25	100	94	18,395	—
BRK 2.625% 06/19/59	2.625	100	56	10,979	2059/6/19
CDTFIN 2.125% 09/22/28	2.125	100	87	17,111	2028/9/22
CMCSA 4% 11/26/29	4.0	100	95	18,590	2029/11/26
CMCSA 5.5% 11/23/29	5.5	100	102	19,983	2029/11/23
CMCSA 6% 05/21/27	6.0	100	102	19,973	2027/5/21
CPGLN 4.375% 09/08/32	4.375	100	96	18,730	2032/9/8
EDF 5.5% 01/25/35	5.5	100	96	18,701	2035/1/25
EJRAIL 4.75% 12/08/31	4.75	100	97	19,006	2031/12/8
ENELIM 1% 10/20/27	1.0	100	87	16,997	2027/10/20
ENGIFP 5.625% 04/03/53	5.625	100	95	18,613	2053/4/3
EQNR 4.25% 04/10/41	4.25	200	178	34,686	2041/4/10
GSK 5.25% 04/10/42	5.25	100	98	19,161	2042/4/10
HSBC 1.75% 07/24/27	1.75	100	91	17,884	2027/7/24
HSBC 3% 05/29/30	3.0	100	88	17,150	2030/5/29
HSBC 8.201% 11/16/34	8.201	100	107	20,991	2034/11/16
HTHROW 4.625% 10/31/46	4.625	100	83	16,168	2046/10/31
INFLN 3.125% 07/05/26	3.125	100	94	18,496	2026/7/5
LLOYDS 6.5% 09/17/40	6.5	100	109	21,382	2040/9/17
LLOYDS 6.625% 06/02/33	6.625	100	100	19,550	2033/6/2
MCD 3.75% 05/31/38	3.75	100	83	16,267	2038/5/31
MET 1.625% 10/12/28	1.625	100	86	16,905	2028/10/12
MCNLN 6.34% 12/19/63	6.34	100	92	18,106	2063/12/19
MS 2.625% 03/09/27	2.625	100	92	18,079	2027/3/9
NGGLN 2% 04/17/40	2.0	100	60	11,864	2040/4/17
NGGLN 2.75% 02/06/35	2.75	100	77	15,059	2035/2/6
NGGLN 5.272% 01/18/43	5.272	100	92	18,075	2043/1/18
NWG 3.619% 03/29/29	3.619	100	92	18,041	2029/3/29
NWIDE 6.178% 12/07/27	6.178	100	101	19,697	2027/12/7
O 1.875% 01/14/27	1.875	100	90	17,664	2027/1/14
ORSTED 2.5% 02/18/21	2.5	100	71	14,019	3021/2/18
PFE 6.5% 06/03/38	6.5	100	112	21,900	2038/6/3
RABORK 1.875% 07/12/28	1.875	100	89	17,489	2028/7/12
RTOLN 5% 06/27/32	5.0	100	97	18,912	2032/6/27
SANTAN 4.75% 08/30/28	4.75	100	97	18,990	2028/8/30
SANTAN 5.125% 01/25/30	5.125	100	98	19,164	2030/1/25
SANIK 2.92% 05/08/26	2.92	100	97	18,900	2026/5/8
SGOPP 4.625% 10/09/29	4.625	100	97	19,025	2029/10/9
SSELN 3.74% PERP	3.74	100	95	18,623	—
STANLN 4.375% 01/18/38	4.375	100	87	17,097	2038/1/18
UBS 7% 09/30/27	7.0	100	102	20,033	2027/9/30
VIEFP 5.375% 12/02/30	5.375	100	100	19,603	2030/12/2
VW 3.375% 11/16/26	3.375	100	94	18,484	2026/11/16
WELL 4.8% 11/20/28	4.8	100	96	18,842	2028/11/20
小 計				5,208,806	
(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン		
SWISS 0% 06/22/29	—	300	287	49,118	2029/6/22
SWISS 0% 07/24/39	—	100	89	15,262	2039/7/24

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SWISS 0.25% 06/23/35	0.25	220	208	35,544	2035/6/23
SWISS 0.5% 05/24/55	0.5	50	47	8,102	2055/5/24
SWISS 0.5% 05/27/30	0.5	350	344	58,737	2030/5/27
SWISS 0.5% 05/30/58	0.5	40	38	6,524	2058/5/30
SWISS 0.5% 06/27/32	0.5	190	186	31,755	2032/6/27
SWISS 0.5% 06/28/45	0.5	130	124	21,256	2045/6/28
SWISS 1.25% 05/28/26	1.25	430	433	73,865	2026/5/28
SWISS 1.25% 06/27/37	1.25	60	63	10,913	2037/6/27
SWISS 1.5% 04/30/42	1.5	180	203	34,722	2042/4/30
SWISS 1.5% 07/24/25	1.5	210	211	36,501	2025/7/24
SWISS 1.5% 10/26/38	1.5	130	143	24,544	2038/10/26
SWISS 2% 06/25/64	2.0	50	74	12,734	2064/6/25
SWISS 2.25% 06/22/31	2.25	380	418	71,432	2031/6/22
SWISS 2.5% 03/08/36	2.5	160	192	32,758	2036/3/8
SWISS 3.25% 06/27/27	3.25	150	161	27,477	2027/6/27
SWISS 3.5% 04/08/33	3.5	250	309	52,759	2033/4/8
SWISS 4% 01/06/49	4.0	20	34	5,948	2049/1/6
SWISS 4% 04/08/28	4.0	550	617	105,347	2028/4/8
小 計				714,859	
(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ		
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	1,870	1,580	22,605	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,090	2,867	41,606	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	2,030	1,847	26,421	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	1,420	1,357	19,405	2026/11/12
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	200	186	2,669	2033/11/11
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	650	635	9,091	2032/6/1
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	1,980	1,964	28,090	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	980	1,076	15,399	2039/3/30
普通社債券 (含む投資法人債券)					
LANSBK 0.5% 09/20/28	0.5	2,000	1,763	25,217	2028/9/20
LANSBK 1% 09/15/27	1.0	3,500	3,232	46,222	2027/9/15
LANSBK 1.5% 09/16/26	1.5	1,000	954	13,647	2026/9/16
LANSBK 3% 09/19/29	3.0	2,000	1,951	27,903	2029/9/19
NDASS 0.5% 09/16/26	0.5	2,700	2,516	35,990	2026/9/16
NDASS 1% 09/17/25	1.0	1,500	1,446	20,686	2025/9/17
SBAB 0.5% 06/11/25	0.5	2,000	1,931	27,617	2025/6/11
SEB 0.5% 12/16/26	0.5	2,000	1,851	26,479	2026/12/16
SHBASS 2.5% 12/01/27	2.5	2,000	1,937	27,701	2027/12/1
SWEDA 1% 03/17/27	1.0	1,000	932	13,341	2027/3/17
SWEDA 1% 03/18/26	1.0	2,000	1,906	27,267	2026/3/18
SWEDA 1% 06/18/25	1.0	1,000	970	13,878	2025/6/18
SWEDA 3% 03/15/28	3.0	1,100	1,082	15,481	2028/3/15
SWEDA 3% 03/28/29	3.0	1,000	979	14,001	2029/3/28
小 計				500,126	
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ		
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	200	167	2,375	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	870	752	10,689	2030/8/19

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	1,050	1,004	14,269	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	1,260	1,188	16,884	2027/2/17	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	750	675	9,593	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	980	912	12,970	2028/4/26	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	450	396	5,629	2032/5/18	
NGB 3% 08/15/33	3.0	1,310	1,223	17,380	2033/8/15	
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	360	353	5,027	2042/10/6	
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	370	361	5,143	2034/4/13	
小 計				99,964		
(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			
国債証券						
DGB 0% 11/15/31	—	1,170	967	21,677	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	1,000	513	11,503	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,560	2,376	53,243	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	500	447	10,019	2029/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,570	5,465	122,417	2025/11/15	
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	760	734	16,460	2033/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	1,550	1,879	42,096	2039/11/15	
小 計				277,418		
(チェコ)		千チェココルナ	千チェココルナ			
国債証券						
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	2,400	2,157	14,332	2027/2/10	
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	4,500	3,712	24,668	2030/5/15	
CZGB 1% 06/26/26	1.0	900	841	5,593	2026/6/26	
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	1,550	1,268	8,431	2031/3/13	
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	1,000	671	4,463	2040/4/24	
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	2,400	1,979	13,152	2032/6/23	
CZGB 1.95% 07/30/37	1.95	1,400	1,059	7,042	2037/7/30	
CZGB 2% 10/13/33	2.0	3,300	2,709	18,001	2033/10/13	
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	1,500	1,463	9,723	2025/9/17	
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	1,500	1,400	9,304	2028/8/25	
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	1,400	1,302	8,654	2029/7/23	
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	800	787	5,229	2036/12/4	
CZGB 4.85% 11/26/57	4.85	500	529	3,519	2057/11/26	
CZGB 4.9% 04/14/34	4.9	1,300	1,355	9,004	2034/4/14	
CZGB 5% 09/30/30	5.0	1,000	1,039	6,904	2030/9/30	
CZGB 5.5% 12/12/28	5.5	1,800	1,895	12,594	2028/12/12	
CZGB 5.75% 03/29/29	5.75	2,000	2,129	14,149	2029/3/29	
CZGB 6% 02/26/26	6.0	2,700	2,787	18,521	2026/2/26	
小 計				193,290		
(ハンガリー)		千ハンガリー フォリント	千ハンガリー フォリント			
国債証券						
HGB 1% 11/26/25	1.0	10,000	9,101	3,869	2025/11/26	
HGB 1.5% 04/22/26	1.5	16,000	14,363	6,106	2026/4/22	
HGB 1.5% 08/26/26	1.5	28,000	24,676	10,490	2026/8/26	
HGB 2% 05/23/29	2.0	15,000	11,789	5,011	2029/5/23	
HGB 2.25% 04/20/33	2.25	10,000	6,837	2,906	2033/4/20	
HGB 2.25% 06/22/34	2.25	8,000	5,243	2,229	2034/6/22	
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	10,000	8,940	3,800	2026/12/22	
HGB 3% 04/25/41	3.0	8,000	4,826	2,051	2041/4/25	

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
HGB 3% 08/21/30	3.0	25,000	19,819	8,425	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	26,000	22,717	9,658	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	17,000	10,818	4,599	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	23,000	17,894	7,607	2031/10/22	
HGB 4.5% 03/23/28	4.5	15,000	13,669	5,811	2028/3/23	
HGB 4.5% 05/27/32	4.5	19,000	15,946	6,779	2032/5/27	
HGB 4.75% 11/24/32	4.75	12,000	10,168	4,323	2032/11/24	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	8,000	7,847	3,336	2025/6/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	11,000	10,814	4,597	2028/10/22	
HGB 9.5% 10/21/26	9.5	13,000	13,628	5,793	2026/10/21	
小 計				97,399		
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
国債証券						
POLGB 0% 10/25/25	—	490	454	17,582	2025/10/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	480	424	16,436	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	280	268	10,395	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	330	252	9,783	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	480	358	13,900	2032/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	750	705	27,337	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	730	667	25,860	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	300	271	10,496	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	1,550	1,345	52,101	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	520	507	19,657	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	390	372	14,406	2027/5/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	200	201	7,784	2029/4/25	
POLGB 6% 10/25/33	6.0	850	861	33,352	2033/10/25	
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	700	749	29,021	2028/7/25	
小 計				288,117		
(オーストラリア)		千オーストラリア ドル	千オーストラリア ドル			
国債証券						
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	730	686	69,823	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	730	671	68,220	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	500	394	40,086	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	660	537	54,649	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	500	395	40,244	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	700	581	59,121	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	220	119	12,156	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	400	325	33,120	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	800	746	75,889	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	640	582	59,253	2030/5/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	140	108	11,033	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	270	229	23,368	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	300	287	29,203	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	640	605	61,533	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	550	512	52,084	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	250	189	19,214	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	270	240	24,476	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	400	396	40,280	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	390	375	38,146	2029/4/21	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	120	102	10,409	2039/6/21
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	160	147	14,987	2034/12/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	280	258	26,321	2037/4/21
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	200	189	19,249	2034/5/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	520	521	53,024	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	340	343	34,891	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	360	367	37,315	2027/4/21
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	100	100	10,175	2054/6/21
地方債証券					
NSWTC 1.5% 02/20/32	1.5	100	78	7,943	2032/2/20
NSWTC 2% 03/08/33	2.0	100	78	7,992	2033/3/8
NSWTC 2.25% 05/07/41	2.25	300	191	19,462	2041/5/7
NSWTC 3% 04/20/29	3.0	400	372	37,912	2029/4/20
NSWTC 3% 05/20/27	3.0	200	192	19,532	2027/5/20
NSWTC 3% 11/15/28	3.0	100	94	9,559	2028/11/15
NSWTC 4.25% 02/20/36	4.25	400	363	36,985	2036/2/20
NSWTC 4.75% 02/20/35	4.75	200	192	19,594	2035/2/20
NSWTC 4.75% 02/20/37	4.75	100	94	9,608	2037/2/20
NZLGF 4.7% 08/01/28	4.7	200	199	20,243	2028/8/1
QTC 1.5% 03/02/32	1.5	300	234	23,873	2032/3/2
QTC 1.5% 08/20/32	1.5	200	153	15,619	2032/8/20
QTC 1.75% 07/20/34	1.75	100	73	7,437	2034/7/20
QTC 2% 08/22/33	2.0	200	155	15,759	2033/8/22
QTC 2.25% 10/28/50	2.25	100	54	5,579	2050/10/28
QTC 3.25% 07/21/28	3.25	200	190	19,386	2028/7/21
QTC 4.5% 03/09/33	4.5	100	96	9,854	2033/3/9
QTC 4.5% 08/22/35	4.5	200	187	19,085	2035/8/22
QTC 4.75% 02/02/34	4.75	200	195	19,873	2034/2/2
QTC 4.75% 07/21/25	4.75	100	100	10,202	2025/7/21
TCV 0.5% 11/20/25	0.5	400	376	38,256	2025/11/20
TCV 1.25% 11/19/27	1.25	300	268	27,307	2027/11/19
TCV 1.5% 09/10/31	1.5	100	79	8,037	2031/9/10
TCV 1.5% 11/20/30	1.5	200	163	16,598	2030/11/20
TCV 2% 11/20/37	2.0	100	66	6,746	2037/11/20
TCV 2.25% 09/15/33	2.25	400	314	31,962	2033/9/15
TCV 2.5% 10/22/29	2.5	500	448	45,591	2029/10/22
WATC 1.5% 10/22/30	1.5	100	82	8,395	2030/10/22
WATC 3% 10/21/26	3.0	100	96	9,847	2026/10/21
WATC 4.25% 07/20/33	4.25	200	190	19,378	2033/7/20
WATC 5% 07/23/25	5.0	200	201	20,470	2025/7/23
特殊債券 (除く金融債)					
AFDB 3.3% 07/27/27	3.3	100	95	9,745	2027/7/27
ASIA 4.25% 01/17/28	4.25	100	98	10,051	2028/1/17
BNG 1.6% 11/27/30	1.6	100	80	8,196	2030/11/27
BNG 5% 03/13/34	5.0	100	98	9,994	2034/3/13
EDC 4.5% 09/06/28	4.5	100	99	10,101	2028/9/6
EIB 1.8% 01/19/27	1.8	100	93	9,456	2027/1/19
EUROF 3.35% 05/21/29	3.35	100	92	9,435	2029/5/21
IBRD 3% 10/19/26	3.0	100	96	9,806	2026/10/19
IBRD 4.4% 01/13/28	4.4	100	99	10,105	2028/1/13
IFC 1.25% 02/06/31	1.25	100	78	8,018	2031/2/6
IFC 3.6% 02/24/26	3.6	100	98	9,997	2026/2/24

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
KBN 0.6% 06/01/26	0.6	100	91	9,342	2026/6/1
KFW 4.3% 07/13/27	4.3	100	99	10,086	2027/7/13
LBANK 4.25% 08/07/25	4.25	100	99	10,095	2025/8/7
NEDWBK 2.25% 09/04/25	2.25	100	96	9,841	2025/9/4
NTB 2.4% 09/22/25	2.4	100	97	9,861	2025/9/22
NRWBK 1.05% 03/31/26	1.05	200	186	18,933	2026/3/31
RENTEN 2.6% 03/23/27	2.6	100	94	9,631	2027/3/23
普通社債券 (含む投資法人債券)					
ABIBB 4.1% 09/06/27	4.1	100	97	9,887	2027/9/6
ANZ 5.906% 08/12/32	5.906	100	100	10,230	2032/8/12
BNP 5.288% 02/15/29	5.288	200	198	20,181	2029/2/15
CBAAU 5% 01/13/28	5.0	200	199	20,320	2028/1/13
CPPIBC 4.45% 09/01/27	4.45	100	99	10,088	2027/9/1
LLOYDS 5.3906% 06/10/27	5.3906	100	100	10,183	2027/6/10
MOGAU 6.082% 06/07/32	6.082	100	100	10,218	2032/6/7
QANAU 2.95% 11/27/29	2.95	100	85	8,696	2029/11/27
TLSAU 5.65% 03/06/34	5.65	200	197	20,032	2034/3/6
WSTP 2.4% 01/25/27	2.4	100	93	9,495	2027/1/25
WSTP 6.934% 06/23/38	6.934	100	104	10,619	2038/6/23
小 計					1,909,035
(ニュージーランド)		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券					
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	290	242	22,532	2028/5/15
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	330	301	28,038	2026/5/15
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	140	112	10,464	2031/5/15
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	110	67	6,276	2041/5/15
NZGB 2% 05/15/32	2.0	250	203	18,861	2032/5/15
NZGB 2.75% 04/15/25	2.75	260	253	23,560	2025/4/15
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	130	101	9,436	2037/4/15
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	90	58	5,430	2051/5/15
NZGB 3% 04/20/29	3.0	110	101	9,443	2029/4/20
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	190	171	15,906	2033/4/14
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	50	47	4,400	2034/5/15
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	390	387	35,952	2027/4/15
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	260	256	23,834	2030/5/15
NZGB 5% 05/15/54	5.0	60	58	5,408	2054/5/15
小 計					219,545
(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券					
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	150	143	16,439	2025/11/1
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	150	142	16,294	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	170	150	17,275	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	110	82	9,491	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	90	67	7,775	2051/10/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	230	223	25,647	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	220	195	22,348	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	90	88	10,181	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	60	53	6,080	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	180	175	20,069	2028/5/1
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	60	56	6,484	2032/8/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	120	108	12,489	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	90	82	9,477	2042/4/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	180	175	20,143	2029/7/1
SIGB 2.875% 08/01/28	2.875	50	49	5,625	2028/8/1
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	130	128	14,677	2027/9/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	200	194	22,237	2030/9/1
SIGB 3% 08/01/72	3.0	50	47	5,411	2072/8/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	140	139	16,016	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	100	100	11,497	2027/3/1
小 計				275,664	
(マレーシア)		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット		
国債証券					
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	420	387	12,615	2031/4/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	450	448	14,603	2027/5/31
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	600	584	19,027	2032/7/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	880	880	28,684	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	890	847	27,604	2040/5/22
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	250	246	8,020	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	630	623	20,312	2033/4/15
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	300	301	9,811	2029/8/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,050	1,058	34,492	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	430	433	14,125	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	420	423	13,790	2026/7/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	700	704	22,953	2025/9/15
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	1,000	969	31,573	2050/6/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	200	203	6,643	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	690	703	22,918	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	600	609	19,868	2026/4/15
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	380	390	12,718	2053/3/31
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	780	805	26,253	2030/4/15
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	850	879	28,634	2029/4/30
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	400	420	13,687	2033/11/7
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	760	808	26,323	2042/10/15
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	240	257	8,394	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	640	682	22,236	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	540	586	19,116	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	220	242	7,889	2048/7/6
小 計				472,298	
(タイ)		千タイバート	千タイバート		
国債証券					
THAIGB 0.95% 06/17/25	0.95	2,600	2,559	10,774	2025/6/17
THAIGB 1% 06/17/27	1.0	4,700	4,496	18,931	2027/6/17
THAIGB 1.585% 12/17/35	1.585	6,800	5,959	25,088	2035/12/17
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	4,000	3,546	14,929	2035/6/17
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	5,000	4,757	20,027	2029/12/17
THAIGB 2% 06/17/42	2.0	5,000	4,216	17,750	2042/6/17
THAIGB 2% 12/17/31	2.0	5,000	4,773	20,095	2031/12/17
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	5,000	4,967	20,911	2026/12/17
THAIGB 2.25% 03/17/27	2.25	5,500	5,474	23,047	2027/3/17
THAIGB 2.35% 06/17/26	2.35	9,500	9,496	39,982	2026/6/17
THAIGB 2.4% 03/17/29	2.4	3,000	2,980	12,548	2029/3/17

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
THAIGB 2.5% 06/17/71	2.5	3,000	2,146	9,038	2071/6/17
THAIGB 2.65% 06/17/28	2.65	4,000	4,024	16,942	2028/6/17
THAIGB 2.75% 06/17/52	2.75	2,200	1,952	8,221	2052/6/17
THAIGB 2.875% 06/17/46	2.875	4,600	4,294	18,079	2046/6/17
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	3,500	3,556	14,974	2028/12/17
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	3,000	3,100	13,053	2038/6/17
THAIGB 3.35% 06/17/33	3.35	7,500	7,855	33,072	2033/6/17
THAIGB 3.39% 06/17/37	3.39	3,400	3,555	14,967	2037/6/17
THAIGB 3.45% 06/17/43	3.45	700	717	3,019	2043/6/17
THAIGB 3.6% 06/17/67	3.6	7,300	7,100	29,894	2067/6/17
THAIGB 3.8% 06/14/41	3.8	2,000	2,191	9,225	2041/6/14
小 計				394,576	
(インドネシア)		千インドネシア ルピア	千インドネシア ルピア		
国債証券					
INDOGB 5.125% 04/15/27	5.125	7,400,000	7,067,296	68,552	2027/4/15
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	3,200,000	3,121,056	30,274	2026/4/15
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	2,000,000	1,869,020	18,129	2036/6/15
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	5,000,000	4,820,200	46,755	2032/4/15
INDOGB 6.375% 08/15/28	6.375	5,300,000	5,180,644	50,252	2028/8/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	2,000,000	1,945,700	18,873	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	2,000,000	1,991,600	19,318	2025/6/15
INDOGB 6.625% 02/15/34	6.625	3,500,000	3,391,045	32,893	2034/2/15
INDOGB 6.875% 04/15/29	6.875	2,000,000	1,988,400	19,827	2029/4/15
INDOGB 6.875% 08/15/51	6.875	1,000,000	976,480	9,471	2051/8/15
INDOGB 7% 02/15/33	7.0	5,500,000	5,480,035	53,156	2033/2/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	3,500,000	3,509,660	34,043	2030/9/15
INDOGB 7.125% 06/15/38	7.125	3,000,000	3,007,110	29,168	2038/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	1,200,000	1,194,168	11,583	2042/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/43	7.125	2,000,000	2,016,230	19,557	2043/6/15
INDOGB 7.25% 02/15/26	7.25	2,000,000	2,021,100	19,604	2026/2/15
INDOGB 7.375% 05/15/48	7.375	4,000,000	4,115,000	39,915	2048/5/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	1,000,000	1,033,220	10,022	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	2,000,000	2,064,780	20,028	2038/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	2,500,000	2,630,075	25,511	2029/5/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	1,100,000	1,223,640	11,869	2039/4/15
小 計				588,270	
(韓国)		千韓国ウォン	千韓国ウォン		
国債証券					
KTB 1.375% 12/10/29	1.375	400,000	354,651	40,252	2029/12/10
KTB 1.5% 03/10/50	1.5	300,000	196,176	22,266	2050/3/10
KTB 1.5% 09/10/40	1.5	200,000	147,224	16,710	2040/9/10
KTB 1.5% 12/10/30	1.5	800,000	701,631	79,635	2030/12/10
KTB 1.875% 06/10/29	1.875	500,000	459,656	52,171	2029/6/10
KTB 1.875% 09/10/41	1.875	300,000	231,820	26,311	2041/9/10
KTB 2% 03/10/46	2.0	300,000	227,796	25,854	2046/3/10
KTB 2% 03/10/49	2.0	300,000	222,873	25,296	2049/3/10
KTB 2% 06/10/31	2.0	400,000	359,602	40,814	2031/6/10
KTB 2.125% 03/10/47	2.125	200,000	154,587	17,545	2047/3/10
KTB 2.25% 09/10/37	2.25	200,000	170,303	19,329	2037/9/10
KTB 2.375% 03/10/27	2.375	900,000	873,086	99,095	2027/3/10
KTB 2.375% 12/10/27	2.375	400,000	384,314	43,619	2027/12/10

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
KTB 2.5% 03/10/52	2.5	300,000	245,166	27,826	2052/3/10
KTB 2.625% 03/10/48	2.625	200,000	169,567	19,245	2048/3/10
KTB 2.75% 12/10/44	2.75	200,000	175,078	19,871	2044/12/10
KTB 3.125% 06/10/25	3.125	400,000	398,337	45,211	2025/6/10
KTB 3.125% 06/10/26	3.125	800,000	793,672	90,081	2026/6/10
KTB 3.25% 03/10/28	3.25	700,000	692,278	78,573	2028/3/10
KTB 3.25% 03/10/53	3.25	1,500,000	1,427,194	161,986	2053/3/10
KTB 3.25% 06/10/33	3.25	900,000	869,384	98,675	2033/6/10
KTB 3.25% 09/10/42	3.25	600,000	568,012	64,469	2042/9/10
KTB 3.375% 06/10/32	3.375	800,000	784,265	89,014	2032/6/10
KTB 3.5% 09/10/28	3.5	400,000	398,447	45,223	2028/9/10
KTB 3.625% 09/10/33	3.625	600,000	612,478	69,516	2053/9/10
KTB 3.75% 12/10/53	3.75	400,000	401,103	45,525	2033/12/10
KTB 4.25% 12/10/25	4.25	1,400,000	1,415,686	160,680	2025/12/10
小計				1,524,804	
(中国オフショア)		千オフショア 人民元	千オフショア 人民元		
国債証券					
CGB 2% 06/15/25	2.0	11,000	11,028	236,593	2025/6/15
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	7,000	7,038	150,998	2026/8/15
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	5,000	5,024	107,780	2025/8/25
CGB 2.22% 09/25/25	2.22	11,000	11,062	237,329	2025/9/25
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	5,000	5,034	107,997	2025/11/25
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	11,000	11,128	238,730	2027/1/20
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	5,200	5,271	113,085	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	5,500	5,578	119,676	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	12,000	12,120	260,025	2026/2/15
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	12,500	12,720	272,884	2028/9/25
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,500	3,555	76,286	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	7,500	7,662	164,374	2033/8/25
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	3,000	3,065	65,767	2030/12/25
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	6,100	6,233	133,719	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	4,400	4,509	96,752	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	9,000	9,227	197,953	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	9,500	9,710	208,323	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	15,000	15,418	330,767	2033/5/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	3,000	3,085	66,202	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	7,000	7,123	152,821	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	5,000	5,164	110,794	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	3,000	3,108	66,679	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	10,500	10,838	232,521	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	7,300	7,578	162,574	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	6,000	6,207	133,164	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	5,000	5,171	110,944	2029/3/24
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	5,000	5,210	111,790	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	2,200	2,262	48,539	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	6,700	7,033	150,888	2033/2/25
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	4,400	4,565	97,948	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	6,600	6,861	147,207	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	3,000	3,169	67,991	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	2,500	2,547	54,642	2025/10/22
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	2,600	2,928	62,833	2052/10/25

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	3,100	3,266	70,072	2029/11/21
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	1,500	1,704	36,569	2053/4/15
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	2,000	2,062	44,254	2026/6/6
CGB 3.27% 03/25/73	3.27	1,000	1,204	25,830	2073/3/25
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	7,000	7,503	160,964	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	5,000	5,247	112,573	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	2,000	2,318	49,745	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	2,700	3,131	67,177	2050/3/16
CGB 3.4% 07/15/72	3.4	2,000	2,477	53,154	2072/7/15
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	2,000	2,401	51,510	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	2,000	2,468	52,954	2051/4/12
CGB 3.73% 05/25/70	3.73	4,000	5,294	113,583	2070/5/25
CGB 3.76% 03/22/71	3.76	1,000	1,328	28,499	2071/3/22
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	4,000	4,989	107,033	2050/9/14
CGB 3.82% 11/19/68	3.82	1,000	1,326	28,447	2068/11/19
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,900	7,296	156,528	2049/7/22
CGB 4% 06/24/69	4.0	5,000	6,855	147,074	2069/6/24
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	12,900	16,407	351,989	2048/10/22
特殊債券(除く金融債)					
ADBCH 2.12% 03/12/27	2.12	2,000	2,005	43,019	2027/3/12
ADBCH 2.27% 06/08/25	2.27	3,000	3,010	64,579	2025/6/8
ADBCH 2.46% 07/27/25	2.46	3,000	3,020	64,788	2025/7/27
ADBCH 2.5% 08/24/27	2.5	5,000	5,067	108,706	2027/8/24
ADBCH 2.55% 05/11/26	2.55	5,000	5,055	108,458	2026/5/11
ADBCH 2.57% 09/13/28	2.57	5,000	5,091	109,225	2028/9/13
ADBCH 2.6% 12/01/25	2.6	3,000	3,030	65,003	2025/12/1
ADBCH 2.74% 02/23/27	2.74	2,000	2,038	43,735	2027/2/23
ADBCH 2.83% 08/11/29	2.83	7,000	7,218	154,868	2029/8/11
ADBCH 2.85% 10/20/33	2.85	3,500	3,651	78,327	2033/10/20
ADBCH 2.9% 03/08/28	2.9	2,000	2,057	44,143	2028/3/8
ADBCH 2.91% 02/21/29	2.91	2,000	2,063	44,258	2029/2/21
ADBCH 2.97% 10/14/32	2.97	2,000	2,098	45,024	2032/10/14
ADBCH 2.99% 08/11/26	2.99	5,000	5,107	109,569	2026/8/11
ADBCH 3.01% 03/16/30	3.01	1,500	1,560	33,474	2030/3/16
ADBCH 3.06% 06/06/32	3.06	4,000	4,216	90,445	2032/6/6
ADBCH 3.1% 02/27/33	3.1	5,000	5,303	113,781	2033/2/27
ADBCH 3.19% 08/12/28	3.19	2,000	2,086	44,752	2028/8/12
ADBCH 3.3% 11/05/31	3.3	2,000	2,139	45,907	2031/11/5
ADBCH 3.35% 03/24/26	3.35	8,000	8,202	175,957	2026/3/24
ADBCH 3.52% 05/24/31	3.52	5,000	5,408	116,030	2031/5/24
ADBCH 3.79% 10/26/30	3.79	2,000	2,186	46,907	2030/10/26
ADBCH 3.92% 06/18/51	3.92	1,000	1,265	27,144	2051/6/18
ADBCH 3.95% 02/26/36	3.95	1,000	1,162	24,930	2036/2/26
EXIMCH 2.5% 08/04/28	2.5	3,000	3,044	65,308	2028/8/4
EXIMCH 2.57% 06/10/25	2.57	5,000	5,037	108,075	2025/6/10
EXIMCH 2.61% 01/27/27	2.61	2,000	2,030	43,560	2027/1/27
EXIMCH 2.82% 06/17/27	2.82	6,000	6,136	131,636	2027/6/17
EXIMCH 2.87% 02/06/28	2.87	5,000	5,135	110,167	2028/2/6
EXIMCH 2.9% 08/19/32	2.9	4,000	4,172	89,512	2032/8/19
EXIMCH 3.1% 02/13/33	3.1	2,000	2,120	45,498	2033/2/13
EXIMCH 3.18% 03/11/32	3.18	5,000	5,313	113,985	2032/3/11
EXIMCH 3.22% 05/14/26	3.22	3,000	3,073	65,939	2026/5/14

銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	期 末		
			評 価 額		償 還 年 月 日
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
EXIMCH 3.23% 03/23/30	3.23	6,000	6,331	135,830	2030/3/23
EXIMCH 3.38% 07/16/31	3.38	2,000	2,147	46,060	2031/7/16
EXIMCH 3.43% 10/23/25	3.43	4,000	4,086	87,671	2025/10/23
EXIMCH 3.74% 11/16/30	3.74	3,000	3,271	70,174	2030/11/16
EXIMCH 3.86% 05/20/29	3.86	5,000	5,401	115,868	2029/5/20
EXIMCH 3.88% 01/12/36	3.88	1,000	1,154	24,767	2036/1/12
SDBC 2.22% 08/25/25	2.22	3,000	3,012	64,622	2025/8/25
SDBC 2.25% 07/06/26	2.25	4,000	4,022	86,297	2026/7/6
SDBC 2.3% 02/22/29	2.3	4,000	4,036	86,587	2029/2/22
SDBC 2.59% 01/11/26	2.59	3,000	3,032	65,046	2026/1/11
SDBC 2.65% 02/24/27	2.65	3,000	3,052	65,488	2027/2/24
SDBC 2.69% 06/16/27	2.69	3,000	3,059	65,629	2027/6/16
SDBC 2.73% 01/11/28	2.73	3,000	3,069	65,854	2028/1/11
SDBC 2.82% 05/22/33	2.82	6,000	6,241	133,897	2033/5/22
SDBC 2.83% 09/10/26	2.83	8,000	8,153	174,912	2026/9/10
SDBC 2.96% 07/18/32	2.96	2,000	2,096	44,980	2032/7/18
SDBC 2.98% 04/22/32	2.98	2,000	2,099	45,030	2032/4/22
SDBC 2.99% 03/01/29	2.99	2,000	2,074	44,501	2029/3/1
SDBC 3% 01/17/32	3.0	4,000	4,197	90,054	2032/1/17
SDBC 3.02% 03/06/33	3.02	7,000	7,387	158,473	2033/3/6
SDBC 3.07% 03/10/30	3.07	7,000	7,332	157,300	2030/3/10
SDBC 3.09% 06/18/30	3.09	2,000	2,099	45,034	2030/6/18
SDBC 3.09% 08/09/28	3.09	5,000	5,193	111,407	2028/8/9
SDBC 3.12% 09/13/31	3.12	2,000	2,114	45,365	2031/9/13
SDBC 3.3% 03/03/26	3.3	10,000	10,242	219,741	2026/3/3
SDBC 3.34% 07/14/25	3.34	3,000	3,051	65,466	2025/7/14
SDBC 3.4% 01/08/28	3.4	5,000	5,227	112,150	2028/1/8
SDBC 3.41% 06/07/31	3.41	4,000	4,302	92,295	2031/6/7
SDBC 3.43% 01/14/27	3.43	13,000	13,481	289,219	2027/1/14
SDBC 3.45% 09/20/29	3.45	7,000	7,448	159,793	2029/9/20
SDBC 3.49% 11/08/41	3.49	2,000	2,288	49,103	2041/11/8
SDBC 3.5% 11/04/46	3.5	2,000	2,349	50,403	2046/11/4
SDBC 3.65% 05/21/29	3.65	2,000	2,141	45,936	2029/5/21
SDBC 3.66% 03/01/31	3.66	2,000	2,179	46,760	2031/3/1
SDBC 3.7% 10/20/30	3.7	8,000	8,693	186,500	2030/10/20

銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	期 末		
			評 価 額		償 還 年 月 日
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SDBC 3.8% 01/25/36	3.8	2,000	2,291	49,160	2036/1/25
SDBC 4.04% 07/06/28	4.04	2,000	2,153	46,205	2028/7/6
小 計				12,574,879	
(イスラエル)		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	450	420	17,196	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	200	192	7,890	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	630	516	21,142	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	340	265	10,859	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	480	322	13,214	2037/5/31
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	370	357	14,652	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	550	515	21,090	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	250	228	9,340	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	190	122	5,015	2052/11/29
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	220	213	8,725	2029/2/28
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	340	276	11,310	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	270	283	11,603	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	100	104	4,275	2026/10/30
小 計				156,316	
合 計				104,635,236	

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

(注2) 償還年月日が「-」の銘柄は、償還期限の定めがありません。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	口 数 (千口)	当 期 末	
		評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)		千米ドル	
ISHARES MBS ETF	1,108	99,158	15,444,949
合 計	口 数 ・ 金 額	1,108	15,444,949
	銘 柄 数 <比 率>	1	<12.6%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	104,635,236	85.0
投 資 信 託 受 益 証 券	15,444,949	12.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,091,084	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	123,171,269	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(122,018,119千円)の投資信託財産総額(123,171,269千円)に対する比率は99.1%です。

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

1米ドル=155.76円	1カナダドル=114.05円	1メキシコペソ=9.0608円
1コロンビアペソ=0.039332円	1ユーロ=167.05円	1イギリスポンド=194.76円
1スイスフラン=170.58円	1スウェーデンクローナ=14.30円	1ノルウェークローネ=14.21円
1デンマーククローネ=22.40円	1チェココルナ=6.6445円	1ハンガリーフォリント=0.425129円
1ポーランドズロチ=38.7262円	1オーストラリアドル=101.65円	1ニュージーランドドル=92.90円
1シンガポールドル=114.59円	1マレーシアリングギット=32.575円	1タイバーツ=4.21円
1インドネシアルピア=0.0097円	1韓国ウォン=0.1135円	1オフショア人民元=21.4529円
1イスラエルシェケル=40.9285円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2024年4月26日現在
(A)資 産	123,171,269,070円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,326,684,453
公 社 債(評価額)	104,635,236,560
投資信託受益証券(評価額)	15,444,949,741
未 収 入 金	726,001,402
未 収 利 息	875,026,975
前 払 費 用	163,369,939
(B)負 債	943,116,638
未 払 金	936,340,276
未 払 解 約 金	6,776,362
(C)純 資 産 総 額(A-B)	122,228,152,432
元 本	105,569,240,183
次 期 繰 越 損 益 金	16,658,912,249
(D)受 益 権 総 口 数	105,569,240,183口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,578円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年4月21日 至 2024年4月26日
(A)配 当 等 収 益	2,478,951,299円
受 取 配 当 金	377,214,749
受 取 利 息	2,100,248,128
そ の 他 収 益 金	1,701,788
支 払 利 息	△213,366
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	9,008,596,636
売 買 益	10,518,997,295
売 買 損	△1,510,400,659
(C)そ の 他 費 用	△44,282,052
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	11,443,265,883
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	5,535,631,185
(F)解 約 差 損 益 金	△319,984,819
(G)計 (D+E+F)	16,658,912,249
次 期 繰 越 損 益 金(G)	16,658,912,249

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は18,542,000,000円、期中追加設定元本額は90,002,312,895円、期中一部解約元本額は2,975,072,712円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	91,434,057,809円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,186,739,776円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,465,438,542円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,409,206,595円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,223,467,342円
FOFs用 世界債券総合インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,096,732,490円
ファンクラブ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	445,237,916円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	308,359,713円

お知らせ

該当事項はありません。

マネープールマザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2023年11月20日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	期騰	落中率			
第10期(2019年11月20日)	円 10,024	% △0.1	% —	% —	百万円 544,455
第11期(2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	486,701
第12期(2021年11月22日)	10,015	△0.0	—	—	358,814
第13期(2022年11月21日)	10,011	△0.0	—	—	371,933
第14期(2023年11月20日)	10,006	△0.0	—	—	236,294

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比
	騰	落率		
(当期首) 2022年11月21日	円 10,011	% —	% —	% —
11月末	10,011	0.0	—	—
12月末	10,010	△0.0	—	—
2023年 1月末	10,010	△0.0	—	—
2月末	10,010	△0.0	—	—
3月末	10,010	△0.0	—	—
4月末	10,010	△0.0	—	—
5月末	10,009	△0.0	—	—
6月末	10,008	△0.0	—	—
7月末	10,008	△0.0	—	—
8月末	10,007	△0.0	—	—
9月末	10,007	△0.0	—	—
10月末	10,006	△0.0	—	—
(当期末) 2023年11月20日	10,006	△0.0	—	—

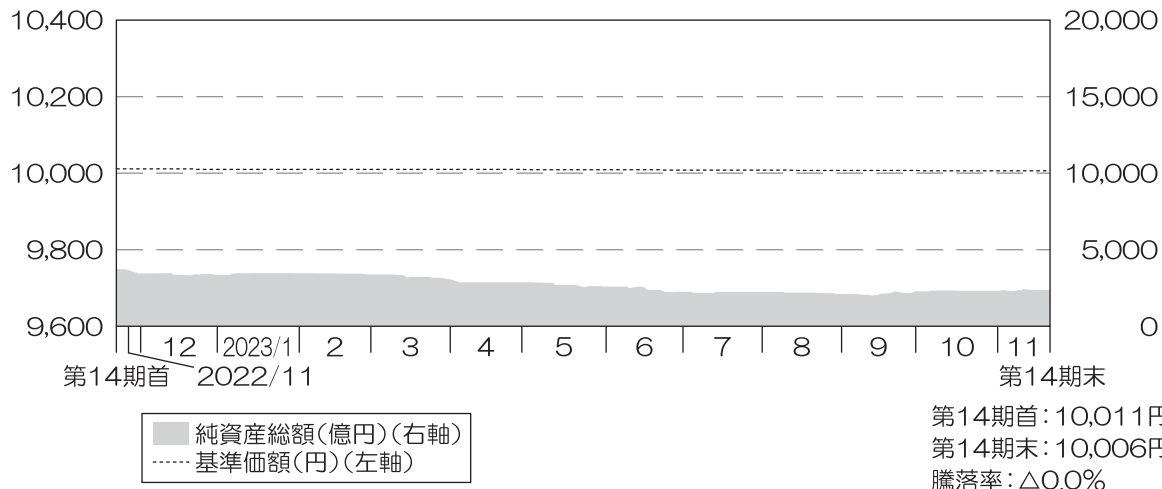
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

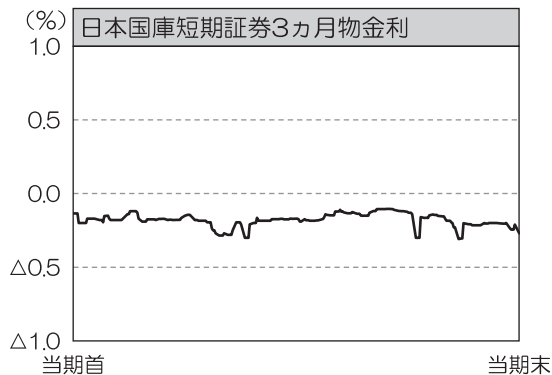
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09\sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

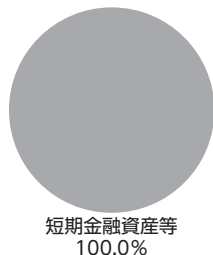
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

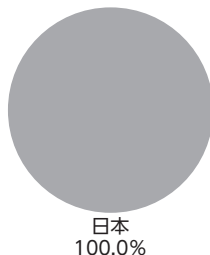
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

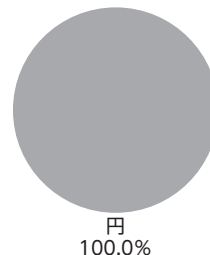
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月22日～2023年11月20日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,008円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	2,743	2,743	100.0	2,743	2,743	100.0
コール・ローン	68,107,751	6,936,530	10.2	68,243,391	6,936,530	10.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 236,294,933	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	236,294,933	100.0

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年11月20日現在
(A) 資 産	236,294,933,614円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	236,294,933,614
(B) 負 債	168,372
未 払 解 約 金	312
未 払 利 息	168,060
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	236,294,765,242
元 本	236,149,122,113
次 期 繰 越 損 益 金	145,643,129
(D) 受 益 権 総 口 数	236,149,122,113口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,006円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月22日 至 2023年11月20日
(A) 配 当 等 収 益	△136,362,073円
受 取 利 息	1,349,312
支 払 利 息	△137,711,385
(B) そ の 他 費 用	△8,267
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△136,370,340
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	419,101,500
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	157,694,376
(F) 解 約 差 損 益 金	△294,782,407
(G) 計 (C+D+E+F)	145,643,129
次 期 繰 越 損 益 金(G)	145,643,129

(注1) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は371,514,353,891円、期中追加設定元本額は203,687,601,171円、期中一部解約元本額は339,052,832,949円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	29,984,348,102円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	22,126,405,859円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	20,952,134,762円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,600,709,531円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,193,884,540円
TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,283,093,910円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,267,456,713円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,207,510,680円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,350,760,490円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,569,885,014円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	11,549,438,116円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	11,335,004,900円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	5,243,994,378円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,930,619,829円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,196,843,214円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	1,990,042,460円
225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,604,724,257円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	298,332,775円
私募マネー・プールファンドAL (適格機関投資家専用)	159,522,532円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円

バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
TOPIXベアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,790円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,994円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9,979円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
債券コア・セクション	9,956円
債券コア戦略ファンド	9,953円
国内株式SMTBセクション (SMA専用)	9,953円
外国債券SMTBセクション (SMA専用)	9,952円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951円
外国株式SMTBセクション (SMA専用)	9,951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円

お知らせ

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

(変更日：2023年7月8日)

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2023年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454,282	3.0	97.3	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	304,255
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	306,130
第23期(2023年5月29日)	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4	269,104

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2022年 5月30日	30,737	—	509,621	—	97.2
5月末	30,959	0.7	512,002	0.5	97.1
6月末	31,703	3.1	527,332	3.5	97.7
7月末	31,929	3.9	528,619	3.7	98.4
8月末	31,545	2.6	523,319	2.7	97.7
9月末	31,260	1.7	516,025	1.3	97.5
10月末	32,175	4.7	531,092	4.2	97.1
11月末	31,207	1.5	516,243	1.3	97.7
12月末	29,688	△3.4	494,385	△3.0	97.4
2023年 1月末	30,038	△2.3	498,367	△2.2	97.4
2月末	30,402	△1.1	503,372	△1.2	97.6
3月末	30,785	0.2	507,635	△0.4	98.2
4月末	31,011	0.9	513,970	0.9	98.5
(当期末) 2023年 5月29日	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4

(注1)騰落率は期首比です。

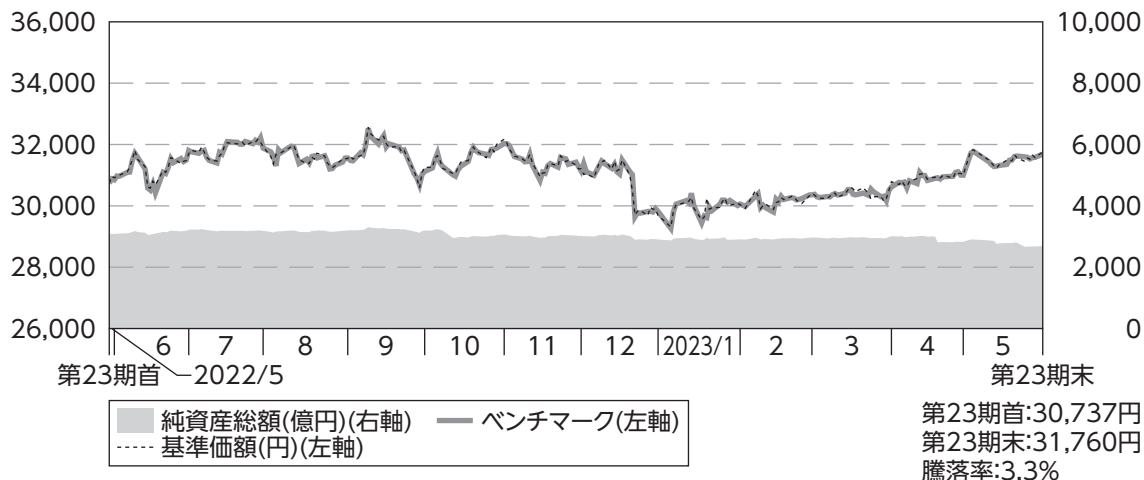
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



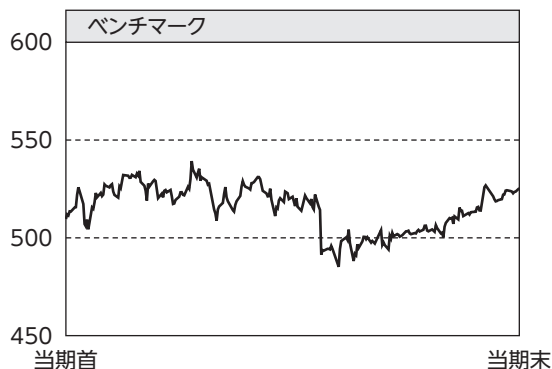
(注)ベンチマークは、2022年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

期初から2022年10月にかけて、欧米を中心にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要国の長期金利は上昇（債券価格は下落）する一方、主要通貨が対円で上昇し、基準価額はレンジ圏での推移となりました。2023年1月にかけては、日銀が長期金利変動許容幅を引き上げたことが実質的な利上げと受け止められると主要通貨は対円で急落し、基準価額も急落しました。その後は、米国で早期に利上げが停止するとの期待が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）が大幅利上げを継続したことなどから、主要国通貨が対円で上昇し、基準価額は上昇傾向となりました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2022年10月にかけて、世界的にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要国の長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。その後は、主要中央銀行の利上げ長期化観測がある一方、利上げ継続による景気後退が懸念され、期末にかけて一進一退の展開となりました。

外国為替市場では、2022年10月にかけて、世界的にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要通貨は対円で上昇しました。2023年1月にかけて、日銀の長期金利変動許容幅引き上げが実質的な利上げと受け止められたことなどを背景に、主要通貨は対円で下落しました。その後は、米国で早期に利上げが停止するとの期待が後退して米ドル買いが優勢になったことや、ECBが大幅利上げを継続したことなどから、主要通貨は対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

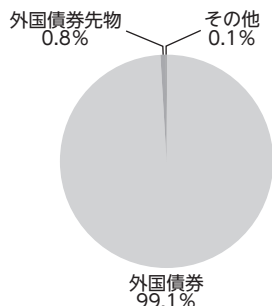
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	0.7%
2	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.6%
3	T 0.75% 11/15/24	アメリカ	0.5%
4	T 1.875% 02/15/32	アメリカ	0.5%
5	T 2.25% 11/15/24	アメリカ	0.5%
6	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.5%

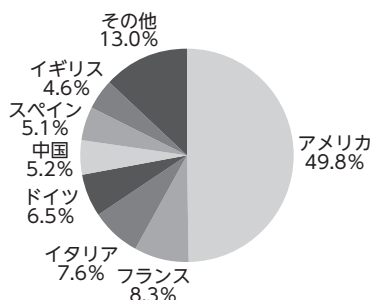
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.875% 05/15/32	アメリカ	0.5%
8	CGB 2.69% 08/12/26	中国	0.5%
9	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.5%
10	T 0.875% 11/15/30	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		858	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

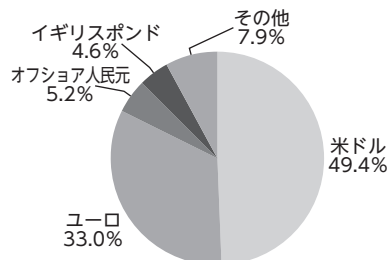
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

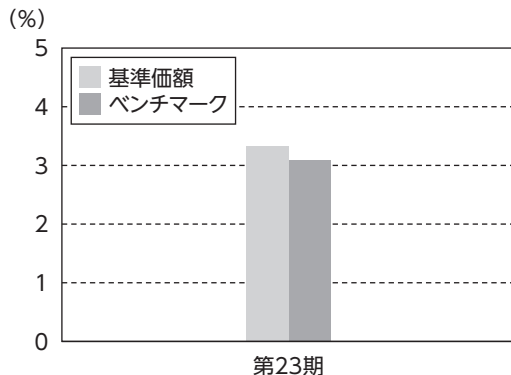


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年5月31日~2023年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	9	0.028	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(9)	(0.028)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	9	0.029	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(31,058円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 291,181	千米ドル 450,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 22,550	千カナダドル 29,986
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 83,736	千メキシコペソ 119,338
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 39,655	千ユーロ 59,088
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,944	67,996
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	32,997	65,745
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	5,527	12,331
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	20,108	38,722
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	6,771	13,644
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	5,315	8,734
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,026	3,771
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	1,078	4,239
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 26,922	千イギリスポンド 31,463
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,276	千スウェーデンクローナ 24,806
ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 8,130	千ノルウェークローネ 29,819	
デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 7,718	千デンマーククローネ 24,394	
ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 8,717	千ポーランドズロチ 16,496	
オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 9,435	千オーストラリアドル 14,496	
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 8,548	千ニュージーランドドル 1,130	
シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,749	千シンガポールドル 5,246	
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,220	千マレーシアリンギット 14,219	
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 629,768	千オフショア人民元 214,171	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 4,293	千イスラエルシェケル 13,290	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 42,161	百万円 45,769	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 40,218	百万円 79	% 0.2	百万円 82,758	百万円 473	% 0.6
金 銭 信 託	0.427490	0.427490	100.0	0.427490	0.427490	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	847,555	80,237	9.5	851,183	80,321	9.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,054,670	千米ドル 938,245	千円 132,076,799	% 49.1	% —	% 20.9	% 18.3	% 9.9
カ ナ ダ	千カナダドル 56,670	千カナダドル 52,066	5,386,311	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 335,590	千メキシコペソ 311,521	2,492,327	0.9	—	0.5	0.3	0.2
ド イ ツ	千ユーロ 122,600	千ユーロ 113,353	17,098,288	6.4	—	3.5	2.0	0.9
イ タ リ ア	145,640	132,757	20,025,148	7.4	—	4.0	2.4	1.0
フ ラ ン ス	161,860	145,775	21,988,796	8.2	—	4.8	2.4	1.0
オ ラ ン ダ	30,620	27,405	4,133,806	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ス ペ イ ン	97,450	88,959	13,418,603	5.0	—	2.8	1.6	0.6
ベ ル ギ ー	36,050	32,542	4,908,759	1.8	—	1.2	0.5	0.1
オ ー ス ト リ ア	24,490	21,572	3,253,970	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	10,470	8,772	1,323,261	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ア イ ル ラ ン ド	12,120	10,394	1,567,952	0.6	—	0.4	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 88,580	千イギリスポンド 70,281	12,212,839	4.5	—	3.3	0.9	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 43,410	千スウェーデンクローナ 41,375	538,704	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 36,040	千ノルウェークローネ 33,237	421,449	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 44,580	千デンマーククローネ 41,319	836,728	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 43,230	千ポーランドズロチ 37,673	1,255,308	0.5	—	0.1	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 48,730	千オーストラリアドル 44,591	4,097,096	1.5	—	1.0	0.4	0.2
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 8,340	千ニューージーランドドル 7,401	630,503	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 11,790	千シンガポールドル 11,454	1,191,922	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 47,320	千マレーシアリンギット 48,208	1,469,405	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 679,750	千オフショア人民元 690,383	13,727,304	5.1	—	2.3	1.8	1.0
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 22,170	千イスラエルシェケル 20,645	779,396	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	264,834,684	98.4	—	49.0	33.0	16.5

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.25% 05/31/25	0.25	3,900	3,580	503,989	2025/5/31
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,549	1,203,463	2024/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	3,800	3,482	490,282	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,749	668,639	2025/7/31
T 0.25% 09/30/25	0.25	3,000	2,728	384,062	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,260	459,034	2025/10/31
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,213	1,015,479	2026/1/31
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,382	1,039,168	2025/4/30
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,542	1,202,468	2024/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,729	665,826	2027/7/31
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,726	665,316	2024/8/15
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,218	875,315	2024/9/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	9,880	8,453	1,190,009	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,719	382,817	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,620	509,708	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	4,500	4,061	571,689	2026/2/28
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,698	942,911	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,562	360,675	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,042	428,250	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	6,960	6,033	849,386	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,019	565,802	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,435	905,883	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	7,500	6,586	927,246	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	9,100	7,320	1,030,510	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,159	1,007,869	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	9,562	1,346,056	2030/8/15
T 0.625% 10/15/24	0.625	5,080	4,787	673,964	2024/10/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,153	303,081	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	9,600	8,249	1,161,273	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,333	1,032,323	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	6,000	5,448	766,921	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	9,500	8,595	1,210,008	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,611	508,344	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	1,830	1,640	230,882	2026/8/31
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,225	1,439,395	2024/11/15
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,242	1,019,570	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,392	759,135	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,063	1,275,870	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,036	849,802	2028/7/31
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,542	1,061,757	2024/12/15
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,410	902,381	2025/1/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	4,080	3,371	474,583	2031/2/15
T 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	7,990	1,124,775	2025/2/28
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,016	987,655	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,090	153,532	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	5,200	3,287	462,763	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	7,410	6,419	903,732	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	8,480	7,464	1,050,808	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,030	989,635	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,550	3,046	428,906	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,263	740,939	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	4,000	3,502	493,101	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	9,230	7,589	1,068,400	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	9,500	8,271	1,164,325	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,343	892,990	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,451	908,163	2026/12/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,783	532,561	2025/1/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	5,700	3,232	455,010	2050/8/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	3,520	3,080	433,600	2028/10/31

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 1.375% 11/15/31	1.375	11,030	9,109	1,282,336	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	3,950	556,112	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,274	601,786	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,468	769,775	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,575	784,837	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	6,896	970,859	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,119	1,142,597	2024/9/30
T 1.5% 11/30/24	1.5	8,800	8,372	1,178,530	2024/11/30
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,597	928,752	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,600	5,218	734,669	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,105	296,430	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	4,450	3,794	534,163	2031/5/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	5,919	833,352	2029/8/15
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,576	362,685	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	4,184	589,086	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,392	618,353	2026/11/30
T 1.75% 01/31/29	1.75	6,000	5,335	751,134	2029/1/31
T 1.75% 03/15/25	1.75	2,100	1,993	280,680	2025/3/15
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,420	2,313	325,693	2024/6/30
T 1.75% 08/15/41	1.75	4,680	3,242	456,440	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,646	372,606	2029/11/15
T 1.875% 02/15/32	1.875	11,720	10,060	1,416,238	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	5,655	796,160	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	4,270	601,126	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,691	519,606	2027/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	4,835	680,638	2026/7/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,768	811,973	2024/8/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	3,300	2,125	299,211	2051/11/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,081	1,137,602	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	2,750	1,846	259,875	2050/2/15
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,206	451,419	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,000	5,313	748,028	2024/6/30
T 2% 08/15/25	2.0	3,850	3,271	460,463	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	7,850	5,227	735,890	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	3,220	2,998	422,054	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	6,200	4,477	630,289	2041/11/15
T 2.125% 05/15/25	2.125	4,230	4,034	567,917	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,387	476,811	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,636	652,693	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,815	677,826	2024/9/30
T 2.25% 02/15/27	2.25	5,550	5,198	731,772	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	4,300	3,037	427,642	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,102	999,810	2026/3/31
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	4,911	691,444	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	7,530	7,010	986,916	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,014	424,386	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	3,922	552,201	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,067	854,165	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	9,768	1,375,067	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,181	588,612	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,098	999,278	2027/11/15
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,187	730,211	2024/12/31
T 2.375% 02/15/42	2.375	5,500	4,230	595,495	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	4,900	4,503	633,984	2029/3/31
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,467	347,380	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	11,690	10,970	1,544,261	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,352	1,035,005	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	8,150	5,936	835,628	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,841	681,524	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	4,100	3,004	422,959	2049/11/15
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,818	678,266	2025/1/31

銘柄	利 率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.5% 02/15/45	2.5	2,810	2,144	301,864	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	2,450	1,859	261,729	2046/2/15
T 2.5% 03/31/27	2.5	7,100	6,701	943,344	2027/3/31
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,693	1,083,028	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,450	1,098	154,682	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,491	632,332	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	3,340	3,115	438,609	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	6,991	984,224	2025/3/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,575	784,909	2025/12/31
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,203	873,240	2028/2/15
T 2.75% 05/31/29	2.75	5,700	5,343	752,177	2029/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,305	746,819	2025/6/30
T 2.75% 08/15/32	2.75	13,800	12,672	1,783,952	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	8,700	7,098	999,230	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,210	451,997	2047/8/15
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,649	936,027	2025/8/31
T 2.75% 11/15/42	2.75	6,020	4,897	689,418	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,417	340,359	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	3,871	544,933	2025/4/30
T 2.875% 04/30/29	2.875	3,300	3,116	438,691	2029/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	6,902	971,689	2028/5/15
T 2.875% 05/15/32	2.875	10,100	9,386	1,321,363	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	2,750	2,277	320,604	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	4,530	637,700	2049/5/15
T 2.875% 05/15/52	2.875	7,600	6,171	868,774	2052/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,695	520,243	2025/8/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,277	742,964	2025/7/31
T 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,718	523,483	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	1,873	263,740	2045/8/15
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,031	286,014	2046/11/15
T 3% 02/15/47	3.0	1,600	1,328	187,004	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	1,000	830	116,951	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	1,000	832	117,188	2049/2/15
T 3% 05/15/45	3.0	700	583	82,170	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	2,666	375,433	2047/5/15
T 3% 07/15/25	3.0	6,900	6,687	941,414	2025/7/15
T 3% 08/15/48	3.0	3,250	2,701	380,227	2048/8/15
T 3% 08/15/52	3.0	5,200	4,333	610,079	2052/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,067	572,526	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	4,837	681,029	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,341	329,612	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	914	128,746	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,726	243,053	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,042	709,812	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,840	1,574	221,611	2044/8/15
T 3.125% 08/31/29	3.125	7,150	6,839	962,746	2029/8/31
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,059	1,134,499	2028/11/15
T 3.25% 05/15/42	3.25	4,150	3,668	516,442	2042/5/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	2,685	377,985	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	4,720	664,522	2048/11/15
T 3.5% 02/15/33	3.5	6,000	5,853	824,032	2033/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	732	103,115	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,228	313,650	2044/2/15
T 3.625% 02/15/53	3.625	800	754	106,140	2053/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	1,862	262,184	2043/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	2,844	400,402	2043/11/15
T 3.875% 01/15/26	3.875	6,500	6,424	904,425	2026/1/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,427	200,994	2040/8/15
T 3.875% 09/30/29	3.875	3,540	3,531	497,138	2029/9/30
T 3.875% 11/30/29	3.875	3,500	3,493	491,790	2029/11/30
T 4% 02/15/26	4.0	6,500	6,448	907,695	2026/2/15
T 4% 02/28/30	4.0	6,200	6,241	878,603	2030/2/28
T 4% 11/15/52	4.0	7,800	7,870	1,107,956	2052/11/15

銘柄	利 率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 4.125% 10/31/27	4.125	3,100	3,110	437,895	2027/10/31
T 4.125% 11/15/32	4.125	7,550	7,736	1,089,051	2032/11/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	934	934	131,523	2039/5/15
T 4.25% 10/15/25	4.25	6,900	6,871	967,310	2025/10/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	740	763	107,465	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,057	148,806	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	1,993	280,689	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,037	286,575	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	960	1,008	141,980	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,174	165,321	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	588	82,855	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	1,815	255,933	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,493	210,281	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	821	115,696	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	400	451	63,494	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,379	194,259	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,151	302,852	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,773	249,647	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,574	221,657	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,201	169,154	2030/5/15
小 計				132,076,799	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,061	213,294	2026/3/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	3,010	2,775	287,156	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	1,910	1,552	160,562	2030/12/1
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	665	68,864	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	733	75,852	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,400	144,889	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,366	141,323	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	780	713	73,798	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,980	3,462	358,168	2030/6/1
CAN 1.5% 04/01/25	1.5	1,460	1,387	143,531	2025/4/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	1,590	1,543	159,635	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	910	850	87,960	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,457	357,721	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,154	119,456	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	2,190	1,892	195,733	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	2,890	2,036	210,671	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	410	383	39,637	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,520	1,361	140,877	2032/6/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	3,400	2,579	266,899	2051/12/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,280	1,232	127,513	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	240	225	23,324	2029/6/1
CAN 2.25% 12/01/29	2.25	510	476	49,342	2029/12/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	450	440	45,535	2024/6/1
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	2,300	2,144	221,823	2032/12/1
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	190	180	18,689	2033/6/1
CAN 2.75% 08/01/24	2.75	840	821	84,971	2024/8/1
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	1,600	1,544	159,739	2027/9/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,050	945	97,830	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	460	408	42,249	2055/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	542	56,155	2064/12/1
CAN 3% 10/01/25	3.0	510	497	51,460	2025/10/1
CAN 3% 11/01/24	3.0	2,160	2,113	218,662	2024/11/1
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	1,160	1,156	119,625	2028/3/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,050	1,072	110,972	2045/12/1
CAN 3.75% 02/01/25	3.75	2,030	2,007	207,693	2025/2/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	740	801	82,936	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	890	1,051	108,794	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,490	1,678	173,627	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,120	1,346	139,328	2033/6/1
小 計				5,386,311	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(メキシコ)					
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,260	74,090	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	30,220	241,775	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	17,480	15,971	127,776	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	20,300	17,845	142,771	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	45,330	41,036	328,311	2026/3/5
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	13,190	11,898	95,190	2033/5/26
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	27,110	25,477	203,832	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	40,630	37,777	302,237	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	28,610	24,865	198,936	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	8,850	8,088	64,708	2034/11/23
MBONO 8% 07/31/53	8.0	8,850	7,814	62,522	2053/7/31
MBONO 8% 09/05/24	8.0	22,160	21,420	171,375	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	24,600	21,796	174,383	2047/11/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	24,700	24,128	193,039	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	14,670	13,920	111,374	2038/11/18
小 計				2,492,327	
(ドイツ)					
国債証券					
BKO 0.2% 06/14/24	0.2	1,060	1,028	155,193	2024/6/14
BKO 0.4% 09/13/24	0.4	1,820	1,760	265,511	2024/9/13
BKO 2.2% 12/12/24	2.2	1,390	1,372	207,103	2024/12/12
BKO 2.5% 03/13/25	2.5	1,200	1,190	179,530	2025/3/13
DBR 0% 02/15/30	—	1,470	1,248	188,309	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	1,130	936	141,217	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	3,660	2,957	446,148	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,380	1,744	263,213	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	2,230	1,584	238,950	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	2,350	2,160	325,886	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	2,950	2,532	381,988	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	2,350	1,971	297,446	2030/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	1,480	1,244	187,646	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,430	2,726	411,273	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,580	2,283	344,420	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,700	801	120,924	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,420	2,163	326,365	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	1,990	1,738	262,268	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,940	1,781	268,658	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	2,410	2,125	320,604	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,343	353,448	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	2,955	445,771	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,825	426,174	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,860	2,605	393,049	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	530	487	73,470	2027/8/15
DBR 1% 05/15/38	1.0	1,410	1,113	167,988	2038/5/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	1,953	294,660	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,430	2,334	352,078	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,080	2,314	349,134	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,257	340,484	2024/5/15
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	3,160	2,953	445,506	2032/8/15
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	1,380	1,130	170,598	2053/8/15
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	2,710	2,642	398,580	2029/11/15
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	1,700	1,665	251,176	2033/2/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,780	2,695	406,629	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	2,890	2,815	424,675	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,830	1,971	297,333	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,440	2,804	422,980	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,900	2,272	342,768	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,430	1,581	238,590	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,130	2,572	387,967	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,640	2,087	314,888	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,424	516,604	2031/1/4

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	2,673	403,265	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,533	231,349	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,880	2,162	326,243	2027/7/4
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	2,842	428,697	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	1,250	1,184	188,670	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	2,550	2,308	348,181	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,400	2,197	331,409	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	4,000	3,744	564,786	2025/10/10
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,311	348,698	2024/10/18
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	3,550	3,366	507,791	2027/10/15
OBL 2.2% 04/13/28	2.2	1,900	1,869	281,972	2028/4/13
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 04/01/26	—	2,240	2,021	304,920	2026/4/1
BTPS 0% 08/01/26	—	1,280	1,140	172,014	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,438	216,914	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	750	710	107,196	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,421	214,399	2028/3/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	550	82,999	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,704	257,179	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,759	265,336	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	1,300	1,099	165,903	2028/7/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,384	359,725	2031/8/1
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,036	307,123	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,920	2,290	345,535	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	650	98,084	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	1,550	1,171	176,735	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,798	271,217	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,490	1,326	200,163	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,646	248,328	2031/12/1
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	2,000	1,815	273,825	2027/4/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,797	271,099	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,850	1,554	234,422	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	700	492	74,241	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,210	333,455	2025/5/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,330	351,521	2024/11/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	717	108,270	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,314	349,058	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,080	1,017	153,993	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	2,100	1,710	257,987	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,136	322,311	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	923	139,274	2051/9/1
BTPS 1.75% 05/30/24	1.75	1,910	1,875	282,874	2024/5/30
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	980	147,960	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	660	435	65,656	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	250	246	37,119	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,609	393,677	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,089	315,138	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	3,220	3,098	467,311	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,564	386,771	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	1,440	1,374	207,348	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	590	317	47,917	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	1,020	614	92,730	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,154	324,916	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	2,050	1,582	238,713	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,219	334,768	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,010	667	100,726	2050/9/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,200	2,145	323,634	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	2,906	438,459	2024/12/1
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	1,350	1,162	175,293	2032/12/1
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	1,760	1,678	253,189	2027/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,110	802	121,037	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	830	546	82,456	2067/3/1

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	2,610	2,445	368,901	2029/6/15	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,420	1,345	202,923	2028/12/1	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	1,180	965	145,634	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	2,170	2,057	310,334	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,161	175,220	2040/3/1	
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	960	816	123,194	2038/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	2,270	1,815	273,870	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,120	998	150,564	2035/3/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,820	1,492	225,133	2048/3/1	
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	910	906	136,786	2026/1/15	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,360	2,290	345,500	2030/3/1	
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,155	325,127	2024/9/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,470	1,278	192,894	2049/9/1	
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	900	889	134,199	2029/12/15	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	2,850	2,682	404,606	2037/2/1	
BTPS 4% 04/30/35	4.0	1,150	1,092	164,729	2035/4/30	
BTPS 4% 10/30/31	4.0	1,250	1,233	186,064	2031/10/30	
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	400	401	60,568	2033/5/1	
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	700	670	101,187	2043/9/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,126	320,690	2026/3/1	
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	450	428	64,607	2053/10/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	2,740	413,449	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,500	1,500	226,357	2044/9/1	
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,130	3,206	483,623	2025/3/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,080	3,210	484,304	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,450	2,539	383,043	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,680	2,775	418,662	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,710	2,909	438,944	2029/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,528	381,358	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,140	1,283	193,589	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,700	3,004	453,158	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,560	235,384	2026/11/1	
(フランス)						
国債証券						
FRTR 0% 02/25/25	—	2,240	2,123	320,361	2025/2/25	
FRTR 0% 02/25/26	—	3,340	3,083	465,152	2026/2/25	
FRTR 0% 02/25/27	—	4,560	4,097	618,067	2027/2/25	
FRTR 0% 03/25/25	—	4,790	4,532	683,752	2025/3/25	
FRTR 0% 05/25/32	—	3,280	2,510	378,662	2032/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	2,930	2,431	366,790	2029/11/25	
FRTR 0% 11/25/30	—	6,500	5,227	788,443	2030/11/25	
FRTR 0% 11/25/31	—	5,500	4,281	645,831	2031/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,271	644,306	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,590	3,415	515,210	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	3,550	3,305	498,638	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	3,950	3,434	518,051	2029/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	2,690	1,683	253,968	2040/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	352	53,241	2072/5/25	
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,480	834	125,889	2044/6/25	
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	4,700	4,256	642,053	2028/2/25	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	4,790	4,319	651,493	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	2,940	1,491	224,924	2052/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	3,160	1,559	235,309	2053/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,220	787,520	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,318	651,475	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,280	4,080	615,524	2025/11/25	
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	3,840	3,153	475,625	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,450	3,490	526,472	2036/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,170	4,645	700,800	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	2,490	1,630	245,931	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,480	939	141,732	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	2,920	2,342	353,284	2039/6/25	
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,075	614,819	2024/11/25	

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
FRTR 2% 05/25/48	2.0	2,860	2,152	324,660	2048/5/25	
FRTR 2% 11/25/32	2.0	2,900	2,650	399,844	2032/11/25	
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,340	3,308	499,004	2024/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	4,980	4,851	731,745	2030/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	520	445	67,146	2043/5/25	
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	900	886	133,749	2026/9/24	
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	500	494	74,635	2029/2/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	3,330	3,309	499,275	2027/10/25	
FRTR 3% 05/25/33	3.0	950	940	141,914	2033/5/25	
FRTR 3% 05/25/54	3.0	700	623	94,082	2054/5/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,080	2,965	447,390	2045/5/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,730	4,803	724,552	2026/4/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,020	2,196	331,371	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,780	1,951	294,331	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	3,614	545,176	2038/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,100	3,533	533,048	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,440	2,796	421,830	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,920	6,733	1,015,689	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,590	4,373	659,716	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,030	306,293	2025/10/25	
(オランダ)						
国債証券						
NETHER 0% 01/15/26	—	1,190	1,103	166,492	2026/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,663	250,930	2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/29	—	1,610	1,379	208,039	2029/1/15	
NETHER 0% 01/15/38	—	960	620	93,532	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,740	782	117,999	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,350	1,109	167,427	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,410	1,126	169,866	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,350	1,276	192,501	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	950	816	123,177	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,380	932	140,608	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,420	1,321	199,334	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	1,020	829	125,183	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	829	125,123	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,537	231,893	2028/7/15	
NETHER 2% 01/15/54	2.0	630	512	77,279	2054/1/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	1,965	296,527	2024/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	400	392	59,144	2030/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,430	1,387	209,242	2033/1/15	
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	560	542	81,901	2033/7/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,840	1,783	269,026	2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,700	1,879	283,482	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,720	1,907	287,743	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,530	1,706	257,347	2028/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,164	326,481	2025/1/31	
SPGB 0% 01/31/26	—	2,660	2,446	369,010	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	1,810	1,611	243,135	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	2,430	2,094	316,009	2028/1/31	
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,042	308,155	2024/5/31	
SPGB 0% 05/31/25	—	2,310	2,167	326,891	2025/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	1,200	928	140,020	2031/4/30	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,212	333,800	2024/7/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	2,750	2,275	343,205	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	2,570	2,023	305,219	2031/10/31	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	1,220	1,032	155,692	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,736	261,873	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,213	333,933	2027/7/30	
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	2,200	1,894	285,743	2029/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	979	147,803	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	890	534	80,553	2042/7/30	

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,880	935	141,046	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	1,960	1,276	192,529	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,990	1,715	258,739	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,650	2,492	375,967	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,170	1,991	300,424	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	1,980	1,807	272,687	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,430	366,598	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,890	1,754	264,622	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	292	44,173	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,500	1,408	212,430	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,450	1,408	212,448	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,180	1,780	268,498	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,190	733	110,708	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,300	2,222	335,211	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,600	1,458	219,925	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,570	1,535	231,573	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,150	1,924	290,316	2033/7/30
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	1,980	1,824	275,168	2032/10/31
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,710	1,333	201,077	2048/10/31
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	1,350	1,343	202,693	2024/10/31
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	1,000	986	148,871	2026/5/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,960	1,615	243,756	2046/10/31
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	1,700	1,636	246,837	2033/4/30
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	530	481	72,699	2043/7/30
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,380	1,167	176,084	2066/7/30
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	1,720	1,727	260,629	2024/4/30
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	670	661	99,845	2039/7/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,950	2,024	305,341	2037/1/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	2,926	441,388	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,700	1,848	278,887	2041/7/30
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,730	1,926	290,564	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,140	3,427	517,032	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,490	1,714	258,573	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,366	507,837	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,224	335,480	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,195	180,399	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	780	687	103,708	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	—	1,480	1,144	172,571	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,040	851	128,382	2030/6/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	1,390	1,085	163,754	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	510	306	46,181	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,420	1,369	206,538	2024/10/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	440	166	25,175	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,240	2,142	323,180	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,554	234,500	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,600	1,445	218,020	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,630	1,449	218,607	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,460	1,378	207,955	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,270	1,083	163,485	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	870	732	110,555	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	1,050	626	94,521	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	623	94,038	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,080	734	110,765	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	820	551	83,240	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	650	529	79,844	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	880	614	92,706	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	670	495	74,723	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	950	943	142,297	2024/6/22
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	400	362	54,660	2039/4/22
BGB 3% 06/22/33	3.0	600	588	88,716	2033/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	950	924	139,415	2034/6/22
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	600	556	83,880	2054/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	930	951	143,475	2045/6/22

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,151	173,617	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,850	2,017	304,301	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,187	179,104	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,590	1,840	277,673	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,190	2,447	369,156	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	750	613	92,479	2030/2/20
RAGB 0% 02/20/31	—	1,420	1,121	169,200	2031/2/20
RAGB 0% 04/20/25	—	1,030	972	146,756	2025/4/20
RAGB 0% 07/15/24	—	580	560	84,498	2024/7/15
RAGB 0% 10/20/28	—	730	622	93,935	2028/10/20
RAGB 0% 10/20/40	—	470	264	39,903	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	403	60,854	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,410	1,227	185,225	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	993	149,923	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	280	117	17,664	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	880	795	120,509	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	740	400	60,401	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	1,936	292,404	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	230	88	13,356	2120/6/30
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	1,230	1,021	154,122	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,190	1,142	172,265	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,080	757	114,187	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	152	22,809	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	970	146,317	2024/10/21
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	460	341	51,511	2049/5/23
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	650	447	67,458	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	730	675	101,951	2034/5/23
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	550	536	80,944	2033/2/20
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	220	218	33,031	2029/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	590	570	86,083	2044/6/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	465	70,164	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,570	1,702	256,847	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,070	1,125	169,799	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,327	200,170	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/24	—	420	403	60,886	2024/9/15
RFGB 0% 09/15/26	—	300	273	41,209	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	640	514	77,613	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	440	293	44,301	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	199	30,133	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	370	291	43,912	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	300	179	27,032	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	579	87,470	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	490	289	43,675	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	540	488	73,640	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	730	643	97,102	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	530	455	68,728	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	470	394	59,576	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	440	420	63,368	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	370	299	45,163	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	350	330	49,876	2027/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	341	51,537	2047/4/15
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	570	496	74,883	2032/9/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	520	470	70,961	2042/7/4
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	290	268	40,475	2038/4/15
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	546	82,379	2028/7/4
RFGB 4% 07/04/25	4.0	580	592	89,332	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	—	850	665	100,378	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	670	602	90,927	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	780	641	96,769	2030/10/18

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	370	55,886	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/31	0.4	610	444	66,994	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	360	223	33,638	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	770	701	105,855	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,000	946	142,797	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,060	955	144,170	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	430	365	55,199	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	470	419	63,346	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	526	79,475	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	580	474	71,544	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	980	762	115,020	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	790	766	115,606	2030/5/15
IRISH 3% 10/18/43	3.0	340	318	48,108	2043/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,208	182,233	2025/3/13
ユ ー ロ 計				87,718,587	
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,260	1,124	195,437	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	1,510	1,243	216,026	2028/1/31
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	2,960	2,741	476,471	2025/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,710	1,965	341,471	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	2,580	2,242	389,613	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,150	1,626	282,643	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,930	1,558	270,735	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,740	491	85,416	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,400	1,296	225,357	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	1,700	1,092	189,924	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	1,070	412	71,659	2050/10/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,620	768	133,511	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	1,630	1,166	202,783	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,400	1,139	197,947	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	3,150	2,404	417,839	2032/1/31
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	1,950	1,198	208,291	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	1,050	368	63,971	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	838	145,685	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	2,620	1,239	215,312	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	1,960	1,148	199,642	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,462	254,146	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,700	926	161,001	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	970	481	83,706	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,070	934	162,375	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,340	682	118,593	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,180	530	92,204	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	600	341	59,290	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,560	808	140,502	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,890	1,337	232,394	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,380	2,247	390,628	2025/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,420	890	154,657	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,647	286,347	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,760	1,431	248,679	2044/1/22
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	1,410	1,289	223,998	2033/1/31
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,970	1,656	287,872	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,530	1,238	215,185	2068/7/22
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	900	819	142,337	2038/1/29
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,320	1,134	197,057	2052/7/22
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	1,170	998	173,509	2053/10/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,250	1,127	195,899	2060/1/22
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	2,150	2,111	366,895	2027/1/29
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	1,603	278,723	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,500	1,500	260,694	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,270	1,218	211,751	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,460	1,451	252,189	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,450	1,386	240,925	2040/12/7

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,590	1,493	259,577	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,110	1,040	180,770	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,780	1,673	290,823	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,390	1,401	243,552	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	1,800	1,768	307,284	2042/12/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,509	262,228	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,400	1,427	248,016	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,180	1,184	205,883	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,350	1,458	253,450	2028/12/7
小 計				12,212,839	
(スウェーデン)		千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ		
国債証券					
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	4,470	3,730	48,576	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,430	5,899	76,807	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	4,600	4,134	53,827	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,980	7,529	98,036	2026/11/12
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	2,700	2,540	33,078	2033/11/11
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	5,510	5,421	70,591	2032/6/1
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,730	7,653	99,652	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	3,990	4,464	58,133	2039/3/30
小 計				538,704	
(ノルウェー)		千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ		
国債証券					
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,680	3,111	39,450	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	5,200	4,535	57,514	2030/8/19
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,090	3,890	49,332	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,230	3,998	50,702	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	6,260	6,070	76,975	2025/3/13
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	4,250	3,865	49,020	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	2,370	2,226	28,236	2028/4/26
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,360	3,027	38,389	2032/5/18
NGB 3% 08/15/33	3.0	2,600	2,510	31,827	2033/8/15
小 計				421,449	
(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		
国債証券					
DGB 0% 11/15/24	—	3,840	3,679	74,510	2024/11/15
DGB 0% 11/15/31	—	5,340	4,245	85,972	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	5,170	2,572	52,094	2025/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	6,850	6,209	125,735	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	6,100	5,298	107,285	2029/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	6,560	6,369	128,989	2025/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	10,720	12,945	282,140	2039/11/15
小 計				836,728	
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 0% 07/25/24	—	1,310	1,226	40,856	2024/7/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	1,240	1,023	34,111	2026/10/25
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,233	107,726	2025/4/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,989	99,621	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	2,650	1,873	62,414	2032/4/25
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,735	124,482	2024/10/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,900	4,414	147,092	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	4,760	4,145	138,146	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	2,100	1,810	60,343	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,000	4,983	166,049	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,030	3,813	127,053	2025/7/25
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	2,460	2,254	75,135	2027/5/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	591	19,705	2029/4/25
POLGB 6% 10/25/33	6.0	810	805	26,827	2033/10/25
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	730	772	25,741	2028/7/25
小 計				1,255,308	

当		期		末		償還年月日
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(オーストラリア)						
国債証券		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	2,800	2,662	244,635	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,100	1,940	178,310	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	1,210	1,099	101,026	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	2,780	2,238	205,696	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,810	2,322	213,432	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,440	1,984	182,310	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	2,170	1,843	169,416	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,670	997	91,696	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	1,820	1,534	141,006	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,480	1,398	128,488	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	1,550	1,445	132,806	2030/5/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,180	976	89,680	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,200	1,074	98,703	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,874	172,248	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,599	146,960	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,460	1,391	127,877	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,450	1,191	109,458	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,840	1,721	158,140	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,070	2,057	189,012	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,680	1,655	152,094	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,015	93,276	2039/6/21	
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	1,450	1,408	129,449	2034/12/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	760	744	68,385	2037/4/21	
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	1,490	1,487	136,677	2034/5/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,600	1,635	150,255	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,690	2,860	262,800	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,429	223,250	2027/4/21	
小計				4,097,096		
(ニュージーランド)						
国債証券		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル			
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	590	483	41,203	2028/5/15	
NZGB 0.5% 05/15/24	0.5	790	754	64,274	2024/5/15	
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	670	596	50,811	2026/5/15	
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	590	477	40,687	2031/5/15	
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	390	253	21,609	2041/5/15	
NZGB 2% 05/15/32	2.0	530	437	37,242	2032/5/15	
NZGB 2.75% 04/15/25	2.75	850	817	69,676	2025/4/15	
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	630	513	43,711	2037/4/15	
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	520	374	31,866	2051/5/15	
NZGB 3% 04/20/29	3.0	650	604	51,537	2029/4/20	
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	600	556	47,420	2033/4/14	
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	320	314	26,796	2034/5/15	
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	840	843	71,861	2027/4/15	
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	370	373	31,804	2030/5/15	
小計				630,503		
(シンガポール)						
国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル			
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	590	552	57,502	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	810	759	79,079	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	560	504	52,475	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	770	673	70,110	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	283	29,450	2051/10/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	630	610	63,512	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	650	603	62,768	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	900	882	91,845	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	470	441	45,926	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	510	501	52,171	2028/5/1	
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	230	222	23,185	2032/8/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	640	655	68,196	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	633	65,965	2042/4/1	

当		期		末		償還年月日
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(マレーシア)						
国債証券		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	644	67,097	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	280	278	28,976	2027/9/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	630	624	64,935	2030/9/1	
SIGB 3% 08/01/72	3.0	220	256	26,659	2072/8/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	900	893	92,989	2024/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	660	682	71,014	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	740	750	78,059	2027/3/1	
小計				1,191,922		
(中国オフショア)						
国債証券		千オフショア人民元	千オフショア人民元			
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	53,870	53,609	1,065,944	2025/4/9	
CGB 2.18% 06/25/24	2.18	19,130	19,144	380,668	2024/6/25	
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	30,220	30,189	600,281	2025/11/25	
CGB 2.29% 12/25/24	2.29	19,350	19,372	385,190	2024/12/25	
CGB 2.35% 03/15/25	2.35	10,000	10,025	199,337	2025/3/15	
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	9,300	9,294	184,808	2027/10/15	
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	23,000	23,087	459,068	2026/2/15	
CGB 2.47% 09/02/24	2.47	32,480	32,612	648,461	2024/9/2	
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	20,000	20,025	398,187	2027/4/15	
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	23,060	23,101	459,347	2027/7/25	
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	21,800	21,523	427,968	2032/9/1	
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,000	19,926	396,205	2029/9/25	
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	15,030	15,006	298,377	2030/5/21	
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	63,900	64,475	1,282,002	2026/8/12	
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	9,320	9,270	184,321	2032/8/15	
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	14,500	14,497	288,269	2032/2/17	
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	12,640	12,715	252,822	2029/6/15	
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	13,000	13,077	260,029	2029/12/15	
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	16,280	16,439	326,883	2029/3/24	
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	20,000	20,142	400,504	2030/3/25	

銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	4,000	4,011	79,764	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	29,530	29,983	596,189	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	11,300	11,470	228,073	2033/2/25
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	8,780	8,876	176,506	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	29,200	29,733	591,199	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	14,000	14,347	285,285	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	21,690	22,171	440,840	2031/5/27
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	18,800	19,167	381,109	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,400	8,409	167,204	2052/10/25
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,152	142,212	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	14,110	14,621	290,722	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	5,000	5,174	102,893	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	11,730	12,231	243,205	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	7,450	7,987	158,819	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	7,690	8,509	169,195	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	13,300	14,914	296,557	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	11,980	13,504	268,526	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	9,060	10,577	210,315	2048/10/22
小計				13,727,304	
(イスラエル) 国債証券		千イスラエル シェケル	千イスラエル シェケル		
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	3,090	2,920	110,250	2024/10/31
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	1,130	1,030	38,915	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,250	84,938	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	870	721	27,239	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	950	765	28,891	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	1,770	1,287	48,602	2037/5/31
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,240	1,173	44,304	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,600	1,491	56,321	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,700	2,497	94,266	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	500	373	14,083	2052/11/29
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,680	2,491	94,047	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,880	2,207	83,335	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,340	1,435	54,197	2026/10/30
小計				779,396	
合計				264,834,684	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当期末	
	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外 EURO-SCHATZ	206	—
US 5YR NOTE	441	—
EURO-BOBL FU	281	—
EURO-BUND	521	—
国 US 10YR NOTE	334	—
US LONG BOND	336	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 264,834,684	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,367,162	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	269,201,846	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(267,154,303千円)の投資信託財産総額(269,201,846千円)に対する比率は99.2%です。

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

1米ドル=140.77円	1カナダドル=103.45円	1メキシコペソ=8.0005円
1ユーロ=150.84円	1イギリスポンド=173.77円	1スウェーデンクローナ=13.02円
1ノルウェークローネ=12.68円	1デンマーククローネ=20.25円	1ポーランドズロチ=33.3207円
1オーストラリアドル=91.88円	1ニュージーランドドル=85.19円	1シンガポールドル=104.06円
1マレーシアリンギット=30.4803円	1オフショア人民元=19.8836円	1イスラエルシケル=37.7506円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年5月29日現在
(A)資 産	271,928,254,990円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,391,791,580
公 社 債(評価額)	264,834,684,739
未 収 入 金	2,792,724,716
未 収 利 息	1,646,262,811
前 払 費 用	123,973,402
差 入 委 託 証 拠 金	138,817,742
(B)負 債	2,824,081,059
未 払 金	2,735,121,709
未 払 解 約 金	88,955,357
未 払 利 息	3,993
(C)純 資 産 総 額(A-B)	269,104,173,931
元 本	84,730,057,526
次 期 繰 越 損 益 金	184,374,116,405
(D)受 益 権 総 口 数	84,730,057,526口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,760円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29日
(A)配 当 等 収 益	6,423,558,602円
受 取 利 息	6,418,338,564
そ の 他 収 益 金	7,179,278
支 払 利 息	△1,959,240
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,532,433,209
売 買 益	31,031,886,319
売 買 損	△27,499,453,110
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△404,926,378
取 引 益	221,330,533
取 引 損	△626,256,911
(D)そ の 他 費 用	△88,230,471
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	9,462,834,962
(F)前 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	35,831,568,281
(H)解 約 差 損 益 金	△67,453,613,892
(I) 計 (E+F+G+H)	184,374,116,405
次 期 繰 越 損 益 金(I)	184,374,116,405

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

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は99,597,188,643円、期中追加設定元本額は17,028,370,443円、期中一部解約元本額は31,895,501,560円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

世界経済インデックスファンド	16,653,669,783円
DC世界経済インデックスファンド	13,184,067,694円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,920,469,122円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,720,116,147円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,190,036,966円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,580,386,141円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,275,353,515円
DC外国債券インデックス・オープン	2,274,794,254円
DCマイセクション25	1,930,541,444円
DCマイセクション50	1,720,181,642円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,593,367,193円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,342,784,846円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,215,426,950円
DCマイセクション75	1,198,108,349円
DCマイセクションS25	1,041,266,467円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,010,365,780円
DCマイセクションS50	846,961,932円
グローバル経済コア	764,656,981円
外国債券ファンド・シリーズ1	737,331,804円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	682,623,920円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	671,048,013円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	662,469,971円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	633,693,735円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	616,906,384円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	534,842,030円
DCマイセクションS75	485,504,531円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	428,641,695円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	390,788,925円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	382,628,500円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	379,663,298円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	371,830,524円
SMT 世界経済インデックス・オープン	333,019,308円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	240,472,462円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	198,399,331円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	189,630,949円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	189,364,287円
SMT インデックスバランス・オープン	181,206,599円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	145,975,185円
私募世界経済バッシブファンド(適格機関投資家専用)	120,543,223円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,307,742円
DCターゲット・イヤー ファンド'2035	97,418,953円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	58,753,413円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	58,021,628円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	57,398,276円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	55,445,945円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	55,087,701円
DCターゲット・イヤー ファンド'2045	51,400,460円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	35,849,178円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	32,046,114円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	31,406,702円

10資産分散投資ファンド	26,201,569円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	25,326,235円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	25,129,663円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	21,448,912円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	19,989,360円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	18,996,343円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	17,216,405円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,222,078円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,870,014円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,120,412円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,033,203円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	992,969円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	債券物率	純資産額
	円	%	騰落率	騰落率					
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	53,734	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	61,667	
第13期(2021年11月10日)	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—	—	79,131	
第14期(2022年11月10日)	18,499	4.7	35,702.58	5.0	97.0	—	—	88,174	
第15期(2023年11月10日)	21,759	17.6	42,040.77	17.8	97.2	—	—	122,661	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	%	騰落率	騰落率		
(当期首) 2022年11月10日	18,499	—	35,702.58	—	97.0	—
11月末	18,309	△1.0	35,263.57	△1.2	96.0	—
12月末	17,853	△3.5	34,477.89	△3.4	95.8	—
2023年 1月末	18,392	△0.6	35,423.91	△0.8	96.3	—
2月末	18,620	0.7	35,809.02	0.3	96.5	—
3月末	18,927	2.3	36,370.52	1.9	96.1	—
4月末	19,217	3.9	36,860.17	3.2	96.1	—
5月末	19,770	6.9	38,041.49	6.6	95.6	—
6月末	21,059	13.8	40,502.34	13.4	95.0	—
7月末	21,129	14.2	40,572.98	13.6	95.9	—
8月末	21,424	15.8	41,220.47	15.5	96.0	—
9月末	20,933	13.2	40,162.18	12.5	96.4	—
10月末	20,961	13.3	40,317.53	12.9	96.1	—
(当期末) 2023年11月10日	21,759	17.6	42,040.77	17.8	97.2	—

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

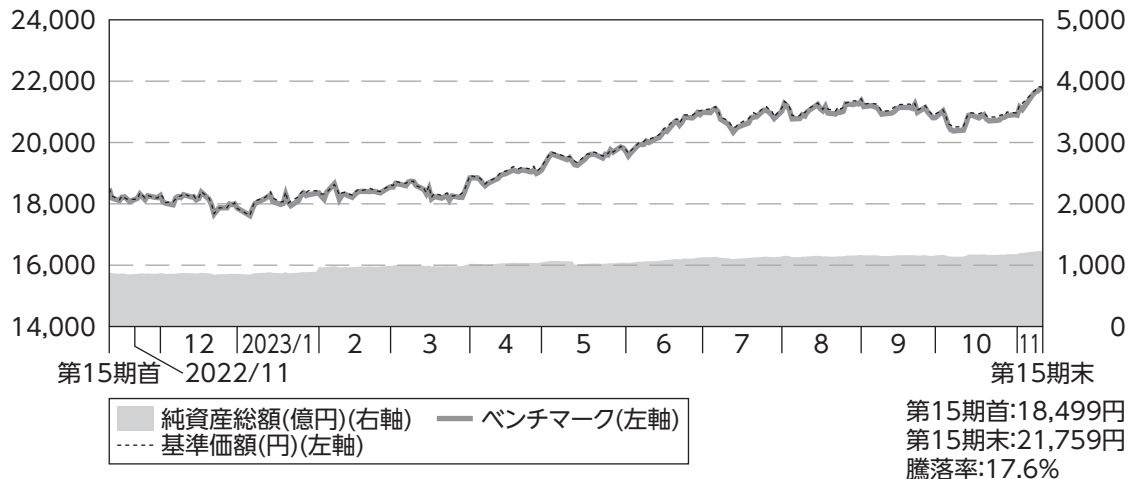
【JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド】とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。

【同指数】に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

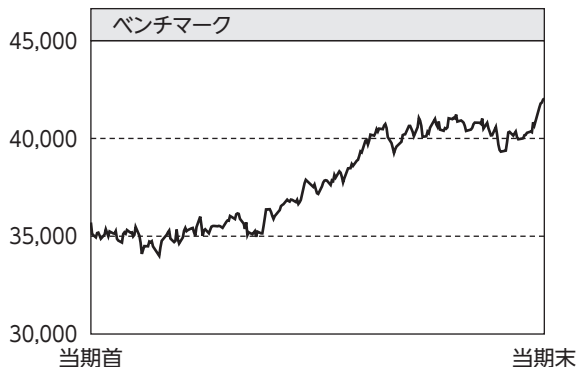


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



新興国為替市場では、2022年12月の日銀による長期金利の変動許容幅引き上げが事実上の金融引き締めと受け止められ、対新興国通貨で円買いが進行し、2023年の年明けにかけて新興国通貨は対円で上値の重い展開となりましたが、その後は日本との金利差が意識され、新興国通貨は対円で概ね上昇推移となりました。

新興国債券市場では、インフレ期待の低下を受けてFRB(米連邦準備理事会)による利上げペース減速の可能性が意識されたことや、2023年3月に米国地方銀行の経営破綻などに端を発した信用不安の広がりを受けて、リスク回避の機運が高まったことなどから、新興国金利は期初から低下基調(債券価格は上昇)が続きました。7月以降は、米国の堅調な経済指標やインフレ圧力が継続する中、FRBとECB(欧州中央銀行)高官らの発言を背景に利上げ長期化観測が高まったことなどをを受けて主要国の長期金利は上昇し、新興国金利も上昇しました。期末にかけては、欧米の軟調な経済指標などをを受けて主要国の長期金利が低下し、その影響を受けて新興国金利も低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

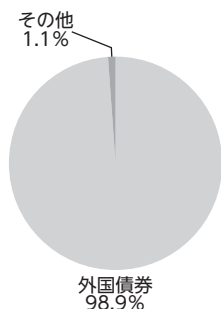
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	2.0%
2	BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	1.5%
3	BLTN 0% 07/01/26	ブラジル	1.5%
4	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.5%
5	BNTNF 10% 01/01/25	ブラジル	1.4%
6	BNTNF 10% 01/01/27	ブラジル	1.3%

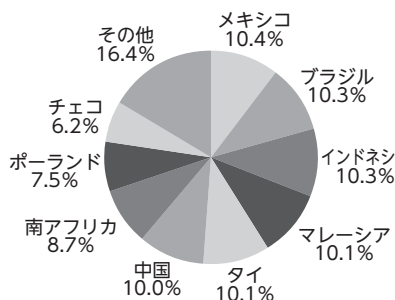
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	BNTNF 10% 01/01/29	ブラジル	1.2%
8	SAGB 8% 01/31/30	南アフリカ	1.2%
9	MBONO 7.75% 05/29/31	メキシコ	1.1%
10	MBONO 5.75% 03/05/26	メキシコ	1.1%
組入銘柄数		272	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

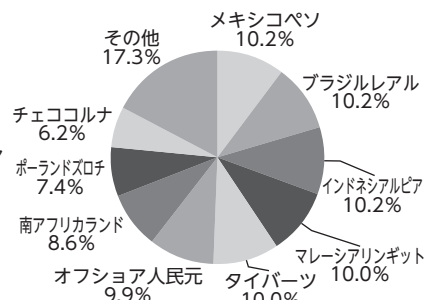
○資産別配分



○国別配分



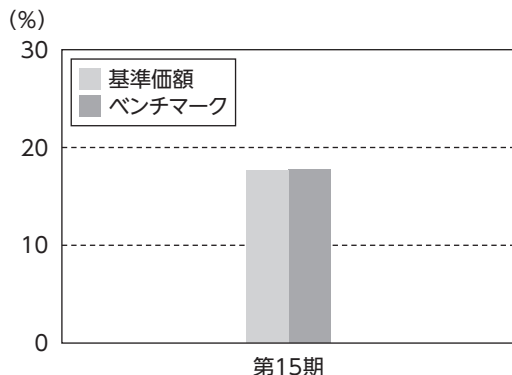
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

ベンチマークとの乖離の主なマイナス要因は、為替評価差要因*等です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月1日~2023年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	23 (23) (-) (0)	0.115 (0.115) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	23	0.115	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(19,716円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
外	メ キ シ コ 国 債 証 券	千メキシコペソ 429,052	千メキシコペソ 159,844
	ブ ラ ジ ル 国 債 証 券	千ブラジルリアル 282,145	千ブラジルリアル 223,245
	チ リ 国 債 証 券	千チリペソ 3,541,818	千チリペソ 1,416,158
	コ ロ ン ビ ア 国 債 証 券	千コロンビアペソ 40,140,465	千コロンビアペソ 21,479,142
	ペ ル ー 国 債 証 券	千ペルー・ソル 22,870	千ペルー・ソル 14,146
	ウ ル グ ア イ 国 債 証 券	千ウルグアイペソ 26,197	千ウルグアイペソ -
	ド ミ ニ カ 共 和 国 国 債 証 券	千ドミニカペソ 79,018	千ドミニカペソ 32,764 (8,160)
	チ ェ コ 国 債 証 券	千チェココルナ 418,582	千チェココルナ 148,306
	ハ ン ガ リ ー 国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 1,913,423	千ハンガリーフォリント 1,349,531
	ポ ー ラ ン ド 国 債 証 券	千ポーランドズロチ 67,537	千ポーランドズロチ 44,331
	ル ー マ ニ ア 国 債 証 券	千ルーマニア・レイ 64,735	千ルーマニア・レイ 35,039
	マ レ ー シ ア 国 債 証 券	千マレーシアリンギット 179,505	千マレーシアリンギット 86,846
	国	タ イ 国 債 証 券	千タイバーツ 1,087,866
イ ン ド ネ シ ア 国 債 証 券		千インドネシアルピア 481,368,380	千インドネシアルピア 157,268,490
中 国 オ フ シ ョ ア 国 債 証 券		千オフショア人民元 242,042	千オフショア人民元 93,832
南 ア フ リ カ 国 債 証 券		千南アフリカランド 360,747	千南アフリカランド 154,044

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 7	百万円 7	100.0	百万円 7	百万円 7	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	272,149	29,712	10.9	271,759	29,743	10.9

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	末		
		評 価 額				残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メ キ シ コ	千メキシコペソ 1,578,350	千メキシコペソ 1,432,475	千円 12,205,407	% 10.0	% —	% 5.2	% 2.9	% 1.8
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 455,600	千ブラジルレアル 400,529	12,270,350	10.0	10.0	2.2	4.6	3.2
チ リ	千チリペソ 14,480,000	千チリペソ 13,782,340	2,286,173	1.9	—	1.1	0.4	0.4
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 176,310,000	千コロンビアペソ 146,078,820	5,501,328	4.5	—	2.0	2.5	—
ペ ル ー	千ペルー・ソル 73,150	千ペルー・ソル 70,657	2,811,449	2.3	—	1.9	0.3	0.1
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 67,000	千ウルグアイペソ 64,160	243,635	0.2	—	0.1	0.1	—
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 64,000	千ドミニカペソ 68,233	181,816	0.1	0.1	0.1	—	—
チ ェ コ	千チェココルナ 1,242,100	千チェココルナ 1,130,230	7,437,141	6.1	—	3.8	1.4	0.8
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 10,716,500	千ハンガリーフォリント 9,029,623	3,847,224	3.1	—	1.1	1.4	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 272,600	千ポーランドズロチ 248,649	9,050,183	7.4	—	2.0	3.5	1.9
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 148,500	千ルーマニア・レイ 140,738	4,576,626	3.7	—	1.7	1.2	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 378,950	千マレーシアリンギット 379,643	12,160,927	9.9	—	5.4	2.7	1.8
タイ	千タイバーツ 2,908,800	千タイバーツ 2,859,710	12,096,574	9.9	—	5.6	2.6	1.7
フィリピン	千フィリピンペソ 30,000	千フィリピンペソ 28,451	77,112	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 1,237,800,000	千インドネシアルピア 1,263,592,572	12,256,847	10.0	—	7.1	2.4	0.5
中国オフショア	千オフショア人民元 567,100	千オフショア人民元 577,993	11,989,777	9.8	—	4.8	4.0	1.0
南アフリカ	千南アフリカランド 1,555,700	千南アフリカランド 1,261,921	10,246,806	8.4	8.4	6.9	1.4	—
合 計	—	—	119,239,383	97.2	18.5	51.2	31.5	14.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	当 期		末 期		償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(メキシコ)						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBOX0 10% 11/20/36	10.0	38,800	39,790	339,035	2036/11/20	
MBOX0 10% 12/05/24	10.0	86,250	85,291	726,729	2024/12/5	
MBOX0 5% 03/06/25	5.0	57,500	53,608	456,770	2025/3/6	
MBOX0 5.5% 03/04/27	5.5	109,000	95,579	814,388	2027/3/4	
MBOX0 5.75% 03/05/26	5.75	175,300	159,078	1,355,432	2026/3/5	
MBOX0 7% 09/03/26	7.0	33,000	30,489	259,787	2026/9/3	
MBOX0 7.5% 05/26/33	7.5	77,000	66,576	567,265	2033/5/26	
MBOX0 7.5% 06/03/27	7.5	139,000	128,969	1,098,886	2027/6/3	
MBOX0 7.75% 05/29/31	7.75	176,100	158,007	1,346,302	2031/5/29	
MBOX0 7.75% 11/13/42	7.75	123,500	102,433	872,783	2042/11/13	
MBOX0 7.75% 11/23/34	7.75	28,100	24,497	208,731	2034/11/23	
MBOX0 8% 07/31/53	8.0	72,500	60,499	515,482	2053/7/31	
MBOX0 8% 09/05/24	8.0	128,400	125,264	1,067,317	2024/9/5	
MBOX0 8% 11/07/47	8.0	96,000	80,761	688,131	2047/11/7	
MBOX0 8.5% 05/31/29	8.5	139,600	132,819	1,131,689	2029/5/31	
MBOX0 8.5% 11/18/38	8.5	98,300	88,806	756,673	2038/11/18	
小 計				12,205,407		
(ブラジル)						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/26	—	76,500	61,504	1,884,202	2026/1/1	
BLTN 0% 07/01/24	—	37,250	34,808	1,066,375	2024/7/1	
BLTN 0% 07/01/25	—	45,300	38,386	1,175,980	2025/7/1	
BLTN 0% 07/01/26	—	78,000	59,548	1,824,285	2026/7/1	
BLTN 0% 07/01/27	—	18,000	12,370	378,965	2027/7/1	
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	55,300	54,700	1,675,758	2025/1/1	
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	50,400	49,434	1,514,434	2027/1/1	
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	49,700	47,618	1,458,800	2029/1/1	
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	19,850	18,663	571,757	2031/1/1	
BNTNF 10% 01/01/33	10.0	23,900	22,117	677,580	2033/1/1	
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,377	42,208	2028/1/10	
小 計				12,270,350		
(チリ)						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
BTPCL 2.3% 10/01/28	2.3	625,000	527,205	87,451	2028/10/1	
BTPCL 2.5% 03/01/25	2.5	2,985,000	2,821,289	467,986	2025/3/1	
BTPCL 4.5% 03/01/26	4.5	1,960,000	1,882,814	312,315	2026/3/1	
BTPCL 4.7% 09/01/30	4.7	2,090,000	1,927,473	319,723	2030/9/1	
BTPCL 5% 03/01/35	5.0	2,210,000	2,018,783	334,869	2035/3/1	
BTPCL 5% 10/1/28	5.0	820,000	780,189	129,415	2028/10/1	
BTPCL 6% 01/01/43	6.0	1,800,000	1,806,572	299,668	2043/1/1	
BTPCL 6% 04/01/33	6.0	1,500,000	1,493,259	247,697	2033/4/1	
BTPCL 7% 05/01/34	7.0	490,000	524,752	87,044	2034/5/1	
小 計				2,286,173		
(コロンビア)						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COL0M 9.85% 06/28/27	9.85	65,300,000	62,229,787	2,343,573	2027/6/28	
COLTES 6.25% 11/26/25	6.25	20,800,000	19,396,620	730,476	2025/11/26	
COLTES 7.25% 10/18/34	7.25	45,100,000	34,520,518	1,300,042	2034/10/18	
COLTES 7.25% 10/26/50	7.25	45,110,000	29,931,893	1,127,235	2050/10/26	
小 計				5,501,328		
(ペルー)						
国債証券		千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	4,950	4,043	160,896	2040/8/12	
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	7,250	6,313	251,215	2034/8/12	
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	3,700	3,686	146,697	2024/8/12	

銘柄	利率 (%)	当 期		末 期		償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	8,800	8,620	343,023	2029/2/12	
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	8,300	7,848	312,282	2032/8/12	
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	6,650	6,674	265,587	2028/8/12	
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	11,050	10,710	426,170	2037/8/12	
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	10,500	10,542	419,463	2031/8/12	
PERUGB 7.3% 08/12/33	7.3	9,400	9,547	379,871	2033/8/12	
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	2,550	2,670	106,241	2026/8/12	
小 計				2,811,449		
(ウルグアイ)						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
URUGUA 8.25% 05/21/31	8.25	25,000	23,175	88,004	2031/5/21	
URUGUA 8.5% 03/15/28	8.5	17,000	16,221	61,599	2028/3/15	
URUGUA 9.75% 07/20/33	9.75	25,000	24,762	94,030	2033/7/20	
小 計				243,635		
(ドミニカ共和国)						
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
DOMREP 11.25% 09/15/35	11.25	32,000	31,776	84,670	2035/9/15	
DOMREP 13.625% 02/03/33	13.625	32,000	36,457	97,145	2033/2/3	
小 計				181,816		
(チェコ)						
国債証券		千チェココルナ	千チェココルナ			
CZGB 0% 12/12/24	—	24,000	22,772	149,844	2024/12/12	
CZGB 0.05% 11/29/29	0.05	26,100	20,204	132,947	2029/11/29	
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	55,200	48,420	318,618	2027/2/10	
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	98,900	79,874	525,590	2030/5/15	
CZGB 1% 06/26/26	1.0	68,800	62,883	413,784	2026/6/26	
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	98,000	78,494	516,509	2031/3/13	
CZGB 1.25% 02/14/25	1.25	58,500	55,724	366,676	2025/2/14	
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	34,700	22,542	148,331	2040/4/24	
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	51,500	41,735	274,630	2032/6/23	
CZGB 1.95% 07/30/37	1.95	29,000	21,500	141,478	2037/7/30	
CZGB 2% 10/13/33	2.0	74,500	59,944	394,444	2033/10/13	
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	75,700	72,576	477,566	2025/9/17	
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	98,700	90,908	598,194	2028/8/25	
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	80,500	73,969	486,732	2029/7/23	
CZGB 3.5% 05/30/35	3.5	22,000	20,039	131,865	2035/5/30	
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	34,500	33,363	219,541	2036/12/4	
CZGB 4.5% 11/11/32	4.5	25,000	25,075	164,998	2032/11/11	
CZGB 4.9% 04/14/34	4.9	47,500	49,072	322,907	2034/4/14	
CZGB 5% 09/30/30	5.0	80,000	82,814	544,932	2030/9/30	
CZGB 5.5% 12/12/28	5.5	69,000	72,881	479,571	2028/12/12	
CZGB 6% 02/26/26	6.0	63,000	65,293	429,642	2026/2/26	
CZGB 6.2% 06/16/31	6.2	27,000	30,140	198,331	2031/6/16	
小 計				7,437,141		
(ハンガリー)						
国債証券		千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
HGB 1% 11/26/25	1.0	835,000	735,175	313,234	2025/11/26	
HGB 1.5% 04/22/26	1.5	610,500	532,417	226,845	2026/4/22	
HGB 1.5% 08/26/26	1.5	514,000	438,416	186,794	2026/8/26	
HGB 2% 05/23/29	2.0	403,000	315,750	134,530	2029/5/23	
HGB 2.25% 04/20/33	2.25	712,000	490,710	209,075	2033/4/20	
HGB 2.25% 06/22/34	2.25	221,000	146,081	62,240	2034/6/22	
HGB 2.5% 10/24/24	2.5	578,000	547,129	233,113	2024/10/24	
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	485,500	422,978	180,217	2026/12/22	
HGB 3% 04/25/41	3.0	371,000	218,574	93,127	2041/4/25	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
HGB 3% 06/26/24	3.0	307,500	296,614	126,377	2024/6/26	
HGB 3% 08/21/30	3.0	715,000	570,455	243,052	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	822,000	707,025	301,240	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	530,000	330,155	140,668	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	812,000	636,806	271,322	2031/10/22	
HGB 4.5% 03/23/28	4.5	263,000	237,130	101,033	2028/3/23	
HGB 4.75% 11/24/32	4.75	640,000	540,124	230,129	2032/11/24	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	900,000	869,778	370,583	2025/6/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	767,000	754,352	321,404	2028/10/22	
HGB 9.5% 10/21/26	9.5	230,000	239,946	102,233	2026/10/21	
小計				3,847,224		
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
国債証券						
POLGB 0% 10/25/25	—	11,500	10,462	380,802	2025/10/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	18,500	16,031	583,498	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	14,300	13,417	488,367	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	19,800	15,241	554,763	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	22,700	17,030	619,857	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	18,950	18,438	671,116	2024/10/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	21,300	19,854	722,660	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	23,700	21,513	783,047	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	21,000	18,924	688,797	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	26,100	22,804	830,010	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	23,050	22,299	811,624	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	21,100	20,071	730,535	2027/5/25	
POLGB 6% 10/25/33	6.0	12,200	12,592	458,327	2033/10/25	
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	18,400	19,967	726,772	2028/7/25	
小計				9,050,183		
(ルーマニア)		千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ			
国債証券						
ROMGB 2.5% 10/25/27	2.5	7,500	6,496	211,253	2027/10/25	
ROMGB 3.25% 06/24/26	3.25	6,500	6,070	197,407	2026/6/24	
ROMGB 3.5% 11/25/25	3.5	5,800	5,534	179,973	2025/11/25	
ROMGB 3.65% 07/28/25	3.65	10,400	10,039	326,487	2025/7/28	
ROMGB 3.65% 09/24/31	3.65	8,800	7,186	233,704	2031/9/24	
ROMGB 3.7% 11/25/24	3.7	10,000	9,790	318,385	2024/11/25	
ROMGB 4.15% 01/26/28	4.15	9,000	8,253	268,393	2028/1/26	
ROMGB 4.15% 10/24/30	4.15	7,400	6,400	208,137	2030/10/24	
ROMGB 4.25% 04/28/36	4.25	6,600	5,162	167,868	2036/4/28	
ROMGB 4.5% 06/17/24	4.5	2,200	2,179	70,881	2024/6/17	
ROMGB 4.75% 02/24/25	4.75	8,600	8,460	275,120	2025/2/24	
ROMGB 4.75% 10/11/34	4.75	7,200	6,043	196,525	2034/10/11	
ROMGB 4.85% 04/22/26	4.85	4,700	4,540	148,304	2026/4/22	
ROMGB 4.85% 07/25/29	4.85	7,800	7,157	232,765	2029/7/25	
ROMGB 5% 02/12/29	5.0	6,000	5,568	181,086	2029/2/12	
ROMGB 5.8% 07/26/27	5.8	6,500	6,358	206,757	2027/7/26	
ROMGB 6.7% 02/25/32	6.7	6,800	6,785	220,667	2032/2/25	
ROMGB 7.35% 04/28/31	7.35	4,800	4,955	161,136	2031/4/28	
ROMGB 7.9% 02/24/38	7.9	5,400	5,855	190,425	2038/2/24	
ROMGB 8% 04/29/30	8.0	3,500	3,716	120,848	2030/4/29	
ROMGB 8.25% 09/29/32	8.25	5,500	6,019	195,732	2032/9/29	
ROMGB 8.75% 10/30/28	8.75	7,500	8,141	264,762	2028/10/30	
小計				4,576,626		
(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券						
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	16,200	14,862	476,093	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	8,650	8,668	277,678	2024/6/14	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	17,650	17,564	562,624	2027/5/31	
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	21,500	20,923	670,233	2032/7/15	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	36,400	36,260	1,161,513	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	27,350	25,756	825,059	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	8,200	8,047	257,793	2034/7/5	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	15,200	15,308	490,358	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	41,300	41,395	1,325,997	2029/8/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	15,500	15,623	500,456	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	10,450	10,534	337,446	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	24,600	24,855	796,182	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	28,700	28,967	927,889	2025/9/15	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	5,450	5,479	175,537	2024/9/30	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	18,250	17,394	557,179	2050/6/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	9,100	9,147	293,004	2024/7/15	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	13,650	13,987	448,061	2035/5/31	
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	4,800	4,868	155,951	2053/3/31	
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	7,000	7,215	231,142	2029/4/30	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	8,800	9,324	298,681	2042/10/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	16,300	17,459	559,261	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	16,100	17,556	562,386	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	7,800	8,441	270,394	2048/7/6	
小計				12,160,927		
(タイ)		千タイバーツ	千タイバーツ			
国債証券						
THAIGB 0.75% 06/17/24	0.75	102,500	101,520	429,431	2024/6/17	
THAIGB 0.75% 09/17/24	0.75	84,000	82,849	350,455	2024/9/17	
THAIGB 0.95% 06/17/25	0.95	142,200	138,812	587,178	2025/6/17	
THAIGB 1% 06/17/27	1.0	163,000	153,783	650,502	2027/6/17	
THAIGB 1.45% 12/17/24	1.45	164,000	162,361	686,787	2024/12/17	
THAIGB 1.585% 12/17/35	1.585	59,800	49,924	211,178	2035/12/17	
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	65,100	55,378	234,251	2035/6/17	
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	104,100	96,920	409,974	2029/12/17	
THAIGB 2% 06/17/42	2.0	78,600	62,026	262,370	2042/6/17	
THAIGB 2% 12/17/31	2.0	113,000	104,874	443,620	2031/12/17	
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	203,100	200,419	847,773	2026/12/17	
THAIGB 2.35% 06/17/26	2.35	142,000	141,257	597,520	2026/6/17	
THAIGB 2.65% 06/17/28	2.65	140,000	139,621	590,597	2028/6/17	
THAIGB 2.875% 06/17/46	2.875	102,100	88,589	374,735	2046/6/17	
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	101,000	101,542	429,526	2028/12/17	
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	148,700	146,567	619,979	2038/6/17	
THAIGB 3.35% 06/17/33	3.35	122,000	125,229	529,720	2033/6/17	
THAIGB 3.39% 06/17/37	3.39	76,000	76,483	323,523	2037/6/17	
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	157,200	157,126	664,645	2036/6/17	
THAIGB 3.45% 06/17/43	3.45	69,000	68,433	289,473	2043/6/17	
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	116,500	121,113	512,310	2031/6/20	
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	180,000	189,146	800,088	2032/6/25	
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	105,400	108,301	458,116	2025/12/12	
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	169,500	187,426	792,813	2029/6/22	
小計				12,096,574		
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ			
国債証券						
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	28,451	77,112	2036/1/14	
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
国債証券						
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	8,606,282	83,480	2030/8/15	
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	7,500,000	8,042,005	78,007	2025/9/15	
INDOGB 5.125% 04/15/27	5.125	63,000,000	60,194,580	583,887	2027/4/15	
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	109,000,000	106,165,459	1,029,804	2026/4/15	

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	16,000,000	15,618,232	151,496	2028/5/15
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	17,800,000	16,917,971	164,104	2036/6/15
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	62,000,000	60,240,058	584,328	2032/4/15
INDOGB 6.375% 07/15/37	6.375	16,100,000	15,346,473	148,860	2037/7/15
INDOGB 6.375% 08/15/28	6.375	43,500,000	43,013,235	417,228	2028/8/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	75,500,000	73,499,470	712,944	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	53,000,000	52,872,433	512,862	2025/6/15
INDOGB 6.625% 02/15/34	6.625	15,000,000	14,723,182	142,814	2034/2/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	20,000,000	19,682,683	190,922	2033/5/15
INDOGB 7% 02/15/33	7.0	83,000,000	84,574,510	820,372	2033/2/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	38,600,000	38,897,335	377,304	2027/5/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	71,000,000	71,493,634	693,488	2030/9/15
INDOGB 7.125% 06/15/38	7.125	16,000,000	16,357,600	158,668	2038/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	43,800,000	43,988,834	426,691	2042/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/43	7.125	18,500,000	18,711,270	181,499	2043/6/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	51,000,000	53,101,791	515,087	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	34,700,000	36,146,361	350,619	2038/5/15
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	68,700,000	71,666,685	695,166	2035/6/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	18,400,000	19,124,117	185,503	2032/8/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	54,200,000	57,640,155	559,109	2029/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	33,700,000	37,062,006	359,501	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	13,400,000	14,593,996	141,561	2032/6/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	44,000,000	48,858,660	473,929	2034/3/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	24,200,000	27,138,649	263,244	2039/4/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	40,100,000	41,813,569	405,591	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	38,700,000	42,942,812	416,545	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	28,700,000	31,379,759	304,383	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,178,754	127,833	2031/7/15
小計			12,256,847		
(中国オフショア) 国債証券		千円ジョア人民元	千円ジョア人民元		
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	13,600	13,523	280,523	2025/4/9
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	10,200	10,167	210,907	2025/8/25
CGB 2.26% 02/24/25	2.26	3,000	2,996	62,157	2025/2/24
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	14,000	13,993	290,285	2026/5/15
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	10,000	9,946	206,338	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	21,000	20,957	434,745	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	16,000	16,020	332,323	2026/2/15
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	5,400	5,403	112,080	2027/4/15
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	6,000	6,003	124,527	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	4,200	4,157	86,243	2033/8/25
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	16,900	16,803	348,575	2032/9/1
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	17,800	17,888	371,085	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	5,500	5,486	113,806	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	5,000	4,997	103,663	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	10,000	10,064	208,780	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	8,000	7,999	165,942	2033/5/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	27,300	27,361	567,588	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	10,000	10,082	209,141	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	10,000	10,022	207,906	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	7,700	7,748	160,725	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	10,900	10,985	227,875	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	4,500	4,532	94,017	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	12,000	12,113	251,273	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	12,000	12,134	251,717	2029/3/24
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	9,000	9,088	188,523	2030/3/25
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	9,900	10,022	207,896	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	18,400	18,650	386,890	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	17,200	17,558	364,236	2033/2/25

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	8,000	8,139	168,846	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	10,000	10,174	211,049	2028/10/14
CGB 2.94% 10/17/24	2.94	23,000	23,160	480,429	2024/10/17
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	9,800	10,023	207,924	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	8,500	8,748	181,477	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	7,300	7,406	153,633	2025/10/22
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	19,500	19,826	411,282	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	4,600	4,698	97,457	2052/10/25
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	15,000	15,344	318,295	2026/12/5
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	8,300	8,572	177,820	2029/11/21
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	21,600	22,039	457,173	2025/12/6
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	22,000	22,578	468,356	2026/6/6
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	10,300	10,682	221,593	2028/11/22
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	22,000	23,063	478,424	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	9,700	10,038	208,243	2027/12/3
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	14,200	14,790	306,810	2029/5/23
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	4,000	4,198	87,089	2052/4/15
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	8,800	9,555	198,219	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	8,500	9,519	197,471	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	16,500	18,723	388,397	2050/9/14
小計				11,989,777	
(南アフリカ) 国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	207,400	215,810	1,752,377	2026/12/21
SAGB 11.625% 03/31/53	11.625	16,500	15,476	125,665	2053/3/31
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	72,200	45,886	372,600	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	92,100	54,458	442,204	2041/2/28
SAGB 7% 02/28/31	7.0	102,700	82,919	673,310	2031/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	190,600	170,587	1,385,166	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	165,500	139,202	1,130,320	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	145,700	110,557	897,724	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	112,000	81,704	663,436	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	181,700	131,714	1,069,520	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	151,000	123,065	999,287	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	118,300	90,540	735,192	2040/1/31
小計				10,246,806	
合計				119,239,383	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	119,239,383	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,516,095	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	122,755,478	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(122,124,162千円)の投資信託財産総額(122,755,478千円)に対する比率は99.5%です。

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

1米ドル=151.43円	1メキシコペソ=8.5205円	1ブラジルレアル=30.6353円
1チリペソ=0.165877円	1コロンビアペソ=0.03766円	1ペルー・ソル=39.7896円
1ウルグアイペソ=3.7973円	1ドミニカペソ=2.6646円	1ユーロ=161.56円
1チェココナ=6.5802円	1ハンガリーフォリント=0.426067円	1ポーランドズロチ=36.3973円
1ルーマニア・レイ=32.5187円	1マレーシアリンギット=32.0325円	1タイバーツ=4.23円
1フィリピンペソ=2.7103円	1インドネシアルピア=0.0097円	1オフショア人民元=20.7438円
1南アフリカランド=8.12円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年11月10日現在
(A) 資 産	122,755,478,007円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,487,100,463
公 社 債 (評価額)	119,239,383,782
未 収 利 息	1,816,897,809
前 払 費 用	212,095,953
(B) 負 債	93,492,950
未 払 解 約 金	93,492,542
未 払 利 息	387
そ の 他 未 払 費 用	21
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	122,661,985,057
元 本	56,372,858,492
次 期 繰 越 損 益 金	66,289,126,565
(D) 受 益 権 総 口 数	56,372,858,492口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,759円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	6,372,486,767円
受 取 利 息	6,373,280,400
そ の 他 収 益 金	71,916
支 払 利 息	△865,549
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,401,195,780
売 買 益	12,772,304,545
売 買 損	△1,371,108,765
(C) そ の 他 費 用	△122,715,929
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	17,650,966,618
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	40,511,111,167
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,564,139,349
(G) 解 約 差 損 益 金	△4,437,090,569
(H) 計 (D+E+F+G)	66,289,126,565
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	66,289,126,565

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は47,663,305,590円、期中追加設定元本額は13,446,721,298円、期中一部解約元本額は4,737,168,396円です。
 ※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

世界経済インデックスファンド	19,468,805,143円
DC世界経済インデックスファンド	14,244,781,680円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,804,582,742円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,552,956,831円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,540,957,166円
分散投資コア戦略ファンドS	1,042,725,547円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	995,680,503円
グローバル経済コア	820,321,639円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	715,157,460円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	623,928,987円
SMT 世界経済インデックス・オープン	472,204,344円
分散投資コア戦略ファンドA	395,863,625円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	242,877,543円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	242,168,757円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	230,204,334円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	226,968,022円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	225,814,900円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	224,099,208円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	221,877,764円
SMT インデックスバランス・オープン	182,976,326円
私募世界経済バシップファンド(適格機関投資家専用)	162,669,884円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	152,161,830円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	145,958,376円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	108,856,092円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	92,855,237円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	78,807,700円
10資産分散投資ファンド	42,777,463円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	34,554,195円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	32,364,228円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	22,306,619円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,029,257円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,853,220円
グローバル10資産バランスファンド	2,711,870円

お知らせ

該当事項はありません。