

決算報告書

(決算日 2021年11月30日)

確定拠出年金向け 年金投資基金信託

外国債券インデックスファンド

1. 最近5期の運用実績
2. 当期の基準価格の推移
3. 当期末の資産構成割合
4. 当期の市場環境とマザーファンドの運用状況
5. 外国債券インデックスファンドの運用総括と今後の運用方針
6. 信託財産の構成、貸借対照表、損益計算書
7. 1万口当たりの費用の明細
8. マザーファンドの信託受益権の設定、解約状況
9. マザーファンドの主要売買銘柄
10. 利害関係人との取引状況等
11. マザーファンド組入有価証券明細表

【 外国債券マザーファンド 運用状況のご報告 】

みずほ信託銀行株式会社
金(広)04-8609-08610

[商号及び登録番号] みずほ信託銀行株式会社（登録番号：関東財務局長(登金)第34号）

[手数料等]

1. 信託報酬 日々の純資産総額に対して、0.275%（税込み、年率）を乗じた額。
2. 信託財産留保金 留保金率は現在0%としております。
3. マザーファンドの信託財産留保金
当ファンドがマザーファンド受益権を売買する際に、0.02%の料率によりファンドから支払われます。
4. マザーファンドから、証券会社等に有価証券の売買委託手数料や外貨建資産の保管手数料等が支払われることがあります。

[元本毀損リスク]

当商品は、マザーファンドを通じて、FTSE世界国債インデックス（除く日本・ノーヘッジ・円ベース）に連動する収益を目指して公社債など値動きのある証券や為替変動のある外貨建証券に投資したり、預金や貸付等を行ったりしますので、同指標や価格の下落、円高方向への為替変動、あるいは証券の発行体や預金先等の信用不安、または投資対象国・地域の政治・経済情勢の変化等により、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

◎本資料内の実績・データ等は過去のものであり、将来の運用成果を予測もしくは約束・保証するものではありません。本資料は信頼できると考えられる情報に基づいて当社が作成しておりますが、情報の正確性、完全性が保証されているものではありません。なお、本資料内の記述内容、数値等については資料作成時点のものであり、今後の金融情勢・社会情勢等の変化により内容が変更される場合があります。契約締結にあたっては、契約締結前交付書面等の内容をご確認ください。

1. 最近5期の運用実績

決算日	基準価格	税込み 分配金	期中騰落率	ベンチマーク 騰落率	債券組入 比率	債券先物 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	%	%	%	百万円
第12期 (2017年11月30日)	14,408	0	6.1	6.5	99.7	0.0	919
第13期 (2018年11月30日)	14,122	0	△ 2.0	△ 1.7	99.5	0.0	950
第14期 (2019年12月2日)	14,698	0	4.1	4.5	99.8	0.0	1,055
第15期 (2020年11月30日)	15,340	0	4.4	4.7	99.8	0.0	1,152
第16期 (2021年11月30日)	15,900	0	3.7	4.0	99.7	0.0	1,299

<注1> 基準価格は1万口当たりの金額を表示しております。

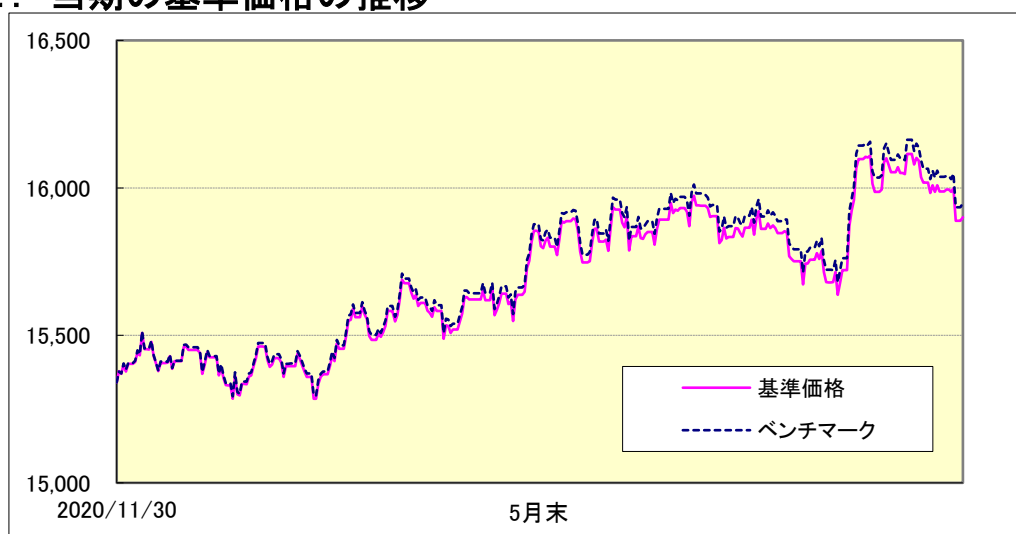
<注2> 当ファンドはマザーファンドに投資しますので「債券組入比率」「債券先物組入比率」は実質比率を記載しております。

<注3> 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

<注4> ベンチマーク騰落率は、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス-日本を除く-(円ベース)の騰落率です。

<注5> 当商品はマザーファンドの前営業日の基準価格にて時価評価するため、ベンチマーク騰落率の算出においても前営業日のベンチマークを使用しております。

2. 当期の基準価格の推移



(注) 期首のベンチマークの価値を、ファンドの期首基準価格15,340と同値として作図。

日付	基準価格	騰落率	ベンチマーク 騰落率	債券 組入比率	債券先物 組入比率
	円	%	%	%	%
(期首)					
2020年11月30日	15,340	---	---	99.8	0.0
12月末	15,451	0.7	0.8	99.7	0.0
2021年1月末	15,462	0.8	0.9	99.9	0.0
2月末	15,368	0.2	0.2	99.9	0.0
3月末	15,569	1.5	1.6	99.6	0.0
4月末	15,630	1.9	2.0	99.7	0.0
5月末	15,853	3.3	3.5	99.7	0.0
6月末	15,787	2.9	3.1	99.6	0.0
7月末	15,931	3.9	4.1	99.8	0.0
8月末	15,892	3.6	3.9	99.7	0.0
9月末	15,787	2.9	3.2	99.8	0.0
10月末	16,053	4.6	4.9	99.8	0.0
(期末)					
2021年11月30日	15,900	3.7	4.0	99.7	0.0

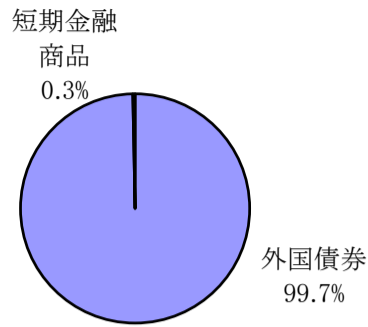
<注1> 騰落率は期首(前期末)比(累積率)です。

<注2> 当ファンドはマザーファンドに投資しますので、「債券組入比率」「債券先物組入比率」は実質比率を記載しております。

<注3> 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

<注4> ベンチマーク騰落率の定義は「1. 最近5期の運用実績」の注4、注5をご参照下さい。

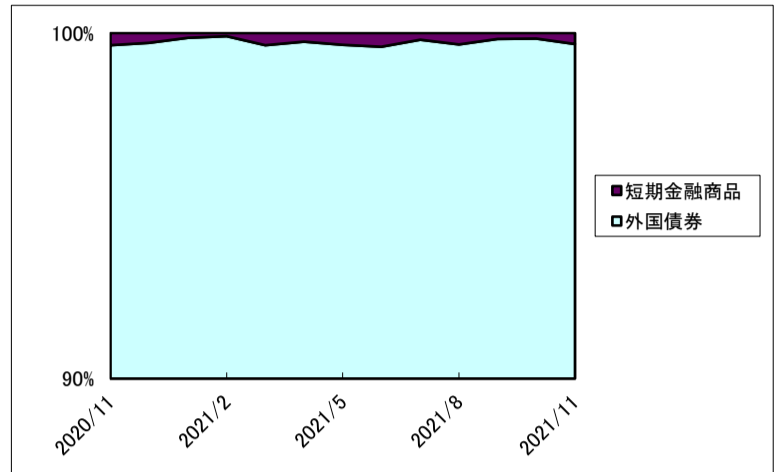
3. 当期末の資産構成割合



実質組入比率	
外国債券	99.7%
短期金融商品	0.3%

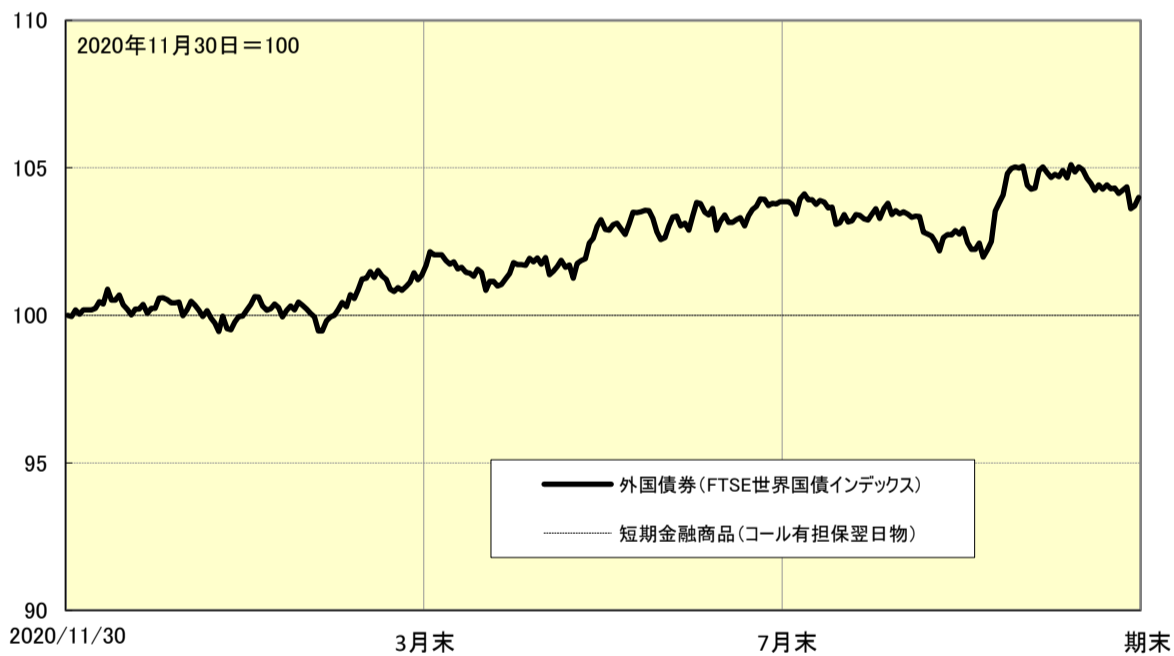
<注>組入比率は純資産総額対比です。

資産構成割合の期中推移グラフ



4. 当期の市場環境とマザーファンドの運用状況

(1) 市場指標概況



市場指数	2020年		2021年											
	11月30日	12月末値	1月末値	2月末値	3月末値	4月末値	5月末値	6月末値	7月末値	8月末値	9月末値	10月末値	11月30日	
マザーファンドのベンチマーク指数値														
外国債券	FTSE世界国債インデックス	494.4	496.5	497.5	494.4	502.8	502.9	508.8	511.1	513.4	510.6	506.6	517.5	514.2
市況ご参考														
外国債券	米10年債 (%)	0.84	0.93	1.11	1.44	1.74	1.65	1.58	1.45	1.24	1.30	1.52	1.55	1.43
為替レート	¥/\$ (ロンドン16時)	104.3	103.2	104.7	106.5	110.5	109.3	109.4	111.0	109.8	109.9	111.6	114.0	113.5
	¥/ユーロ (ロンドン16時)	124.7	126.3	127.2	129.3	129.9	131.6	133.8	131.6	130.1	129.7	129.3	132.0	127.8
国内短期金利	コール有担保翌日物 (%)	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

(2) 当期の市場環境とマザーファンドの運用状況

(単位:%)

資産	騰落率
マザーファンド騰落率	3.9
ベンチマーク騰落率	4.0
騰落率差	△ 0.0

(2020年11月28日～2021年11月29日)

A. 市場環境

■外国債券

外国債券利回りは、経済正常化への期待を受けたインフレ加速や早期緩和縮小への思惑、ワクチン接種の進展などから上昇しました。FRBによる金融緩和姿勢の維持などを背景に低下しましたが、コモディティ高などによる期待インフレ率の上昇、テーパリングの開始時期を巡る思惑などから再び上昇しました。通期で価格は円ベースで4%弱の上昇となりました。

■為替

ドル/円レートは、期初104円台半ばで始まり、期待インフレの上昇に伴う米実質金利の低下などを受けて円高ドル安が進みましたが、米国における経済対策法案成立、ワクチン接種進展、FOMCにおける利上げ見通し前倒し、テーパリング開始時期を巡る思惑などを受けた米国金利の上昇などを背景に概ね円安ドル高基調で推移し、期末には113円台半ばとなりました。

ユーロ/円レートは、期初の124円近辺で始まり、商品市況高に伴うユーロ買いなどからユーロ高円安が進みました。その後FOMCにおける利上げ見通し前倒し、原油などコモディティ安に伴うユーロ売りなどからユーロが下落、期末には127円台後半となりました。

B. マザーファンドの運用状況

外国債券マザーファンドは、基準価格の騰落がベンチマークであるFTSE世界国債インデックスの騰落に連動することを目指すインデックスファンドです。通貨構成等をベンチマークに合わせ最適化法を用いて銘柄を選択することによって、外国債券マザーファンドの基準価格は概ねベンチマークに連動いたしました。

5. 外国債券インデックスファンドの運用総括と今後の運用方針

(1) 基準価格

期を通して純資産総額のほぼ100%を外国債券マザーファンドに投資し、ほぼベンチマークに連動するパフォーマンスを達成いたしました。

(2) 収益分配金

内部留保を優先し、当期は収益分配を実施いたしませんでした。

(3) 今後の運用方針

原則フルインベストに努め、ベンチマークへの連動を目指します。

6. 信託財産の構成、貸借対照表、損益計算書

A. 信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項目	保有数量(口)	評価額(円)	比率(%)
外国債券マザーファンド	51,244	1,297,600,568	99.4
銀行勘定貸、その他	---	7,479,088	0.6
信託財産総額	---	1,305,079,656	100.0
純資産総額	---	1,298,925,195	---

<注1> 比率は信託財産総額に対する割合です。□

<注2> 外貨建資産は期末前営業日の時価をロンドン16:00のスポットレートにて邦貨換算したものです。

なお、期末前営業日における邦貨換算レートは次のとおりです。

1米ドル=113.64円、1英ポンド=151.09円、1カナダドル=88.83円、1オーストラリアドル=80.86円、1デンマーククローネ=17.22円、1スウェーデンクローナ=12.51円、1マレーシアリング=26.81円、1ノルウェークローネ=12.56円、1シンガポールドル=82.92円、1メキシコペソ=5.22円、1ポーランドズロティ=27.32円、1ユーロ=128.05円、1中国人民元=17.78円、1イスラエルシェケル=35.88円

<注3> 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(250,743,534千円)の純資産総額(250,957,289千円)に対する比率は99.9%です。

<注4> 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外国為替の予約に係る未決済残高はありません。

<注5> 期末における外国債券マザーファンドの全受益権口数は、10,380千口です。

項目	第16期(2020年11月30日)	第17期(2021年11月30日)
(A) 資産	1,168,410,529 円	1,305,079,656 円
外国債券マザーファンド(評価額)	1,151,203,416	1,297,600,568
銀行勘定貸	17,207,113	7,479,088
未収金	0	0
(B) 負債	16,034,399 円	6,154,461 円
未払金	16,034,399	6,154,461
(C) 純資産総額(A-B)	1,152,376,130 円	1,298,925,195 円
元本	751,232,825	816,928,215
分配準備積立金	401,143,305	481,996,980
信託損失	0	0
(D) 受益権総口数	751,232,825 口	816,928,215 口
1万口あたり基準価格(C/D×10,000)	15,340 円	15,900 円

C. 損益の状況

項目	第16期 (2019年12月3日～2020年11月30日)	第17期 (2020年12月1日～2021年11月30日)
(A) 利配当等収益	0 円	0 円
銀行勘定貸利息	0	0
(B) 売買損益等	49,267,895 円	46,161,241 円
売買損益	14,943,076	18,519,558
評価損益	34,324,819	27,641,683
(C) 信託報酬	△ 3,018,686 円	△ 3,390,702 円
(D) その他費用	0 円	△ 172 円
(E) 雑益	0 円	0 円
(F) 当期利益(A+B+C+D+E)	46,249,209 円	42,770,367 円
(G) 信託財産留保金	0 円	0 円
(H) 収益調整金	17,774,060 円	38,083,308 円
(I) 前期繰越損益	337,120,036 円	401,143,305 円
分配準備積立金	337,120,036	401,143,305
信託損失	0	0
(J) 当期末処分利益(F+G+H+I)	401,143,305 円	481,996,980 円
<利益処分>		
(K) 収益分配金	0 円	0 円
(L) 次期繰越損益(J-K)	401,143,305 円	481,996,980 円
分配準備積立金	401,143,305	481,996,980
信託損失	0	0

<注1> 損益の状況の中で(C)信託報酬には信託報酬に対する消費税相当額を含めて表示しています。

<注2> 損益の状況の中で(H)収益調整金とあるのは、信託の追加または解約の設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

<注3> 当ファンドの期中追加設定元本額は 206,645,078円、期中一部解約元本額は 140,949,688円です。

7. 1万口当たりの費用の明細

(2020年12月1日～2021年11月30日)

項目	金額
(a) 信託報酬	43 円
(b) 売買委託手数料	0 円
(株式)	(0 円)
(先物・オプション)	(0 円)
(c) 有価証券取引税	0 円
(株式)	(0 円)
(d) 保管費用等	3 円
合計	46 円

<注1>

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

(a)信託報酬=期中の平均基準価格×信託報酬率

(b)売買委託手数料、(c)有価証券取引税、(d)保管費用等は期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除して10,000を乗じたものです。

<注2>

各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

8. マザーファンドの信託受益権の設定、解約状況

(2020年12月1日～2021年11月30日)

マザーファンド	設定		解約	
	口数	金額(円)	口数	金額(円)
外国債券マザーファンド	8,304	207,878,413	4,316	107,642,502

9. マザーファンドの主要売買銘柄

(2020年11月28日～2021年11月29日)

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US.T.NOTE 0.875% 30/11/15	1,332,379	US.T.NOTE 1.875% 22/05/31	798,879
US.T.NOTE 1.250% 31/08/15	1,285,285	FRANCE 3.000% 22/04/25	782,136
US.T.NOTE 1.625% 31/05/15	1,253,401	US.T.NOTE 1.625% 22/08/31	780,961
US.T.NOTE 1.125% 31/02/15	1,206,987	US.T.NOTE 1.750% 22/06/30	776,988
US.T.BOND 6.125% 27/11/15	1,025,315	US.T.NOTE 1.750% 22/09/30	764,475
US.T.NOTE 0.500% 27/05/31	1,007,533	FRANCE 2.250% 22/10/25	699,701
US.T.BOND 1.875% 41/02/15	851,246	US.T.NOTE 1.875% 26/07/31	669,250
US.T.NOTE 0.625% 30/08/15	845,782	US.T.NOTE 1.875% 22/07/31	662,503
US.T.NOTE 0.250% 24/03/15	822,133	US.T.NOTE 1.750% 22/05/31	656,302
US.T.NOTE 0.125% 24/02/15	799,103	US.T.NOTE 1.375% 22/10/15	634,922

<注>金額順。金額は受渡金額(経過利息を除く)で、単位未満は切捨としています。

10. 利害関係人との取引状況等

(2020年12月1日～2021年11月30日)

(1) 利害関係人との取引状況

当ファンド、マザーファンド共に当期中に利害関係人との有価証券の取引はありません。

<注1> 債券等有価証券の売買取引以外に、日本カストディ銀行へ銀行勘定貸を行っており、この平均残高は当ファンド:4百万円、外国債券マザーファンド:249百万円です。

<注2> 当ファンドによる外国債券マザーファンドの平均保有割合(マザーファンドの残存口数に対する当該ベビーファンドのマザーファンド保有口数の割合)は、0.47%です。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

当ファンド、マザーファンド共に当該有価証券の組入れはありません。

(3) 利害関係人である証券会社が主幹事となって発行される有価証券

当ファンド、マザーファンド共に当該有価証券の取得はありません。

(4) 利害関係人である証券会社、金融機関が私募の取扱い代表者となって発行される有価証券

当ファンド、マザーファンド共に当該有価証券の取得はありません。

(5) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当ファンド、マザーファンド共に利害関係人への売買手数料の支払はありません。

*なお、当ファンドに係る当期中の利害関係人は、日本カストディ銀行(旧:資産管理サービス信託銀行)です。

11. マザーファンド組入有価証券明細表(2021年11月29日)

■外国（外貨建公社債）

A. 種類別

区分	額面金額	外貨建金額	邦貨換算額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
						5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 1,044,650	千米ドル 1,084,014	千円 123,181,903	46.9	-	21.2	17.3	8.4
イギリス	千英ポンド 83,490	千英ポンド 106,223	千円 16,049,131	6.1	-	4.8	1.0	0.3
カナダ	千カナダドル 55,580	千カナダドル 57,942	千円 5,146,941	2.0	-	0.9	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリアドル 53,240	千オーストラリアドル 55,768	千円 4,509,539	1.7	-	1.2	0.4	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 63,200	千デンマーククローネ 76,824	千円 1,322,746	0.5	-	0.3	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 55,290	千スウェーデンクローナ 60,718	千円 759,706	0.3	-	0.1	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギ 44,660	千マレーシアリンギ 46,061	千円 1,234,903	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 49,000	千ノルウェークローネ 49,598	千円 623,002	0.2	-	0.1	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 12,870	千シンガポールドル 13,653	千円 1,132,043	0.4	-	0.3	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 324,780	千メキシコペソ 328,438	千円 1,715,898	0.7	-	0.4	0.3	0.0
ポーランド	千ポーランドズロティ 47,460	千ポーランドズロティ 46,310	千円 1,265,028	0.5	-	0.2	0.2	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,240	千イスラエルシェケル 35,163	千円 1,261,468	0.5	-	0.2	0.2	0.1
中国	千人民元 30,100	千人民元 30,062	千円 534,462	0.2	-	0.1	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
小計	683,890	797,727	102,148,595	38.9	-	24.7	10.3	3.9
ベルギー	38,010	45,983	5,888,061	2.2	-	1.7	0.4	0.1
フランス	173,130	202,702	25,955,947	9.9	-	6.4	2.7	0.8
ドイツ	127,250	148,703	19,041,335	7.2	-	4.5	1.9	0.8
イタリア	160,600	184,500	23,625,150	9.0	-	5.6	2.4	1.0
オランダ	32,090	38,604	4,943,249	1.9	-	1.3	0.5	0.2
オーストリア	24,810	29,195	3,738,347	1.4	-	0.9	0.3	0.2
アイルランド	14,260	15,936	2,040,591	0.8	-	0.5	0.2	0.0
スペイン	102,590	119,970	15,362,093	5.8	-	3.6	1.7	0.6
フィンランド	11,150	12,135	1,553,823	0.6	-	0.4	0.2	0.1
合計	---	---	千円 260,885,366	99.3	---	54.9	30.7	13.7

B. 銘柄別

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
<米ドル…米国>	%		米ドル	米ドル	円
T 0.125 230515	0.13	20230515	3,600,000	3,588,328	407,759,665
T 0.125 230531	0.13	20230531	1,000,000	996,484	113,235,502
T 0.125 230630	0.13	20230630	820,000	816,893	92,827,632
T 0.125 230715	0.13	20230715	4,100,000	4,082,543	463,919,770
T 0.125 230731	0.13	20230731	1,000,000	995,352	113,106,774
T 0.125 230815	0.13	20230815	6,600,000	6,567,258	746,270,341
T 0.125 230915	0.13	20230915	4,500,000	4,475,039	508,521,063
T 0.125 231015	0.13	20231015	5,000,000	4,968,359	564,579,518
T 0.125 231215	0.13	20231215	5,700,000	5,653,020	642,380,874
T 0.125 240115	0.13	20240115	7,000,000	6,935,469	788,111,991
T 0.125 240215	0.13	20240215	7,500,000	7,426,465	843,906,332
T 0.25 230415	0.25	20230415	5,670,000	5,665,127	643,756,745
T 0.25 230615	0.25	20230615	5,000,000	4,990,820	567,131,865
T 0.25 231115	0.25	20231115	5,700,000	5,673,059	644,658,012
T 0.25 240315	0.25	20240315	7,500,000	7,438,184	845,237,992
T 0.25 240515	0.25	20240515	6,600,000	6,531,164	742,168,827
T 0.25 240615	0.25	20240615	6,600,000	6,526,008	741,582,897
T 0.25 250531	0.25	20250531	2,200,000	2,145,859	243,844,730
T 0.25 250630	0.25	20250630	4,500,000	4,384,863	498,273,938
T 0.25 250731	0.25	20250731	5,800,000	5,644,352	641,395,889
T 0.25 250831	0.25	20250831	5,300,000	5,149,281	585,138,574
T 0.25 250930	0.25	20250930	4,500,000	4,369,922	496,576,072
T 0.25 251031	0.25	20251031	4,100,000	3,974,438	451,635,205
T 0.375 240415	0.38	20240415	5,200,000	5,165,672	587,001,122
T 0.375 240715	0.38	20240715	2,700,000	2,675,848	304,069,947
T 0.375 240815	0.38	20240815	3,000,000	2,971,289	337,642,432
T 0.375 240915	0.38	20240915	5,340,000	5,284,305	600,482,052
T 0.375 250430	0.38	20250430	2,000,000	1,962,656	223,026,442
T 0.375 251130	0.38	20251130	3,600,000	3,501,703	397,916,034
T 0.375 251231	0.38	20251231	5,300,000	5,150,730	585,303,256
T 0.375 260131	0.38	20260131	7,000,000	6,793,828	772,016,659
T 0.375 270731	0.38	20270731	800,000	761,750	86,561,461
T 0.375 270930	0.38	20270930	5,500,000	5,217,695	592,912,806
T 0.5 230315	0.50	20230315	4,800,000	4,811,438	546,747,700
T 0.5 250331	0.50	20250331	6,000,000	5,918,672	672,568,277
T 0.5 260228	0.50	20260228	6,000,000	5,848,594	664,604,950
T 0.5 270430	0.50	20270430	6,000,000	5,767,031	655,336,596
T 0.5 270531	0.50	20270531	9,200,000	8,832,000	1,003,624,320
T 0.5 270630	0.50	20270630	4,600,000	4,413,125	501,485,459

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
T 0.5 270831	0.50	20270831	5,000,000	4,782,813	543,494,898
T 0.5 271031	0.50	20271031	5,400,000	5,150,672	585,296,599
T 0.625 241015	0.63	20241015	3,000,000	2,987,227	339,453,490
T 0.625 260731	0.63	20260731	1,400,000	1,366,258	155,254,706
T 0.625 270331	0.63	20270331	5,000,000	4,848,438	550,952,195
T 0.625 271130	0.63	20271130	5,900,000	5,663,078	643,523,883
T 0.625 271231	0.63	20271231	6,600,000	6,327,234	718,995,278
T 0.625 300515	0.63	20300515	8,500,000	7,925,586	900,623,958
T 0.625 300815	0.63	20300815	11,400,000	10,603,336	1,204,910,078
T 0.75 260331	0.75	20260331	5,980,000	5,886,563	668,919,529
T 0.75 260430	0.75	20260430	1,280,000	1,259,150	143,083,510
T 0.75 260531	0.75	20260531	3,780,000	3,716,655	422,342,144
T 0.75 260831	0.75	20260831	5,000,000	4,904,492	557,321,970
T 0.75 280131	0.75	20280131	6,900,000	6,658,500	756,638,647
T 0.875 260630	0.88	20260630	5,000,000	4,939,844	561,339,144
T 0.875 260930	0.88	20260930	1,000,000	986,055	112,050,324
T 0.875 301115	0.88	20301115	13,000,000	12,339,336	1,402,180,438
T 1 280731	1.00	20280731	500,000	487,188	55,361,551
T 1.125 270228	1.13	20270228	2,500,000	2,488,867	282,822,423
T 1.125 280229	1.13	20280229	350,000	345,543	39,265,775
T 1.125 280831	1.13	20280831	1,500,000	1,472,461	167,323,098
T 1.125 310215	1.13	20310215	11,600,000	11,241,578	1,277,436,729
T 1.125 400515	1.13	20400515	4,600,000	4,021,047	456,931,662
T 1.125 400815	1.13	20400815	5,300,000	4,617,625	524,723,816
T 1.25 230731	1.25	20230731	3,710,000	3,762,752	427,580,273
T 1.25 240831	1.25	20240831	4,370,000	4,428,551	503,238,412
T 1.25 280331	1.25	20280331	7,300,000	7,254,375	824,350,903
T 1.25 280430	1.25	20280430	7,000,000	6,949,688	789,727,739
T 1.25 280531	1.25	20280531	6,700,000	6,647,133	755,346,936
T 1.25 280630	1.25	20280630	5,000,000	4,955,859	563,159,080
T 1.25 310815	1.25	20310815	11,700,000	11,418,926	1,297,589,631
T 1.25 500515	1.25	20500515	6,900,000	5,914,055	672,043,604
T 1.375 230215	1.38	20230215	5,000,000	5,068,359	575,943,018
T 1.375 230630	1.38	20230630	3,500,000	3,555,371	404,014,593
T 1.375 230831	1.38	20230831	3,900,000	3,964,289	450,481,987
T 1.375 230930	1.38	20230930	3,500,000	3,559,336	404,465,139
T 1.375 250131	1.38	20250131	4,300,000	4,368,195	496,379,874
T 1.375 260831	1.38	20260831	4,500,000	4,546,230	516,610,899
T 1.375 401115	1.38	20401115	6,600,000	5,998,781	681,671,507
T 1.375 500815	1.38	20500815	7,330,000	6,477,315	736,049,671
T 1.5 230228	1.50	20230228	3,000,000	3,045,586	346,085,158
T 1.5 230331	1.50	20230331	3,800,000	3,860,414	438,678,151
T 1.5 241130	1.50	20241130	4,000,000	4,081,563	463,808,354
T 1.5 260815	1.50	20260815	5,220,000	5,302,378	602,535,738
T 1.5 270131	1.50	20270131	1,070,000	1,086,886	123,508,283
T 1.5 300215	1.50	20300215	4,600,000	4,615,453	524,477,016
T 1.625 221115	1.63	20221115	9,120,000	9,244,331	1,050,479,581
T 1.625 230430	1.63	20230430	4,300,000	4,378,777	497,582,363
T 1.625 231031	1.63	20231031	4,060,000	4,148,654	471,432,285
T 1.625 260215	1.63	20260215	7,320,000	7,477,838	849,744,064
T 1.625 260515	1.63	20260515	7,200,000	7,355,813	835,877,753
T 1.625 260930	1.63	20260930	1,880,000	1,921,566	218,357,110
T 1.625 261031	1.63	20261031	4,000,000	4,088,125	464,554,084
T 1.625 290815	1.63	20290815	5,500,000	5,578,848	633,952,352
T 1.625 310515	1.63	20310515	11,190,000	11,319,821	1,286,327,913
T 1.625 501115	1.63	20501115	6,530,000	6,135,649	697,224,499
T 1.75 230131	1.75	20230131	5,600,000	5,697,344	647,417,657
T 1.75 230515	1.75	20230515	6,820,000	6,959,863	790,884,063
T 1.75 240630	1.75	20240630	4,400,000	4,517,734	513,372,745
T 1.75 240731	1.75	20240731	4,060,000	4,171,174	473,991,382
T 1.75 241231	1.75	20241231	4,770,000	4,903,411	557,199,102
T 1.75 261231	1.75	20261231	4,000,000	4,114,844	467,590,269
T 1.75 291115	1.75	20291115	4,000,000	4,094,844	465,317,569
T 1.75 410815	1.75	20410815	2,500,000	2,418,164	274,788,072
T 1.875 221031	1.88	20221031	6,210,000	6,305,818	716,561,669
T 1.875 240831	1.88	20240831	2,710,000	2,792,464	317,321,697
T 1.875 260630	1.88	20260630	3,000,000	3,098,906	352,144,211
T 1.875 260731	1.88	20260731	3,790,000	3,916,432	445,043,753
T 1.875 410215	1.88	20410215	8,100,000	8,011,406	910,376,149
T 1.875 510215	1.88	20510215	7,140,000	7,115,456	808,564,870
T 2 221031	2.00	20221031	5,290,000	5,377,409	611,061,869
T 2 221130	2.00	20221130	8,910,000	9,069,057	1,030,562,339
T 2 230215	2.00	20230215	6,710,000	6,850,753	778,485,286
T 2 240430	2.00	20240430	3,000,000	3,097,383	351,971,095
T 2 240531	2.00	20240531	5,300,000	5,473,285	621,956,758
T 2 240630	2.00	20240630	3,070,000	3,172,054	360,456,300
T 2 250215	2.00	20250215	7,470,000	7,734,368	878,894,904
T 2 250815	2.00	20250815	7,040,000	7,294,650	828,927,552

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
T 2 261115	2.00	20261115	7,600,000	7,898,656	897,563,802
T 2 500215	2.00	20500215	6,000,000	6,148,125	698,642,184
T 2 510815	2.00	20510815	6,400,000	6,570,000	746,581,950
T 2.125 221231	2.13	20221231	5,000,000	5,102,344	579,804,832
T 2.125 231130	2.13	20231130	3,000,000	3,096,914	351,917,829
T 2.125 240229	2.13	20240229	3,000,000	3,103,242	352,636,926
T 2.125 240331	2.13	20240331	7,300,000	7,551,793	858,147,994
T 2.125 240731	2.13	20240731	2,710,000	2,810,037	319,318,566
T 2.125 241130	2.13	20241130	3,070,000	3,189,202	362,405,007
T 2.125 250515	2.13	20250515	6,770,000	7,041,329	800,141,410
T 2.125 260531	2.13	20260531	3,900,000	4,072,453	462,773,211
T 2.25 231231	2.25	20231231	3,540,000	3,665,006	416,472,985
T 2.25 240131	2.25	20240131	3,070,000	3,180,808	361,451,095
T 2.25 240430	2.25	20240430	4,400,000	4,568,609	519,153,925
T 2.25 241031	2.25	20241031	4,000,000	4,167,656	473,591,617
T 2.25 241115	2.25	20241115	8,460,000	8,815,254	1,001,721,376
T 2.25 241231	2.25	20241231	3,200,000	3,336,500	379,143,177
T 2.25 251115	2.25	20251115	7,630,000	7,986,166	907,507,974
T 2.25 260331	2.25	20260331	4,000,000	4,193,438	476,521,270
T 2.25 270215	2.25	20270215	6,610,000	6,957,283	790,590,876
T 2.25 270815	2.25	20270815	6,410,000	6,749,029	766,925,900
T 2.25 271115	2.25	20271115	6,550,000	6,904,621	784,606,617
T 2.25 410515	2.25	20410515	5,220,000	5,481,408	622,879,776
T 2.25 460815	2.25	20460815	3,560,000	3,784,725	430,077,225
T 2.25 490815	2.25	20490815	5,510,000	5,942,621	675,289,747
T 2.375 230131	2.38	20230131	5,130,000	5,256,847	597,361,838
T 2.375 240229	2.38	20240229	3,060,000	3,181,563	361,536,943
T 2.375 240815	2.38	20240815	7,470,000	7,795,937	885,891,313
T 2.375 260430	2.38	20260430	3,100,000	3,267,594	371,313,015
T 2.375 270515	2.38	20270515	7,620,000	8,070,652	917,108,490
T 2.375 290515	2.38	20290515	5,800,000	6,180,172	702,283,831
T 2.375 491115	2.38	20491115	5,090,000	5,642,742	641,213,008
T 2.375 510515	2.38	20510515	6,510,000	7,243,901	823,160,665
T 2.5 230331	2.50	20230331	4,640,000	4,775,031	542,610,676
T 2.5 230815	2.50	20230815	5,380,000	5,570,822	633,040,344
T 2.5 240131	2.50	20240131	4,460,000	4,645,543	527,896,275
T 2.5 240515	2.50	20240515	7,700,000	8,044,395	914,124,772
T 2.5 250131	2.50	20250131	3,000,000	3,154,688	358,482,914
T 2.5 260228	2.50	20260228	4,200,000	4,443,141	504,896,285
T 2.5 450215	2.50	20450215	4,070,000	4,493,852	510,658,910
T 2.5 460215	2.50	20460215	3,490,000	3,876,081	440,458,492
T 2.5 460515	2.50	20460515	2,900,000	3,222,398	366,177,246
T 2.625 230228	2.63	20230228	5,040,000	5,187,853	589,521,689
T 2.625 230630	2.63	20230630	3,360,000	3,479,438	395,385,880
T 2.625 231231	2.63	20231231	3,610,000	3,765,822	427,929,212
T 2.625 250331	2.63	20250331	3,850,000	4,067,766	462,240,547
T 2.625 251231	2.63	20251231	3,500,000	3,718,203	422,518,012
T 2.625 260131	2.63	20260131	3,750,000	3,984,961	452,831,036
T 2.625 290215	2.63	20290215	7,090,000	7,671,602	871,762,443
T 2.75 230430	2.75	20230430	3,100,000	3,205,715	364,281,405
T 2.75 230531	2.75	20230531	4,780,000	4,951,408	562,653,226
T 2.75 230731	2.75	20230731	4,780,000	4,967,279	564,456,737
T 2.75 230831	2.75	20230831	3,910,000	4,067,622	462,224,212
T 2.75 231115	2.75	20231115	7,100,000	7,412,012	842,263,951
T 2.75 240215	2.75	20240215	5,840,000	6,118,541	695,280,363
T 2.75 250630	2.75	20250630	2,000,000	2,125,313	241,509,885
T 2.75 250831	2.75	20250831	3,710,000	3,946,802	448,494,883
T 2.75 280215	2.75	20280215	7,800,000	8,450,813	960,308,078
T 2.75 420815	2.75	20420815	1,860,000	2,118,802	240,770,015
T 2.75 421115	2.75	20421115	2,420,000	2,758,989	313,517,721
T 2.75 470815	2.75	20470815	2,430,000	2,848,605	323,701,282
T 2.75 471115	2.75	20471115	4,010,000	4,702,978	534,422,919
T 2.750 250228	2.75	20250228	4,210,000	4,463,258	507,182,301
T 2.875 230930	2.88	20230930	3,540,000	3,696,120	420,008,542
T 2.875 231031	2.88	20231031	3,100,000	3,241,316	368,326,989
T 2.875 231130	2.88	20231130	2,810,000	2,942,268	334,344,576
T 2.875 250430	2.88	20250430	3,080,000	3,281,884	372,936,931
T 2.875 250531	2.88	20250531	3,400,000	3,624,719	411,894,915
T 2.875 250731	2.88	20250731	3,600,000	3,845,813	437,018,903
T 2.875 251130	2.88	20251130	3,850,000	4,125,816	468,837,147
T 2.875 280515	2.88	20280515	7,200,000	7,866,000	893,852,910
T 2.875 280815	2.88	20280815	7,620,000	8,343,305	948,091,428
T 2.875 430515	2.88	20430515	3,700,000	4,303,563	489,035,324
T 2.875 450815	2.88	20450815	2,470,000	2,914,021	331,134,786
T 2.875 461115	2.88	20461115	2,300,000	2,738,078	311,141,508
T 2.875 490515	2.88	20490515	5,200,000	6,313,938	717,484,287
T 3 250930	3.00	20250930	3,410,000	3,663,619	416,315,316
T 3 251031	3.00	20251031	2,060,000	2,215,144	251,717,860

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
T 3 420515	3.00	20420515	1,250,000	1,479,785	168,155,386
T 3 441115	3.00	20441115	3,070,000	3,672,488	417,323,117
T 3 450515	3.00	20450515	1,500,000	1,802,109	204,782,699
T 3 451115	3.00	20451115	1,300,000	1,568,531	178,240,048
T 3 470215	3.00	20470215	3,300,000	4,020,586	456,879,283
T 3 470515	3.00	20470515	2,700,000	3,300,961	375,104,696
T 3 480215	3.00	20480215	4,400,000	5,410,281	614,797,309
T 3 480815	3.00	20480815	5,300,000	6,533,492	742,433,385
T 3 490215	3.00	20490215	5,700,000	7,063,992	802,716,752
T 3.125 281115	3.13	20281115	7,190,000	8,009,548	910,164,948
T 3.125 411115	3.13	20411115	1,440,000	1,730,925	196,693,662
T 3.125 420215	3.13	20420215	1,620,000	1,951,341	221,740,592
T 3.125 430215	3.13	20430215	2,300,000	2,775,094	315,347,778
T 3.125 440815	3.13	20440815	3,400,000	4,138,703	470,301,530
T 3.125 480515	3.13	20480515	5,140,000	6,474,794	735,763,187
T 3.375 440515	3.38	20440515	2,100,000	2,649,938	301,125,647
T 3.375 481115	3.38	20481115	5,800,000	7,651,469	869,474,651
T 3.5 390215	3.50	20390215	1,470,000	1,849,559	210,174,590
T 3.625 430815	3.63	20430815	2,580,000	3,354,202	381,154,694
T 3.625 440215	3.63	20440215	2,880,000	3,758,400	427,085,784
T 3.75 410815	3.75	20410815	2,000,000	2,612,344	296,853,682
T 3.75 431115	3.75	20431115	2,670,000	3,538,793	402,130,739
T 3.875 400815	3.88	20400815	2,100,000	2,772,820	315,089,435
T 4.25 390515	4.25	20390515	1,620,000	2,225,981	252,949,379
T 4.25 401115	4.25	20401115	1,500,000	2,073,047	235,570,682
T 4.375 391115	4.38	20391115	1,960,000	2,735,425	310,840,019
T 4.375 400515	4.38	20400515	1,870,000	2,621,652	297,911,463
T 4.375 410515	4.38	20410515	1,740,000	2,453,264	278,776,661
T 4.5 360215	4.50	20360215	1,050,000	1,453,020	165,113,874
T 4.5 380515	4.50	20380515	880,000	1,236,538	140,513,938
T 4.5 390815	4.50	20390815	1,950,000	2,760,316	313,668,555
T 4.625 400215	4.63	20400215	1,650,000	2,373,809	269,747,739
T 4.75 410215	4.75	20410215	1,000,000	1,469,805	167,021,255
T 5 370515	5.00	20370515	1,050,000	1,536,855	174,640,571
T 5.375 310215	5.38	20310215	1,120,000	1,500,450	170,503,635
T 6 260215	6.00	20260215	490,000	589,876	67,030,534
T 6.125 271115	6.13	20271115	3,000,000	3,835,781	435,879,002
T 6.25 300515	6.25	20300515	10,000	13,854	1,574,289
U.S.T.B 5.5% 280815	5.50	20280815	720,000	910,069	103,415,662
<英ポンド・・・英国>	%		英ポンド	英ポンド	円
UKT 0.125 240131	0.13	20240131	3,300,000	3,274,499	494,741,081
UKT 0.125 260130	0.13	20260130	1,930,000	1,897,044	286,622,676
UKT 0.125 280131	0.13	20280131	1,000,000	969,444	146,472,478
UKT 0.25 310731	0.25	20310731	3,730,000	3,523,192	532,315,953
UKT 0.375 261022	0.38	20261022	930,000	918,119	138,717,836
UKT 0.375 301022	0.38	20301022	1,710,000	1,650,316	249,344,681
UKT 0.5 290131	0.50	20290131	100,000	98,431	14,871,838
UKT 0.5 611022	0.50	20611022	350,000	317,004	47,895,862
UKT 0.625 250607	0.63	20250607	1,800,000	1,810,197	273,501,082
UKT 0.625 350731	0.63	20350731	2,700,000	2,563,533	387,321,954
UKT 0.625 501022	0.63	20501022	150,000	138,338	20,901,414
UKT 0.75 230722	0.75	20230722	2,520,000	2,534,954	383,003,897
UKT 0.875 291022	0.88	20291022	1,700,000	1,720,655	259,972,208
UKT 0.875 330731	0.88	20330731	200,000	199,320	30,115,018
UKT 0.875 460131	0.88	20460131	150,000	145,139	21,928,958
UKT 1 240422	1.00	20240422	2,920,000	2,960,092	447,237,563
UKT 1.125 390131	1.13	20390131	600,000	606,005	91,560,717
UKT 1.25 270722	1.25	20270722	2,300,000	2,384,065	360,206,225
UKT 1.25 411022	1.25	20411022	2,350,000	2,433,026	367,603,623
UKT 1.5 260722	1.50	20260722	1,760,000	1,836,208	277,431,059
UKT 1.5 470722	1.50	20470722	2,300,000	2,562,662	387,190,260
UKT 1.625 281022	1.63	20281022	1,350,000	1,439,578	217,504,605
UKT 1.625 541022	1.63	20541022	280,000	335,458	50,684,101
UKT 1.625 711022	1.63	20711022	1,320,000	1,861,286	281,219,949
UKT 1.75 370907	1.75	20370907	2,470,000	2,728,836	412,297,400
UKT 1.75 490122	1.75	20490122	1,350,000	1,601,481	241,966,352
UKT 1.75 570722	1.75	20570722	2,300,000	2,926,871	442,218,220
UKT 2 250907	2.00	20250907	1,800,000	1,898,863	286,897,524
UKT 2.25 230907	2.25	20230907	3,020,000	3,116,294	470,838,075
UKT 2.5 650722	2.50	20650722	2,120,000	3,488,142	527,020,221
UKT 2.75 240907	2.75	20240907	500,000	531,252	80,266,323
UKT 3.25 440122	3.25	20440122	1,910,000	2,754,957	416,243,887
UKT 3.5 450122	3.50	20450122	1,620,000	2,450,208	370,199,741
UKT 3.5 680722	3.50	20680722	1,990,000	4,149,078	626,880,438
UKT 3.75 520722	3.75	20520722	1,820,000	3,183,144	480,938,399
UKT 4 600122	4.00	20600122	1,820,000	3,725,282	562,849,423
UKT 4.25 271207	4.25	20271207	1,460,000	1,771,519	267,657,208
UKT 4.25 320607	4.25	20320607	2,060,000	2,759,432	416,920,056

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
UKT 4.25 360307	4.25	20360307	1,840,000	2,641,830	399,151,714
UKT 4.25 390907	4.25	20390907	1,580,000	2,412,497	364,501,934
UKT 4.25 401207	4.25	20401207	1,600,000	2,490,589	376,300,810
UKT 4.25 461207	4.25	20461207	2,000,000	3,428,630	518,028,667
UKT 4.25 491207	4.25	20491207	1,440,000	2,603,094	393,299,083
UKT 4.25 551207	4.25	20551207	2,140,000	4,255,791	643,003,684
UKT 4.5 340907	4.50	20340907	700,000	998,299	150,832,048
UKT 4.5 421207	4.50	20421207	2,170,000	3,600,946	544,063,636
UKT 4.75 301207	4.75	20301207	1,830,000	2,465,287	372,477,966
UKT 4.75 381207	4.75	20381207	1,600,000	2,541,721	384,026,322
UKT 5 250307	5.00	20250307	2,000,000	2,290,458	346,063,228
UKT 6 281207	6.00	20281207	900,000	1,229,894	185,823,642
<カナダドル・・・カナダ>	%		カナダドル	カナダドル	円
CAN 0.25 230201	0.25	20230201	2,580,000	2,565,075	227,854,026
CAN 0.25 230801	0.25	20230801	850,000	841,132	74,717,239
CAN 0.25 240401	0.25	20240401	1,210,000	1,187,815	105,512,853
CAN 0.25 260301	0.25	20260301	2,500,000	2,386,368	211,979,574
CAN 0.5 250901	0.50	20250901	3,360,000	3,262,980	289,848,530
CAN 0.5 301201	0.50	20301201	2,650,000	2,412,351	214,287,642
CAN 0.75 241001	0.75	20241001	400,000	395,535	35,135,115
CAN 1 260901	1.00	20260901	1,920,000	1,883,752	167,332,573
CAN 1 270601	1.00	20270601	1,000,000	977,054	86,791,112
CAN 1.25 250301	1.25	20250301	1,100,000	1,101,865	97,877,953
CAN 1.25 300601	1.25	20300601	3,520,000	3,446,045	306,110,065
CAN 1.5 230601	1.50	20230601	3,130,000	3,161,097	280,798,285
CAN 1.5 240901	1.50	20240901	1,300,000	1,313,528	116,679,876
CAN 1.5 260601	1.50	20260601	710,000	714,350	63,455,291
CAN 1.5 310601	1.50	20310601	1,960,000	1,939,502	172,284,812
CAN 1.5 311201	1.50	20311201	150,000	147,502	13,102,517
CAN 1.75 230301	1.75	20230301	4,460,000	4,514,269	400,999,796
CAN 1.75 531201	1.75	20531201	300,000	284,366	25,260,067
CAN 2 230901	2.00	20230901	3,300,000	3,362,261	298,667,609
CAN 2 280601	2.00	20280601	1,730,000	1,787,891	158,817,269
CAN 2 511201	2.00	20511201	4,020,000	4,075,223	361,999,559
CAN 2.25 240301	2.25	20240301	1,600,000	1,643,504	145,991,461
CAN 2.25 250601	2.25	20250601	690,000	714,196	63,441,555
CAN 2.25 290601	2.25	20290601	1,300,000	1,372,259	121,896,950
CAN 2.5 240601	2.50	20240601	1,460,000	1,511,134	134,233,077
CAN 2.75 481201	2.75	20481201	1,700,000	1,992,069	176,954,234
CAN 2.75 641201	2.75	20641201	590,000	710,651	63,126,684
CAN 3.5 451201	3.50	20451201	1,340,000	1,745,513	155,052,901
CAN 4 410601	4.00	20410601	1,210,000	1,625,411	144,384,284
CAN 5 370601	5.00	20370601	780,000	1,113,574	98,918,103
CAN 5.75 290601	5.75	20290601	1,360,000	1,771,434	157,355,405
CAN 5.75 330601	5.75	20330601	1,400,000	1,982,168	176,074,743
<オーストラリアドル・・・オーストラリア>	%		オーストラリアドル	オーストラリアドル	円
ACGB 0.25 241121	0.25	20241121	2,580,000	2,530,557	204,627,567
ACGB 0.25 251121	0.25	20251121	2,300,000	2,214,250	179,050,184
ACGB 0.5 260921	0.50	20260921	630,000	604,296	48,864,985
ACGB 1 301221	1.00	20301221	3,380,000	3,180,489	257,182,779
ACGB 1 311121	1.00	20311121	2,910,000	2,713,146	219,392,230
ACGB 1.25 320521	1.25	20320521	1,700,000	1,616,464	130,711,552
ACGB 1.5 310621	1.50	20310621	2,750,000	2,696,418	218,039,555
ACGB 1.75 321121	1.75	20321121	1,460,000	1,453,798	117,557,978
ACGB 1.75 510621	1.75	20510621	1,610,000	1,399,672	113,181,181
ACGB 2.25 221121	2.25	20221121	2,380,000	2,427,148	196,265,641
ACGB 2.25 280521	2.25	20280521	1,830,000	1,914,546	154,815,293
ACGB 2.5 300521	2.50	20300521	3,180,000	3,392,636	274,337,625
ACGB 2.75 240421	2.75	20240421	1,090,000	1,142,920	92,419,517
ACGB 2.75 271121	2.75	20271121	1,840,000	1,975,240	159,723,172
ACGB 2.75 281121	2.75	20281121	1,590,000	1,716,998	138,841,054
ACGB 2.75 291121	2.75	20291121	2,600,000	2,819,440	227,987,435
ACGB 2.75 350621	2.75	20350621	1,350,000	1,480,282	119,699,561
ACGB 2.75 410521	2.75	20410521	1,440,000	1,545,421	124,966,824
ACGB 3 470321	3.00	20470321	1,430,000	1,598,740	129,278,378
ACGB 3.25 250421	3.25	20250421	2,430,000	2,605,808	210,712,607
ACGB 3.25 290421	3.25	20290421	2,400,000	2,681,308	216,817,739
ACGB 3.25 390621	3.25	20390621	1,000,000	1,154,200	93,331,689
ACGB 3.75 370421	3.75	20370421	900,000	1,100,580	88,995,857
ACGB 4.25 260421	4.25	20260421	2,120,000	2,389,452	193,217,458
ACGB 4.5 330421	4.50	20330421	1,900,000	2,431,476	196,615,660
ACGB 4.75 270421	4.75	20270421	2,180,000	2,561,020	207,090,866
ACGB 5.5 230421	5.50	20230421	2,260,000	2,421,573	195,814,871
<デンマーククローネ・・・デンマーク>	%		デンマーククローネ	デンマーククローネ	円
DGB 0 241115	0.00	20241115	2,890,000	2,938,783	50,599,810
DGB 0 311115	0.00	20311115	1,900,000	1,910,262	32,890,782
DGB 0.25 221115	0.25	20221115	4,560,000	4,600,751	79,215,480
DGB 0.25 521115	0.25	20521115	4,260,000	4,282,748	73,740,130

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
DGB 0.5 271115	0.50	20271115	9,900,000	10,403,910	179,133,960
DGB 0.5 291115	0.50	20291115	9,000,000	9,498,600	163,546,381
DGB 1.5 231115	1.50	20231115	8,810,000	9,186,381	158,170,608
DGB 1.75 251115	1.75	20251115	7,740,000	8,427,699	145,107,666
DGB 4.5 391115	4.50	20391115	14,140,000	25,574,526	440,340,806
<スウェーデンクローナ・・・スウェーデン>	%		スウェーデンクローナ	スウェーデンクローナ	円
SGB 0.125 310512	0.13	20310512	5,260,000	5,214,926	65,249,378
SGB 0.75 280512	0.75	20280512	6,900,000	7,197,895	90,060,372
SGB 0.75 291112	0.75	20291112	6,830,000	7,159,684	89,582,275
SGB 1 261112	1.00	20261112	8,010,000	8,409,098	105,214,998
SGB 1.5 231113	1.50	20231113	10,860,000	11,240,187	140,637,701
SGB 2.25 320601	2.25	20320601	3,350,000	4,051,674	50,694,722
SGB 2.5 250512	2.50	20250512	9,040,000	9,859,024	123,356,532
SGB 3.5 390330	3.50	20390330	5,040,000	7,585,460	94,909,596
<マレーシアリング・・・マレーシア>	%		マレーシアリング	マレーシアリング	円
MGS 2.632 310415	2.63	20310415	650,000	603,993	16,193,156
MGS 3.478 240614	3.48	20240614	200,000	203,839	5,464,969
MGS 3.48 230315	3.48	20230315	2,220,000	2,254,403	60,440,981
MGS 3.733 280615	3.73	20280615	1,700,000	1,731,429	46,419,937
MGS 3.757 400522	3.76	20400522	1,900,000	1,800,756	48,278,613
MGS 3.8 230817	3.80	20230817	1,540,000	1,576,169	42,257,395
MGS 3.828 340705	3.83	20340705	1,600,000	1,577,605	42,295,897
MGS 3.844 330415	3.84	20330415	1,560,000	1,566,236	41,991,082
MGS 3.882 250314	3.88	20250314	1,400,000	1,448,924	38,845,923
MGS 3.885 290815	3.89	20290815	3,100,000	3,177,773	85,196,708
MGS 3.892 270315	3.89	20270315	1,660,000	1,713,909	45,950,225
MGS 3.899 271116	3.90	20271116	1,840,000	1,897,145	50,862,823
MGS 3.9 261130	3.90	20261130	1,600,000	1,656,237	44,404,044
MGS 3.906 260715	3.91	20260715	2,400,000	2,484,736	66,616,245
MGS 3.955 250915	3.96	20250915	2,720,000	2,824,112	75,714,987
MGS 4.059 240930	4.06	20240930	1,460,000	1,515,507	40,631,034
MGS 4.065 500615	4.07	20500615	1,000,000	961,559	25,779,585
MGS 4.181 240715	4.18	20240715	1,910,000	1,985,790	53,239,415
MGS 4.232 310630	4.23	20310630	1,800,000	1,886,988	50,590,498
MGS 4.254 350531	4.25	20350531	1,100,000	1,141,156	30,594,622
MGS 4.392 260415	4.39	20260415	1,480,000	1,559,481	41,809,986
MGS 4.498 300415	4.50	20300415	1,200,000	1,277,241	34,243,073
MGS 4.642 331107	4.64	20331107	1,600,000	1,712,379	45,909,219
MGS 4.736 460315	4.74	20460315	1,800,000	1,894,941	50,803,737
MGS 4.762 370407	4.76	20370407	2,000,000	2,133,526	57,200,253
MGS 4.893 380608	4.89	20380608	700,000	752,023	20,161,887
MGS 4.921 480706	4.92	20480706	900,000	972,862	26,082,608
MGS 4.935 430930	4.94	20430930	1,620,000	1,750,223	46,923,807
<ノルウェークローネ・・・ノルウェー>	%		ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	円
NGB 1.25 310917	1.25	20310917	3,100,000	3,006,070	37,759,254
NGB 1.375 300819	1.38	20300819	5,170,000	5,085,651	63,880,884
NGB 1.5 260219	1.50	20260219	4,300,000	4,307,792	54,110,184
NGB 1.75 250313	1.75	20250313	3,690,000	3,732,656	46,885,908
NGB 1.75 270217	1.75	20270217	5,720,000	5,786,924	72,689,570
NGB 1.75 290906	1.75	20290906	5,090,000	5,154,389	64,744,290
NGB 2 230524	2.00	20230524	8,040,000	8,145,716	102,318,359
NGB 2 280426	2.00	20280426	4,810,000	4,945,642	62,122,224
NGB 3 240314	3.00	20240314	9,080,000	9,433,303	118,491,746
<シンガポールドル・・・シンガポール>	%		シンガポールドル	シンガポールドル	円
SIGB 1.625 310701	1.63	20310701	160,000	158,064	13,106,353
SIGB 1.75 230201	1.75	20230201	1,090,000	1,104,606	91,591,769
SIGB 1.875 500301	1.88	20500301	700,000	675,500	56,011,122
SIGB 1.875 511001	1.88	20511001	130,000	127,657	10,585,098
SIGB 2 240201	2.00	20240201	110,000	112,811	9,354,068
SIGB 2.125 260601	2.13	20260601	760,000	786,600	65,223,314
SIGB 2.25 360801	2.25	20360801	960,000	997,205	82,686,247
SIGB 2.375 250601	2.38	20250601	900,000	936,630	77,663,504
SIGB 2.375 390701	2.38	20390701	240,000	254,040	21,064,493
SIGB 2.625 280501	2.63	20280501	1,060,000	1,128,900	93,606,152
SIGB 2.75 230701	2.75	20230701	1,200,000	1,238,423	102,687,595
SIGB 2.75 420401	2.75	20420401	640,000	718,157	59,548,139
SIGB 2.75 460301	2.75	20460301	890,000	1,003,030	83,169,261
SIGB 2.875 290701	2.88	20290701	210,000	228,060	18,910,283
SIGB 2.875 300901	2.88	20300901	1,130,000	1,232,830	102,223,822
SIGB 3 240901	3.00	20240901	1,280,000	1,350,131	111,950,194
SIGB 3.375 330901	3.38	20330901	900,000	1,038,150	86,081,342
SIGB 3.5 270301	3.50	20270301	510,000	561,765	46,580,441
<メキシコペソ・・・メキシコ>	%		メキシコペソ	メキシコペソ	円
MBONO 10 241205	10.00	20241205	27,430,000	29,418,480	153,694,423
MBONO 10 361120	10.00	20361120	7,180,000	8,565,151	44,747,922
MBONO 5.75 260305	5.75	20260305	42,750,000	40,226,804	210,161,618
MBONO 6.75 230309	6.75	20230309	20,510,000	20,606,807	107,658,564
MBONO 7.5 270603	7.50	20270603	33,280,000	33,359,236	174,282,578

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
MBONO 7.75 310529	7.75	20310529	26,950,000	27,116,955	141,670,295
MBONO 7.75 341123	7.75	20341123	10,000,000	10,016,300	52,329,333
MBONO 7.75 421113	7.75	20421113	21,030,000	20,146,829	105,255,443
MBONO 8 231207	8.00	20231207	28,380,000	28,976,420	151,384,915
MBONO 8 240905	8.00	20240905	27,650,000	28,154,060	147,088,561
MBONO 8 471107	8.00	20471107	22,120,000	21,718,858	113,468,379
MBONO 8.5 290531	8.50	20290531	33,930,000	35,751,647	186,781,532
MBONO 8.5 381118	8.50	20381118	23,570,000	24,380,523	127,374,029
<ポーランドズロティ・・・ポーランド>	%		ポーランドズロティ	ポーランドズロティ	円
POLGB 0 230425	0.00	20230425	610,000	587,125	16,038,161
POLGB 0.25 261025	0.25	20261025	1,000,000	866,600	23,672,421
POLGB 0.75 250425	0.75	20250425	600,000	555,930	15,186,025
POLGB 1.25 301025	1.25	20301025	4,320,000	3,801,600	103,846,155
POLGB 2.25 241025	2.25	20241025	4,400,000	4,297,040	117,379,809
POLGB 2.5 230125	2.50	20230125	3,420,000	3,421,163	93,453,968
POLGB 2.5 240425	2.50	20240425	4,830,000	4,788,462	130,803,706
POLGB 2.5 260725	2.50	20260725	6,110,000	5,945,519	162,410,380
POLGB 2.5 270725	2.50	20270725	4,540,000	4,368,615	119,334,982
POLGB 2.75 280425	2.75	20280425	4,860,000	4,731,453	129,246,424
POLGB 2.75 291025	2.75	20291025	3,250,000	3,156,725	86,230,466
POLGB 3.25 250725	3.25	20250725	4,870,000	4,881,688	133,350,308
POLGB 4 231025	4.00	20231025	3,710,000	3,799,040	103,776,225
POLGB 5.75 290425	5.75	20290425	940,000	1,109,200	30,299,388
<イスラエルシケル・・・イスラエル>	%		イスラエルシケル	イスラエルシケル	円
ILGOV 0.15 230731	0.15	20230731	1,770,000	1,773,184	63,613,483
ILGOV 0.5 250430	0.50	20250430	1,210,000	1,220,263	43,777,312
ILGOV 1 300331	1.00	20300331	3,130,000	3,148,600	112,956,958
ILGOV 1.5 231130	1.50	20231130	780,000	801,326	28,747,809
ILGOV 1.5 370531	1.50	20370531	1,710,000	1,666,430	59,783,671
ILGOV 1.75 250831	1.75	20250831	3,100,000	3,266,733	117,195,020
ILGOV 2 270331	2.00	20270331	3,400,000	3,668,549	131,610,269
ILGOV 2.25 280928	2.25	20280928	2,300,000	2,541,503	91,177,180
ILGOV 3.75 240331	3.75	20240331	3,300,000	3,578,633	128,384,513
ILGOV 3.75 470331	3.75	20470331	2,540,000	3,356,697	120,422,493
ILGOV 4.25 230331	4.25	20230331	4,000,000	4,226,422	151,624,140
ILGOV 5.5 420131	5.50	20420131	2,300,000	3,731,734	133,877,074
ILGOV 6.25 261030	6.25	20261030	1,700,000	2,182,518	78,298,484
<中国人民元・・・中国>	%		中国人民元	中国人民元	円
CGB 2.47 240902	2.47	20240902	4,000,000	3,992,394	70,979,988
CGB 2.56 231021	2.56	20231021	4,000,000	4,006,657	71,233,563
CGB 2.68 300521	2.68	20300521	7,000,000	6,872,007	122,176,060
CGB 2.69 260812	2.69	20260812	7,000,000	7,007,827	124,590,785
CGB 2.91 281014	2.91	20281014	7,000,000	7,022,855	124,857,958
CGB 3.72 510412	3.72	20510412	1,100,000	1,160,027	20,623,891
<ユーロ・・・ベルギー>	%		ユーロ	ユーロ	円
BGB 0 271022	0.00	20271022	100,000	102,392	13,111,293
BGB 0 311022	0.00	20311022	1,050,000	1,046,160	133,960,388
BGB 0.1 300622	0.10	20300622	600,000	611,580	78,312,574
BGB 0.2 231022	0.20	20231022	1,580,000	1,609,230	206,061,257
BGB 0.4 400622	0.40	20400622	1,020,000	996,825	127,642,988
BGB 0.5 241022	0.50	20241022	2,100,000	2,174,829	278,486,021
BGB 0.65 710622	0.65	20710622	600,000	526,733	67,447,892
BGB 0.8 250622	0.80	20250622	1,520,000	1,598,128	204,639,650
BGB 0.8 270622	0.80	20270622	1,760,000	1,882,899	241,104,468
BGB 0.8 280622	0.80	20280622	2,030,000	2,183,874	279,644,191
BGB 0.9 290622	0.90	20290622	2,470,000	2,684,905	343,800,987
BGB 1 260622	1.00	20260622	1,690,000	1,809,787	231,742,526
BGB 1 310622	1.00	20310622	1,700,000	1,870,731	239,546,355
BGB 1.25 330422	1.25	20330422	1,330,000	1,507,954	193,092,906
BGB 1.45 370622	1.45	20370622	600,000	696,307	89,161,858
BGB 1.6 470622	1.60	20470622	1,180,000	1,428,834	182,961,580
BGB 1.7 500622	1.70	20500622	1,150,000	1,430,545	183,180,689
BGB 1.9 380622	1.90	20380622	900,000	1,115,298	142,813,462
BGB 2.15 660622	2.15	20660622	760,000	1,099,492	140,789,510
BGB 2.25 230622	2.25	20230622	1,210,000	1,267,802	162,341,531
BGB 2.25 570622	2.25	20570622	710,000	1,017,868	130,337,599
BGB 2.6 240622	2.60	20240622	1,040,000	1,129,232	144,597,705
BGB 3 340622	3.00	20340622	1,300,000	1,754,870	224,710,401
BGB 3.75 450622	3.75	20450622	1,090,000	1,838,721	235,447,488
BGB 4 320328	4.00	20320328	580,000	820,891	105,114,725
BGB 4.25 410328	4.25	20410328	1,490,000	2,513,240	321,819,327
BGB 4.5 260328	4.50	20260328	1,560,000	1,911,456	244,761,114
BGB 5 350328	5.00	20350328	2,400,000	3,911,494	500,865,190
BGB 5.5 280328	5.50	20280328	2,490,000	3,440,582	440,565,199
<ユーロ・・・フランス>	%		ユーロ	ユーロ	円
FRTR 0 230325	0.00	20230325	5,010,000	5,060,701	648,020,763
FRTR 0 240225	0.00	20240225	3,320,000	3,372,352	431,828,291
FRTR 0 240325	0.00	20240325	4,800,000	4,877,280	624,533,752

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
FRTR 0 250325	0.00	20250325	5,360,000	5,471,032	700,563,509
FRTR 0 260225	0.00	20260225	4,890,000	4,999,556	640,191,088
FRTR 0 270225	0.00	20270225	1,810,000	1,849,331	236,806,132
FRTR 0 291125	0.00	20291125	4,820,000	4,881,677	625,096,750
FRTR 0 301125	0.00	20301125	5,100,000	5,131,304	657,061,398
FRTR 0 311125	0.00	20311125	3,250,000	3,236,496	414,432,049
FRTR 0.25 261125	0.25	20261125	4,380,000	4,538,797	581,191,126
FRTR 0.5 250525	0.50	20250525	5,020,000	5,215,318	667,819,403
FRTR 0.5 260525	0.50	20260525	4,980,000	5,189,658	664,533,629
FRTR 0.5 290525	0.50	20290525	5,000,000	5,271,320	674,990,416
FRTR 0.5 400525	0.50	20400525	1,910,000	1,913,224	244,987,577
FRTR 0.5 440625	0.50	20440625	890,000	877,158	112,319,755
FRTR 0.5 720525	0.50	20720525	910,000	756,000	96,805,470
FRTR 0.75 280525	0.75	20280525	4,410,000	4,716,716	603,973,532
FRTR 0.75 281125	0.75	20281125	5,510,000	5,908,274	756,552,098
FRTR 0.75 520525	0.75	20520525	3,240,000	3,239,086	414,763,706
FRTR 0.75 530525	0.75	20530525	730,000	723,285	92,616,320
FRTR 1 251125	1.00	20251125	4,530,000	4,814,711	616,521,752
FRTR 1 270525	1.00	20270525	4,650,000	5,016,885	642,410,116
FRTR 1.25 340525	1.25	20340525	4,510,000	5,085,904	651,248,029
FRTR 1.25 360525	1.25	20360525	4,500,000	5,091,750	651,996,549
FRTR 1.5 310525	1.50	20310525	5,280,000	6,050,563	774,772,196
FRTR 1.5 500525	1.50	20500525	3,680,000	4,437,086	568,167,137
FRTR 1.75 230525	1.75	20230525	5,640,000	5,905,080	756,143,130
FRTR 1.75 241125	1.75	20241125	4,710,000	5,052,912	647,023,301
FRTR 1.75 390625	1.75	20390625	3,040,000	3,764,392	482,028,950
FRTR 1.75 660525	1.75	20660525	1,340,000	1,776,392	227,466,341
FRTR 2 480525	2.00	20480525	3,240,000	4,308,798	551,739,890
FRTR 2.25 240525	2.25	20240525	4,330,000	4,650,872	595,542,361
FRTR 2.5 300525	2.50	20300525	5,190,000	6,370,175	815,698,341
FRTR 2.75 271025	2.75	20271025	5,970,000	7,100,169	909,173,768
FRTR 3.25 450525	3.25	20450525	2,670,000	4,251,735	544,432,926
FRTR 3.5 260425	3.50	20260425	5,090,000	5,997,802	768,016,081
FRTR 4 381025	4.00	20381025	2,960,000	4,748,728	608,072,719
FRTR 4 550425	4.00	20550425	2,230,000	4,366,322	559,105,805
FRTR 4 600425	4.00	20600425	1,890,000	3,890,841	498,220,625
FRTR 4.25 231025	4.25	20231025	5,130,000	5,623,763	720,120,537
FRTR 4.5 410425	4.50	20410425	4,330,000	7,592,967	972,276,354
FRTR 4.75 350425	4.75	20350425	3,470,000	5,563,652	712,423,445
FRTR 5.5 290425	5.50	20290425	4,760,000	6,816,111	872,800,229
FRTR 5.75 321025	5.75	20321025	3,710,000	6,027,455	771,813,227
FRTR 6 251025	6.00	20251025	840,000	1,055,628	135,172,742
FRTR 8.5 230425	8.50	20230425	100,000	113,029	14,473,266
<ユーロ・・・ドイツ>	%		ユーロ	ユーロ	円
DBR 0 260815	0.00	20260815	3,670,000	3,786,523	484,862,690
DBR 0 271115	0.00	20271115	3,000,000	3,103,740	397,432,664
DBR 0 281115	0.00	20281115	600,000	621,324	79,560,289
DBR 0 290815	0.00	20290815	2,700,000	2,800,089	358,550,275
DBR 0 300215	0.00	20300215	2,900,000	3,007,851	385,154,116
DBR 0 300815	0.00	20300815	3,600,000	3,733,848	478,117,742
DBR 0 300815	0.00	20300815	500,000	521,025	66,717,042
DBR 0 310215	0.00	20310215	2,400,000	2,483,208	317,973,790
DBR 0 310815	0.00	20310815	1,500,000	1,547,160	198,113,218
DBR 0 310815	0.00	20310815	150,000	155,124	19,863,566
DBR 0 350515	0.00	20350515	2,550,000	2,610,410	334,261,891
DBR 0 360515	0.00	20360515	1,940,000	1,976,239	253,056,638
DBR 0 500815	0.00	20500815	2,510,000	2,517,982	322,426,561
DBR 0 500815	0.00	20500815	800,000	813,640	104,186,276
DBR 0 520815	0.00	20520815	1,010,000	1,003,930	128,552,821
DBR 0.25 270215	0.25	20270215	3,750,000	3,921,675	502,168,914
DBR 0.25 280815	0.25	20280815	3,800,000	4,003,870	512,693,951
DBR 0.25 290215	0.25	20290215	3,540,000	3,738,063	478,657,471
DBR 0.5 250215	0.50	20250215	3,300,000	3,433,683	439,681,733
DBR 0.5 260215	0.50	20260215	3,390,000	3,561,839	456,092,071
DBR 0.5 270815	0.50	20270815	3,160,000	3,359,996	430,246,194
DBR 0.5 280215	0.50	20280215	2,850,000	3,041,748	389,494,614
DBR 1 240815	1.00	20240815	2,760,000	2,893,667	370,532,875
DBR 1 250815	1.00	20250815	3,690,000	3,927,636	502,932,217
DBR 1.25 480815	1.25	20480815	3,300,000	4,448,400	569,615,839
DBR 1.5 230215	1.50	20230215	3,800,000	3,908,110	500,431,921
DBR 1.5 230515	1.50	20230515	3,800,000	3,930,492	503,297,927
DBR 1.5 240515	1.50	20240515	1,900,000	2,007,825	257,101,187
DBR 1.75 240215	1.75	20240215	3,290,000	3,477,037	445,233,132
DBR 2 230815	2.00	20230815	3,550,000	3,723,311	476,768,483
DBR 2.5 440704	2.50	20440704	3,230,000	5,199,363	665,776,389
DBR 2.5 460815	2.50	20460815	3,290,000	5,440,114	696,604,382
DBR 3.25 420704	3.25	20420704	2,110,000	3,628,947	464,685,185
DBR 4 370104	4.00	20370104	3,130,000	5,182,122	663,568,635

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
DBR 4.25 390704	4.25	20390704	2,080,000	3,755,606	480,903,896
DBR 4.75 280704	4.75	20280704	1,660,000	2,257,534	289,076,274
DBR 4.75 340704	4.75	20340704	2,630,000	4,354,728	557,621,139
DBR 4.75 400704	4.75	20400704	2,220,000	4,316,546	552,731,962
DBR 5.5 310104	5.50	20310104	2,550,000	3,966,882	507,957,652
DBR 6.25 240104	6.25	20240104	790,000	909,053	116,403,872
DBR 6.25 300104	6.25	20300104	770,000	1,201,862	153,897,973
DBR 6.5 270704	6.50	20270704	20,000	28,188	3,609,487
GERMANY 5.625%280104	5.63	20280104	2,030,000	2,821,335	361,270,766
OBL 0 230414	0.00	20230414	2,400,000	2,427,192	310,800,964
OBL 0 231013	0.00	20231013	3,400,000	3,452,768	442,125,560
OBL 0 240405	0.00	20240405	3,100,000	3,157,691	404,341,068
OBL 0 241018	0.00	20241018	3,000,000	3,066,210	392,626,963
OBL 0 250411	0.00	20250411	2,100,000	2,152,874	275,674,628
OBL 0 251010	0.00	20251010	3,040,000	3,124,421	400,080,833
OBL 0 251010	0.00	20251010	300,000	308,841	39,546,966
OBL 0 260410	0.00	20260410	1,950,000	2,008,422	257,177,633
OBL 0 261009	0.00	20261009	1,450,000	1,494,704	191,396,184
RAGB 1.5 861102	1.50	20861102	290,000	387,962	49,678,378
<ユーロ・・・イタリア>	%		ユーロ	ユーロ	円
BTPS 0 240115	0.00	20240115	160,000	161,104	20,629,302
BTPS 0 240130	0.00	20240130	300,000	301,350	38,587,746
BTPS 0 240415	0.00	20240415	1,400,000	1,407,980	180,291,275
BTPS 0 240815	0.00	20240815	1,110,000	1,114,218	142,675,168
BTPS 0 260401	0.00	20260401	800,000	795,120	101,814,797
BTPS 0 260801	0.00	20260801	1,040,000	1,030,328	131,933,088
BTPS 0.25 280315	0.25	20280315	1,430,000	1,410,695	180,638,930
BTPS 0.3 230815	0.30	20230815	2,200,000	2,228,160	285,314,996
BTPS 0.35 250201	0.35	20250201	1,860,000	1,886,598	241,578,118
BTPS 0.5 260201	0.50	20260201	2,280,000	2,319,524	297,014,094
BTPS 0.5 280715	0.50	20280715	800,000	798,560	102,255,288
BTPS 0.6 230615	0.60	20230615	150,000	152,610	19,541,649
BTPS 0.6 310801	0.60	20310801	2,700,000	2,617,650	335,189,034
BTPS 0.65 231015	0.65	20231015	2,300,000	2,345,310	300,316,006
BTPS 0.85 270115	0.85	20270115	2,800,000	2,884,700	369,384,680
BTPS 0.9 310401	0.90	20310401	2,050,000	2,052,378	262,806,181
BTPS 0.95 230301	0.95	20230301	2,370,000	2,412,897	308,970,495
BTPS 0.95 230315	0.95	20230315	2,170,000	2,210,037	282,994,289
BTPS 0.95 270915	0.95	20270915	2,800,000	2,890,440	370,119,685
BTPS 0.95 300801	0.95	20300801	2,300,000	2,329,900	298,342,762
BTPS 0.95 311201	0.95	20311201	1,590,000	1,586,025	203,089,866
BTPS 0.95 370301	0.95	20370301	1,060,000	1,001,806	128,280,857
BTPS 1.25 261201	1.25	20261201	2,020,000	2,124,838	272,084,655
BTPS 1.35 300401	1.35	20300401	2,640,000	2,768,040	354,446,414
BTPS 1.45 241115	1.45	20241115	2,130,000	2,229,897	285,537,418
BTPS 1.45 250515	1.45	20250515	300,000	315,300	40,374,038
BTPS 1.45 360301	1.45	20360301	1,820,000	1,861,314	238,340,512
BTPS 1.5 250601	1.50	20250601	2,750,000	2,899,289	371,252,828
BTPS 1.5 450430	1.50	20450430	600,000	579,000	74,140,718
BTPS 1.6 260601	1.60	20260601	3,090,000	3,292,395	421,589,862
BTPS 1.65 301201	1.65	20301201	2,300,000	2,460,552	315,072,634
BTPS 1.65 320301	1.65	20320301	2,960,000	3,151,216	403,511,947
BTPS 1.7 510901	1.70	20510901	1,260,000	1,225,387	156,910,256
BTPS 1.75 240701	1.75	20240701	2,110,000	2,216,450	283,815,471
BTPS 1.8 410301	1.80	20410301	1,300,000	1,345,500	172,290,736
BTPS 1.85 240515	1.85	20240515	2,700,000	2,839,320	363,573,789
BTPS 1.85 250701	1.85	20250701	780,000	832,026	106,540,596
BTPS 2 251201	2.00	20251201	2,700,000	2,912,220	372,908,605
BTPS 2 280201	2.00	20280201	3,130,000	3,433,297	439,632,306
BTPS 2.05 270801	2.05	20270801	2,600,000	2,848,820	364,790,260
BTPS 2.1 260715	2.10	20260715	2,160,000	2,353,320	301,341,684
BTPS 2.15 720301	2.15	20720301	290,000	281,010	35,983,218
BTPS 2.2 270601	2.20	20270601	2,500,000	2,759,000	353,288,845
BTPS 2.25 360901	2.25	20360901	1,580,000	1,775,604	227,365,381
BTPS 2.45 231001	2.45	20231001	2,500,000	2,629,750	336,738,435
BTPS 2.45 330901	2.45	20330901	2,370,000	2,716,731	347,876,317
BTPS 2.45 500901	2.45	20500901	1,780,000	2,024,572	259,245,634
BTPS 2.5 241201	2.50	20241201	2,840,000	3,064,360	392,390,071
BTPS 2.5 251115	2.50	20251115	2,230,000	2,448,317	313,506,012
BTPS 2.7 470301	2.70	20470301	2,010,000	2,401,749	307,542,998
BTPS 2.8 281201	2.80	20281201	2,500,000	2,889,500	369,999,318
BTPS 2.8 670301	2.80	20670301	1,050,000	1,206,555	154,498,884
BTPS 2.95 380901	2.95	20380901	1,880,000	2,306,384	295,331,548
BTPS 3 290801	3.00	20290801	2,500,000	2,940,750	376,561,860
BTPS 3.1 400301	3.10	20400301	1,620,000	2,029,860	259,922,760
BTPS 3.25 460901	3.25	20460901	1,830,000	2,386,686	305,614,187
BTPS 3.35 350301	3.35	20350301	1,700,000	2,132,990	273,128,515
BTPS 3.45 480301	3.45	20480301	1,770,000	2,389,500	305,974,518

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
BTPS 3.5 300301	3.50	20300301	3,020,000	3,703,124	474,183,546
BTPS 3.75 240901	3.75	20240901	2,650,000	2,935,405	375,877,435
BTPS 3.85 490901	3.85	20490901	1,700,000	2,453,440	314,162,010
BTPS 4 370201	4.00	20370201	2,440,000	3,324,988	425,763,382
BTPS 4.5 230501	4.50	20230501	2,570,000	2,753,868	352,631,705
BTPS 4.5 240301	4.50	20240301	3,550,000	3,932,690	503,579,380
BTPS 4.5 260301	4.50	20260301	3,160,000	3,754,080	480,708,441
BTPS 4.75 230801	4.75	20230801	3,430,000	3,731,497	477,816,697
BTPS 4.75 280901	4.75	20280901	2,690,000	3,447,504	441,451,507
BTPS 4.75 440901	4.75	20440901	2,130,000	3,386,700	433,665,579
BTPS 5 250301	5.00	20250301	3,050,000	3,557,215	455,499,957
BTPS 5 340801	5.00	20340801	2,800,000	4,060,000	519,881,375
BTPS 5 390801	5.00	20390801	2,610,000	4,029,318	515,952,557
BTPS 5 400901	5.00	20400901	2,660,000	4,179,126	535,135,411
BTPS 5.5 221101	5.50	20221101	2,000,000	2,110,440	270,240,997
BTPS 5.75 330201	5.75	20330201	2,730,000	4,090,905	523,838,748
BTPS 7.25 261101	7.25	20261101	300,000	404,310	51,771,733
BTPS 9 231101	9.00	20231101	500,000	590,310	75,588,959
ITALY	6.00	20310501	2,850,000	4,181,805	535,478,456
ITALY 5.25%291101	5.25	20291101	3,120,000	4,238,520	542,740,789
ITALY 6.5% 271101	6.50	20271101	2,670,000	3,625,860	464,289,921
<ユーロ・・・オランダ>	%		ユーロ	ユーロ	円
NETHER 0 240115	0.00	20240115	2,280,000	2,316,808	296,666,378
NETHER 0 290115	0.00	20290115	340,000	347,908	44,549,487
NETHER 0 300715	0.00	20300715	350,000	357,828	45,819,753
NETHER 0 310715	0.00	20310715	500,000	508,505	65,113,861
NETHER 0 380115	0.00	20380115	270,000	267,680	34,276,268
NETHER 0 520115	0.00	20520115	1,120,000	1,069,166	136,906,252
NETHER 0.25 250715	0.25	20250715	2,030,000	2,099,223	268,804,665
NETHER 0.25 290715	0.25	20290715	1,740,000	1,812,906	232,141,887
NETHER 0.5 260715	0.50	20260715	2,980,000	3,133,023	401,182,341
NETHER 0.5 400115	0.50	20400115	1,540,000	1,677,237	214,769,480
NETHER 0.75 270715	0.75	20270715	1,860,000	1,993,890	255,316,847
NETHER 0.75 280715	0.75	20280715	2,040,000	2,201,160	281,857,657
NETHER 1.75 230715	1.75	20230715	2,120,000	2,209,443	282,918,266
NETHER 2 240715	2.00	20240715	1,780,000	1,912,788	244,931,737
NETHER 2.5 330115	2.50	20330115	2,350,000	3,037,822	388,991,827
NETHER 2.75 470115	2.75	20470115	2,330,000	3,896,927	498,999,895
NETHER 3.75 230115	3.75	20230115	900,000	946,440	121,191,263
NETHER 3.75 420115	3.75	20420115	2,080,000	3,637,250	465,748,437
NETHER 4 370115	4.00	20370115	1,680,000	2,707,488	346,692,754
NETHER 5.5 280115	5.50	20280115	1,800,000	2,470,680	316,369,585
<ユーロ・・・オーストリア>	%		ユーロ	ユーロ	円
RAGB 0 230420	0.00	20230420	900,000	908,997	116,396,740
RAGB 0 230715	0.00	20230715	980,000	992,054	127,032,117
RAGB 0 240715	0.00	20240715	150,000	152,685	19,551,253
RAGB 0 250420	0.00	20250420	200,000	204,071	26,131,184
RAGB 0 300220	0.00	20300220	1,240,000	1,254,765	160,672,115
RAGB 0 310220	0.00	20310220	550,000	553,098	70,824,018
RAGB 0 401020	0.00	20401020	530,000	495,073	63,393,899
RAGB 0.25 361020	0.25	20361020	250,000	249,635	31,965,698
RAGB 0.5 270420	0.50	20270420	1,100,000	1,157,644	148,235,902
RAGB 0.5 290220	0.50	20290220	1,600,000	1,686,880	216,004,308
RAGB 0.75 261020	0.75	20261020	1,400,000	1,488,340	190,581,341
RAGB 0.75 280220	0.75	20280220	1,530,000	1,636,817	209,593,755
RAGB 0.75 510320	0.75	20510320	510,000	544,897	69,773,810
RAGB 0.85 200630	0.85	21200630	270,000	253,768	32,494,908
RAGB 1.2 251020	1.20	20251020	1,680,000	1,800,078	230,499,267
RAGB 1.5 470220	1.50	20470220	800,000	1,005,920	128,807,653
RAGB 1.65 241021	1.65	20241021	1,600,000	1,710,714	219,056,191
RAGB 1.75 231020	1.75	20231020	1,600,000	1,677,336	214,782,203
RAGB 2.1 170920	2.10	21170920	740,000	1,225,917	156,978,124
RAGB 2.4 340523	2.40	20340523	1,050,000	1,351,983	173,120,847
RAGB 3.15 440620	3.15	20440620	810,000	1,310,743	167,840,144
RAGB 3.4 221122	3.40	20221122	1,000,000	1,040,037	133,176,321
RAGB 3.8 620126	3.80	20620126	490,000	1,048,351	134,240,873
RAGB 4.15 370315	4.15	20370315	1,570,000	2,517,135	322,318,189
RAGB 4.85 260315	4.85	20260315	1,370,000	1,693,046	216,793,862
RAGB 6.25 270715	6.25	20270715	890,000	1,234,541	158,082,512
<ユーロ・・・アイルランド>	%		ユーロ	ユーロ	円
IRISH 0 311018	0.00	20311018	690,000	678,123	86,833,382
IRISH 0.2 270515	0.20	20270515	300,000	308,458	39,497,872
IRISH 0.2 301018	0.20	20301018	400,000	405,644	51,942,500
IRISH 0.4 350515	0.40	20350515	650,000	653,511	83,681,860
IRISH 0.55 410422	0.55	20410422	230,000	229,182	29,346,619
IRISH 0.9 280515	0.90	20280515	1,090,000	1,167,094	149,445,858
IRISH 1 260515	1.00	20260515	1,450,000	1,546,415	198,017,802
IRISH 1.1 290515	1.10	20290515	1,420,000	1,544,090	197,720,047

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	邦貨建金額
IRISH 1.3 330515	1.30	20330515	600,000	670,755	85,889,909
IRISH 1.35 310318	1.35	20310318	770,000	862,355	110,424,256
IRISH 1.5 500515	1.50	20500515	970,000	1,142,079	146,242,755
IRISH 1.7 370515	1.70	20370515	720,000	856,080	109,620,701
IRISH 2 450218	2.00	20450218	1,020,000	1,326,844	169,901,784
IRISH 2.4 300515	2.40	20300515	900,000	1,086,242	139,092,904
IRISH 3.4 240318	3.40	20240318	1,040,000	1,138,647	145,803,228
IRISH 3.9 230320	3.90	20230320	640,000	678,241	86,848,442
IRISH 5.4 250313	5.40	20250313	1,370,000	1,642,182	210,280,749
<ユーロ・・・スペイン>	%		ユーロ	ユーロ	円
SPGB 0 230430	0.00	20230430	2,090,000	2,111,109	270,326,662
SPGB 0 240531	0.00	20240531	1,560,000	1,578,864	202,172,881
SPGB 0 250131	0.00	20250131	2,650,000	2,688,293	344,234,778
SPGB 0 260131	0.00	20260131	2,270,000	2,297,921	294,247,864
SPGB 0 270131	0.00	20270131	200,000	201,520	25,804,555
SPGB 0 280131	0.00	20280131	1,090,000	1,088,311	139,357,723
SPGB 0.1 310430	0.10	20310430	2,040,000	1,985,940	254,298,822
SPGB 0.25 240730	0.25	20240730	580,000	591,513	75,743,002
SPGB 0.35 230730	0.35	20230730	2,600,000	2,642,934	338,426,615
SPGB 0.45 221031	0.45	20221031	1,920,000	1,937,280	248,067,928
SPGB 0.5 300430	0.50	20300430	2,700,000	2,762,921	353,790,902
SPGB 0.5 311031	0.50	20311031	1,780,000	1,792,788	229,565,815
SPGB 0.6 291031	0.60	20291031	2,100,000	2,175,065	278,516,138
SPGB 0.8 270730	0.80	20270730	1,900,000	1,990,915	254,935,868
SPGB 0.85 370730	0.85	20370730	620,000	619,180	79,285,717
SPGB 1 420730	1.00	20420730	110,000	109,582	14,031,931
SPGB 1 501031	1.00	20501031	1,910,000	1,802,891	230,859,473
SPGB 1.2 401031	1.20	20401031	1,960,000	2,035,683	260,668,424
SPGB 1.25 301031	1.25	20301031	2,500,000	2,709,250	346,918,378
SPGB 1.3 261031	1.30	20261031	3,100,000	3,339,708	427,648,208
SPGB 1.4 280430	1.40	20280430	2,520,000	2,748,733	351,974,140
SPGB 1.4 280730	1.40	20280730	2,700,000	2,950,560	377,818,027
SPGB 1.45 271031	1.45	20271031	2,790,000	3,045,006	389,911,799
SPGB 1.45 290430	1.45	20290430	2,650,000	2,915,869	373,375,884
SPGB 1.45 711031	1.45	20711031	400,000	365,632	46,819,031
SPGB 1.5 270430	1.50	20270430	2,670,000	2,913,638	373,090,115
SPGB 1.6 250430	1.60	20250430	2,640,000	2,826,569	361,941,003
SPGB 1.85 350730	1.85	20350730	2,640,000	3,034,009	388,503,694
SPGB 1.95 260430	1.95	20260430	2,470,000	2,717,104	347,924,046
SPGB 1.95 300730	1.95	20300730	2,770,000	3,176,148	406,704,541
SPGB 2.15 251031	2.15	20251031	2,820,000	3,093,258	396,090,448
SPGB 2.35 330730	2.35	20330730	2,200,000	2,641,100	338,191,798
SPGB 2.7 481031	2.70	20481031	1,760,000	2,387,797	305,756,486
SPGB 2.75 241031	2.75	20241031	3,100,000	3,400,616	435,447,556
SPGB 2.9 461031	2.90	20461031	1,910,000	2,657,053	340,234,518
SPGB 3.45 660730	3.45	20660730	1,770,000	2,778,652	355,805,302
SPGB 3.8 240430	3.80	20240430	2,200,000	2,434,300	311,711,140
SPGB 4.2 370131	4.20	20370131	2,230,000	3,348,401	428,761,376
SPGB 4.4 231031	4.40	20231031	2,520,000	2,767,131	354,330,063
SPGB 4.65 250730	4.65	20250730	2,780,000	3,300,622	422,643,290
SPGB 4.7 410730	4.70	20410730	2,300,000	3,872,239	495,838,603
SPGB 4.8 240131	4.80	20240131	2,080,000	2,327,133	297,988,464
SPGB 4.9 400730	4.90	20400730	2,100,000	3,568,383	456,930,015
SPGB 5.15 281031	5.15	20281031	1,930,000	2,610,808	334,312,855
SPGB 5.15 441031	5.15	20441031	1,870,000	3,454,262	442,316,883
SPGB 5.4 230131	5.40	20230131	2,160,000	2,312,490	296,113,357
SPGB 5.75 320730	5.75	20320730	2,670,000	4,157,190	532,326,515
SPGB 5.9 260730	5.90	20260730	2,800,000	3,615,856	463,008,862
SPGB 6 290131	6.00	20290131	1,460,000	2,087,639	267,321,389
<ユーロ・・・フィンランド>	%		ユーロ	ユーロ	円
RFGB 0 230915	0.00	20230915	800,000	810,344	103,764,224
RFGB 0 260915	0.00	20260915	100,000	102,310	13,100,754
RFGB 0 300915	0.00	20300915	650,000	657,930	84,247,673
RFGB 0.125 310915	0.13	20310915	100,000	101,732	13,026,793
RFGB 0.125 360415	0.13	20360415	470,000	465,653	59,626,736
RFGB 0.125 520415	0.13	20520415	430,000	399,109	51,105,722
RFGB 0.25 400915	0.25	20400915	200,000	199,623	25,561,619
RFGB 0.5 260415	0.50	20260415	850,000	891,136	114,109,576
RFGB 0.5 270915	0.50	20270915	840,000	885,444	113,380,749
RFGB 0.5 280915	0.50	20280915	830,000	876,148	112,190,400
RFGB 0.5 290915	0.50	20290915	700,000	741,343	94,928,636
RFGB 0.75 310415	0.75	20310415	550,000	595,057	76,196,823
RFGB 0.875 250915	0.88	20250915	730,000	772,621	98,933,816
RFGB 1.125 340415	1.13	20340415	730,000	824,852	105,621,945
RFGB 1.375 470415	1.38	20470415	430,000	544,657	69,743,155
RFGB 1.5 230415	1.50	20230415	480,000	495,405	63,436,365
RFGB 2 240415	2.00	20240415	800,000	852,720	109,190,454
RFGB 2.625 420704	2.63	20420704	670,000	993,725	127,246,119
RFGB 4 250704	4.00	20250704	790,000	924,735	118,411,882

<注>邦貨換算額は、期末の時価を期末日のロンドン16:00のスポットレートにより、邦貨換算したものです。

年金投資基金信託

外国債券マザーファンド

運用状況のご報告

決算日 2021年2月28日 (計算期間 2020年3月1日～2021年2月28日)

1. 最近5期の運用実績

決算日	基準価格	税込み分配金	期中騰落率	ベンチマーク 騰落率	債券組入 比率	債券先物 組入比率	純資産総額
	円	円	%	%	%	%	百万円
2017年2月28日	21,219	0	△ 2.7	△ 2.7	99.8	0.0	192,524
2018年2月28日	21,727	0	2.4	2.4	99.4	0.0	189,633
2019年2月28日	22,444	0	3.3	3.3	100.3	0.0	247,519
2020年2月29日	23,615	0	5.2	5.2	102.2	0.0	243,760
2021年2月28日	24,427	0	3.4	3.5	99.9	0.0	250,957

<注1> 基準価格の騰落率は分配金込みです。

<注2> 債券先物比率 = 買建比率 - 売建比率。

2. 当期の基準価格の推移

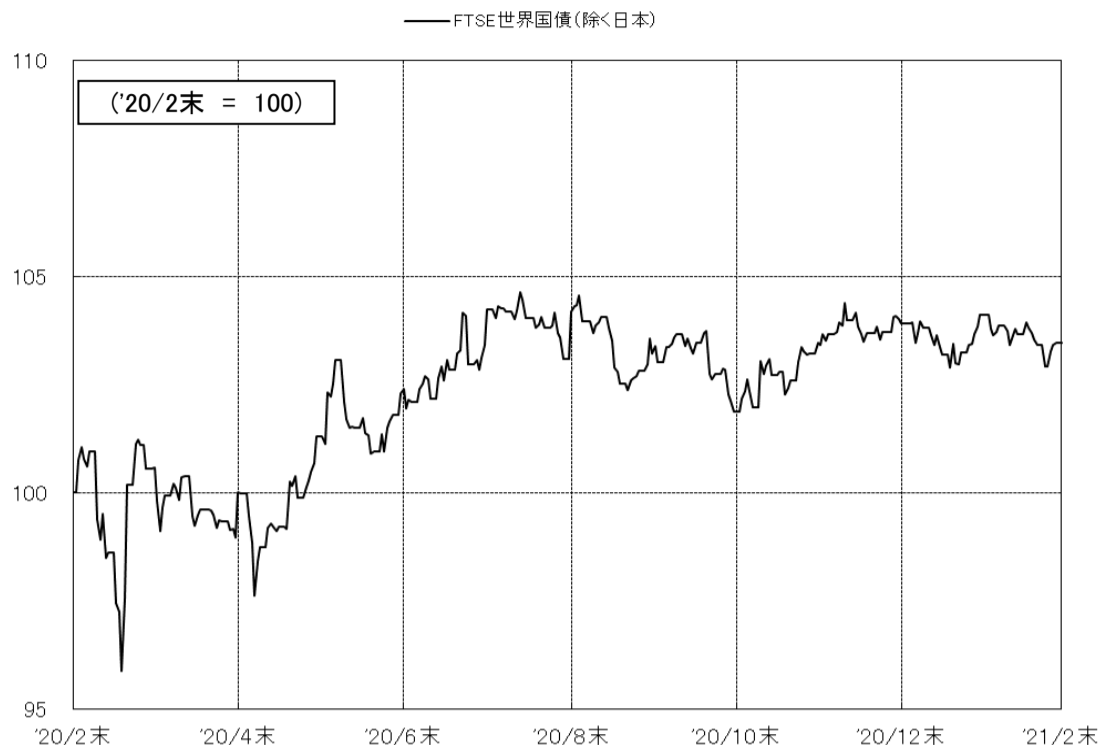
日付	基準価格	騰落率	ベンチマーク 騰落率	債券組入 比率	債券先物 組入比率
	円	%	%	%	%
(期首) 2020年2月29日	23,615	---	---	102.2	0.0
3月末	23,608	△ 0.0	△ 0.2	98.3	0.0
4月末	23,593	△ 0.1	0.0	99.6	0.0
5月末	23,915	1.3	1.3	99.8	0.0
6月末	24,169	2.3	2.4	99.9	0.0
7月末	24,592	4.1	4.2	99.3	0.0
8月末	24,582	4.1	4.2	99.7	0.0
9月末	24,363	3.2	3.2	99.8	0.0
10月末	24,039	1.8	1.9	99.8	0.0
11月末	24,424	3.4	3.5	99.8	0.0
12月末	24,524	3.8	3.9	99.8	0.0
2021年1月末	24,571	4.0	4.1	99.9	0.0
(期末) 2021年2月28日	24,427	3.4	3.5	99.9	0.0

<注1> 騰落率は期首比です。

<注2> 債券先物比率 = 買建比率 - 売建比率。

3. 当期の市場環境

FTSE世界国債インデックスの推移(円ベース)



(1) 外国債券

期を通じて利回りは、上昇しました。新型コロナウイルスの感染拡大などによるリスク回避姿勢の強まりなどを受けて低下した後、FRBによる大規模金融緩和の維持などを背景に低位での推移が続きましたが、ワクチン普及への期待、米経済対策法案の成立、経済正常化への期待などを受けて上昇基調が鮮明になりました。通期で見ると、価格は円ベースで3%超上昇しました。

(2) 為替

ドル/円レートは、期を通じてみると円高が進みました。リスク回避姿勢の強まり、米国金利の低下、米大統領選でバイデン氏が優勢と見方を受けたドル先安観の強まりなどを背景に円高ドル安基調が続きましたが、経済対策が大規模になるとの観測や経済正常化への期待などを受けて米国金利が上昇したことから円安ドル高に転じ、期末には106円台に至りました。

4. 外国債券マザーファンドの運用総括と今後の運用方針

(1) 基準価格

当ファンドは、FTSE世界国債インデックスをベンチマークとし、通貨構成等をベンチマークに合わせ最適化法を用いて銘柄を選択することによって、基準価格の騰落がベンチマークの騰落に連動することを目指すインデックスファンドです。また、当ファンドは為替ヘッジはいたしません。

期を通して純資産総額のほぼ100%をベンチマーク構成銘柄に投資いたしました。ベンチマーク構成国への投資を継続し、基準価格の騰落は概ねベンチマークに連動いたしました。

(2) 収益分配金

内部留保を図ることを重視し、収益分配は実施いたしませんでした。

(3) 今後の運用方針

今後も上述の運用を継続し、ベンチマークへの連動を目指します。

5. 信託財産の構成、貸借対照表、損益計算書

(1) 信託財産の構成

(2021年2月28日現在)

項目	評価額	比率
	千円	%
外国債券	248,901,088	97.3
銀行勘定貸、その他	6,904,558	2.6
信託財産総額	255,805,647	99.9
純資産総額	250,957,289	---

<注1> 単位未満は切捨としています。比率は信託財産総額に対する割合です。

<注2> 外貨建資産は当期末の時価をロンドン16:00のスポットレートにて邦貨換算したものです。□

なお、当期末における邦貨換算レートは次のとおりです。

1米ドル=106.54円、1英ポンド=148.95円、1カナダドル=84.15円、1オーストラリアドル=82.48円、1デンマーククローネ=17.39円、1スウェーデンクローナ=12.68円、1マレーシアリングギ=26.32円、1ノルウェークローネ=12.37円、1シンガポールドル=80.12円、1メキシコペソ=5.10円、1ポーランドズロティ=28.60円、1ユーロ=129.32円、1イスラエルシェケル=32.16円

<注3> 当ファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(250,743,534千円)の純資産総額(250,957,289千円)に対する比率は99.9%です。

<注4> 当ファンドにおいて、当期末における外国為替の予約に係る未決済残高は、買残高が、502米ドル、2,711ユーロ、売残高が、223英ポンド、8,624オーストラリアドルです。

(2) 資産、負債、元本および基準価格の状況

項目	今期末 (2020年2月29日)	今期末 (2021年2月28日)
(A) 資産	253,217,597,364 円	255,805,647,427 円
外国債券	247,299,862,943	248,901,088,569
外貨預け金	475,252,640	344,489,032
銀行勘定貸	235,887,765	213,755,020
既経過利息前払金	88,770,010	49,447,462
未収債券利息	1,683,663,891	1,631,849,338
未収金	3,453,447,681	4,664,883,471
その他	△ 19,287,566	134,535
(B) 負債	9,458,009,490 円	4,848,358,308 円
未払金	9,458,009,490	4,848,358,308
その他未払費用	0	0
(C) 純資産総額(A-B)	243,759,587,874 円	250,957,289,119 円
元本	103,220,330,000	102,739,610,000
分配準備積立金	140,539,257,874	148,217,679,119
(D) 受益権総口数	10,322,033 口	10,273,961 口
1口あたり基準価格(C/D)	23,615 円	24,427 円

(3) 損益の状況

項目	前期 (2020年2月29日決算)	今期 (2021年2月28日決算)
(A) 利配当等収益	5,671,694,909 円	4,973,764,353 円
外国債券利息	5,724,250,930	5,023,883,006
外貨預け金利息	861,155	766,543
銀行勘定貸利息	0	0
その他	△ 53,417,176	△ 50,885,196
(B) 売買損益等	7,086,466,301 円	3,198,887,831 円
有価証券売却損益	△ 303,469,348	1,293,962,023
有価証券償還損益	0	0
有価証券評価損益	7,591,781,941	2,023,194,961
その他	△ 201,846,292	△ 118,269,153
(C) 当期利益 (A+B)	12,758,161,210 円	8,172,652,184 円
(D) 信託財産留保金	34,072,136 円	25,769,400 円
(E) 収益調整金	△ 9,491,378,589 円	△ 520,000,339 円
(F) 前期繰越損益	137,238,403,117 円	140,539,257,874 円
分配準備積立金	137,238,403,117	140,539,257,874
(G) 当期末処分利益 (C+D+E+F)	140,539,257,874 円	148,217,679,119 円
<利益処分>		
(H) 収益分配金	0 円	0 円
(I) 次期繰越損益 (G-H)	140,539,257,874 円	148,217,679,119 円
分配準備積立金	140,539,257,874	148,217,679,119

<注1> 損益の状況の中で(E)収益調整金とあるのは、信託の追加または解約の設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

<注2> 当ファンドの期中追加設定元本額は 31,971,390,000円、期中一部解約元本額は 32,452,110,000円です。

6. 1口当たりの費用の明細

項目	金額
(a) 売買委託手数料 (債券)	0 円 (0 円)
(先物・オプション)	(0 円)
(b) 有価証券取引税 (債券)	0 円 (0 円)
(c) 保管費用等	5 円
合計	5 円

<注1>

期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、(a)売買委託手数料、(b)有価証券取引税、(c)保管費用等は期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

<注2>

各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

7. 売買及び取引の状況

(2020年3月1日～2021年2月28日)

(1) 債券

公社債		買付額	売付額
アメリカ	国債証券	千米ドル 382,850	千米ドル 466,845
イギリス	国債証券	千英ポンド 39,146	千英ポンド 33,852
カナダ	国債証券	千カナダドル 29,321	千カナダドル 27,983
オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 41,974	千オーストラリアドル 33,526
デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 27,320	千デンマーククローネ 25,866
スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 20,406	千スウェーデンクローナ 12,559
マレーシア	国債証券	千マレーシアリング 13,837	千マレーシアリング 12,036
ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 20,730	千ノルウェークローネ 22,502
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 4,883	千シンガポールドル 4,186
メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 140,683	千メキシコペソ 148,066
イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 36,570	千イスラエルシェケル 485
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 0	千南アフリカランド 171,420
ポーランド	国債証券	千ポーランドズロティ 27,145	千ポーランドズロティ 21,965
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
ベルギー	国債証券	15,784	14,403
フランス	国債証券	77,230	66,697
ドイツ	国債証券	79,659	53,244
イタリア	国債証券	71,103	69,938
オランダ	国債証券	16,088	15,435
オーストリア	国債証券	9,687	7,579
アイルランド	国債証券	5,482	2,907
スペイン	国債証券	50,591	44,710
フィンランド	国債証券	4,076	2,818

<注>単位未満は切捨としています。金額は受渡金額(経過利子分は含まず)です。

(2) 先物取引の種類別取引状況

	買 建		売 建	
	新規買付額	決済額	新規買付額	決済額
債券先物取引	百万円 0	百万円 0	百万円 0	百万円 0

<注>単位未満は切捨としています。

8. 組入資産明細表

■外国(外貨建)公社債

(1)種類別

区分	額面金額	外貨建金額	邦貨換算額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
						5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 958,180	千米ドル 1,013,164	千円 107,942,472	43.0	-	18.7	17.3	7.0
イギリス	千英ポンド 89,530	千英ポンド 111,118	千円 16,551,370	6.6	-	4.9	1.1	0.6
カナダ	千カナダドル 53,960	千カナダドル 58,397	千円 4,914,390	2.0	-	0.9	0.8	0.3
オーストラリア	千オーストラリアドル 64,760	千オーストラリアドル 68,411	千円 5,642,750	2.2	-	1.6	0.4	0.2
デンマーク	千デンマーククローネ 58,640	千デンマーククローネ 73,443	千円 1,277,231	0.5	-	0.3	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 61,330	千スウェーデンクローナ 66,738	千円 846,451	0.3	-	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリングギ 43,550	千マレーシアリングギ 46,134	千円 1,214,369	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 47,810	千ノルウェークローネ 49,369	千円 610,745	0.2	-	0.1	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 12,390	千シンガポールドル 13,640	千円 1,092,858	0.4	-	0.3	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 347,890	千メキシコペソ 385,306	千円 1,963,153	0.8	-	0.4	0.3	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 30,830	千イスラエルシェケル 34,675	千円 1,115,172	0.4	-	0.2	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロティ 53,790	千ポーランドズロティ 57,936	千円 1,657,125	0.7	-	0.3	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
小計	676,030	804,782	104,073,003	41.5	-	27.2	10.8	3.5
ベルギー	40,170	49,033	6,340,877	2.5	-	1.9	0.4	0.2
フランス	172,690	205,635	26,592,342	10.6	-	7.1	2.6	0.9
ドイツ	126,300	148,912	19,257,104	7.7	-	4.6	2.4	0.7
イタリア	158,390	188,010	24,313,184	9.7	-	6.1	2.6	1.0
オランダ	30,950	37,145	4,803,550	1.9	-	1.3	0.5	0.1
オーストリア	24,380	29,532	3,819,045	1.5	-	1.0	0.3	0.1
アイルランド	14,910	16,852	2,179,214	0.9	-	0.6	0.2	0.1
スペイン	96,730	117,060	15,138,043	6.0	-	4.1	1.5	0.4
フィンランド	11,510	12,602	1,629,646	0.6	-	0.4	0.2	0.1
合計	---	---	千円 248,901,089	99.2	---	55.5	31.6	12.0

<注1>邦貨換算金額は、期末の時価を期末日のロンドン16:00のスポットレート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邦貨換算額の割合です。

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
<米ドル・・・米国>	%		米ドル	米ドル	円
T 0.125 230515	0.125	20230515	1,600,000	1,597,938	170,244,261
T 0.125 230815	0.125	20230815	6,600,000	6,583,758	701,433,557
T 0.125 230915	0.125	20230915	7,000,000	6,980,039	743,653,361
T 0.125 231015	0.125	20231015	6,000,000	5,980,078	637,117,522
T 0.125 231215	0.125	20231215	2,000,000	1,991,172	212,139,451
T 0.125 240115	0.125	20240115	6,000,000	5,970,234	636,068,769
T 0.125 240215	0.125	20240215	5,000,000	4,972,461	529,765,988
T 0.25 230415	0.250	20230415	5,670,000	5,679,081	605,049,274
T 0.25 230615	0.250	20230615	5,000,000	5,005,664	533,303,448
T 0.25 231115	0.250	20231115	5,300,000	5,297,309	564,375,257
T 0.25 250630	0.250	20250630	2,500,000	2,458,008	261,876,152
T 0.25 250731	0.250	20250731	5,800,000	5,697,141	606,973,362
T 0.25 250831	0.250	20250831	1,500,000	1,471,289	156,751,136
T 0.25 250930	0.250	20250930	2,000,000	1,959,688	208,785,106
T 0.25 251031	0.250	20251031	2,500,000	2,447,070	260,710,870
T 0.375 251130	0.375	20251130	3,600,000	3,540,094	377,161,588
T 0.375 251231	0.375	20251231	3,300,000	3,241,219	345,319,445
T 0.375 260131	0.375	20260131	5,000,000	4,905,469	522,628,640
T 0.5 230315	0.500	20230315	4,800,000	4,832,813	514,887,843
T 0.5 250331	0.500	20250331	6,000,000	5,977,031	636,792,909
T 0.5 270630	0.500	20270630	4,600,000	4,443,313	473,390,513
T 0.5 270831	0.500	20270831	5,000,000	4,813,672	512,848,602
T 0.5 271031	0.500	20271031	5,400,000	5,184,422	552,348,307
T 0.625 270331	0.625	20270331	5,000,000	4,889,844	520,963,953
T 0.625 271130	0.625	20271130	5,600,000	5,414,063	576,814,218
T 0.625 271231	0.625	20271231	2,000,000	1,931,094	205,738,728
T 0.625 300515	0.625	20300515	8,500,000	7,920,273	843,825,932
T 0.625 300815	0.625	20300815	6,800,000	6,319,219	673,249,565
T 0.75 280131	0.750	20280131	5,000,000	4,863,672	518,175,602
T 0.875 301115	0.875	20301115	8,500,000	8,065,039	859,249,261
T 1.125 310215	1.125	20310215	4,000,000	3,875,000	412,842,500
T 1.125 400515	1.125	20400515	3,600,000	3,049,313	324,873,753
T 1.125 400815	1.125	20400815	4,500,000	3,791,602	403,957,230
T 1.25 230731	1.250	20230731	3,710,000	3,802,460	405,114,105
T 1.25 240831	1.250	20240831	4,370,000	4,493,589	478,746,978
T 1.25 500515	1.250	20500515	6,900,000	5,477,414	583,563,693
T 1.375 221015	1.375	20221015	5,500,000	5,608,926	597,574,952
T 1.375 230215	1.375	20230215	5,000,000	5,120,117	545,497,285
T 1.375 230630	1.375	20230630	2,400,000	2,464,125	262,527,877
T 1.375 230831	1.375	20230831	3,900,000	4,011,820	427,419,335
T 1.375 230930	1.375	20230930	3,500,000	3,602,539	383,814,511
T 1.375 250131	1.375	20250131	4,300,000	4,438,742	472,903,592
T 1.375 260831	1.375	20260831	4,500,000	4,617,773	491,977,582
T 1.375 401115	1.375	20401115	1,000,000	880,938	93,855,081
T 1.375 500815	1.375	20500815	7,330,000	6,014,036	640,735,389
T 1.5 230228	1.500	20230228	5,000,000	5,133,398	546,912,269
T 1.5 230331	1.500	20230331	3,800,000	3,905,391	416,080,317
T 1.5 241130	1.500	20241130	2,500,000	2,592,383	276,192,464

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
T 1.5 260815	1.500	20260815	8,220,000	8,491,003	904,631,473
T 1.5 300215	1.500	20300215	7,900,000	7,983,320	850,542,945
T 1.625 220815	1.625	20220815	3,960,000	4,045,542	431,012,064
T 1.625 220831	1.625	20220831	6,940,000	7,097,234	756,139,350
T 1.625 221115	1.625	20221115	9,120,000	9,350,494	996,201,604
T 1.625 230430	1.625	20230430	4,300,000	4,434,039	472,402,521
T 1.625 231031	1.625	20231031	4,060,000	4,208,127	448,333,803
T 1.625 260215	1.625	20260215	7,320,000	7,627,669	812,651,828
T 1.625 260515	1.625	20260515	7,200,000	7,495,313	798,550,593
T 1.625 260930	1.625	20260930	4,250,000	4,415,684	470,446,929
T 1.625 261031	1.625	20261031	4,000,000	4,154,375	442,607,112
T 1.625 290815	1.625	20290815	6,200,000	6,353,547	676,906,884
T 1.625 501115	1.625	20501115	4,930,000	4,313,750	459,586,925
T 1.75 220228	1.750	20220228	4,210,000	4,279,399	455,927,192
T 1.75 220331	1.750	20220331	4,040,000	4,111,963	438,088,484
T 1.75 220430	1.750	20220430	3,200,000	3,260,500	347,373,670
T 1.75 220515	1.750	20220515	3,960,000	4,038,736	430,286,927
T 1.75 220531	1.750	20220531	5,790,000	5,905,800	629,203,932
T 1.75 220630	1.750	20220630	7,000,000	7,154,219	762,210,465
T 1.75 220930	1.750	20220930	6,600,000	6,768,609	721,127,643
T 1.75 230131	1.750	20230131	5,600,000	5,771,500	614,895,610
T 1.75 230515	1.750	20230515	6,820,000	7,055,503	751,693,303
T 1.75 240630	1.750	20240630	4,400,000	4,598,000	489,870,920
T 1.75 240731	1.750	20240731	4,060,000	4,244,603	452,220,017
T 1.75 241231	1.750	20241231	4,770,000	4,993,594	532,017,478
T 1.75 261231	1.750	20261231	4,000,000	4,181,250	445,470,375
T 1.75 291115	1.750	20291115	4,800,000	4,963,125	528,771,337
T 1.875 220228	1.875	20220228	4,930,000	5,017,430	534,557,042
T 1.875 220331	1.875	20220331	4,250,000	4,331,680	461,497,154
T 1.875 220430	1.875	20220430	4,400,000	4,489,719	478,334,635
T 1.875 220531	1.875	20220531	7,040,000	7,196,750	766,741,745
T 1.875 220731	1.875	20220731	5,910,000	6,055,441	645,146,727
T 1.875 220831	1.875	20220831	5,340,000	5,480,175	583,857,844
T 1.875 221031	1.875	20221031	6,210,000	6,388,052	680,583,096
T 1.875 240831	1.875	20240831	3,710,000	3,894,630	414,933,930
T 1.875 260630	1.875	20260630	3,000,000	3,161,016	336,774,605
T 1.875 260731	1.875	20260731	4,700,000	4,950,055	527,378,826
T 1.875 510215	1.875	20510215	2,140,000	1,992,541	212,285,278
T 2 220731	2.000	20220731	4,150,000	4,259,910	453,850,828
T 2 221031	2.000	20221031	5,790,000	5,970,938	636,143,681
T 2 221130	2.000	20221130	8,910,000	9,198,183	979,974,396
T 2 230215	2.000	20230215	6,710,000	6,950,616	740,518,672
T 2 240430	2.000	20240430	3,000,000	3,156,797	336,325,139
T 2 240531	2.000	20240531	5,300,000	5,578,664	594,350,868
T 2 240630	2.000	20240630	4,070,000	4,287,491	456,789,251
T 2 250215	2.000	20250215	7,470,000	7,897,774	841,428,865
T 2 250815	2.000	20250815	8,040,000	8,515,491	907,240,371
T 2 261115	2.000	20261115	7,600,000	8,051,844	857,843,433
T 2 500215	2.000	20500215	6,000,000	5,754,375	613,071,112
T 2.125 220630	2.125	20220630	4,010,000	4,116,516	438,573,575
T 2.125 221231	2.125	20221231	9,000,000	9,324,844	993,468,853

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
T 2.125 231130	2.125	20231130	3,000,000	3,152,578	335,875,673
T 2.125 240229	2.125	20240229	3,000,000	3,162,422	336,924,427
T 2.125 240331	2.125	20240331	7,300,000	7,699,789	820,335,526
T 2.125 240731	2.125	20240731	3,710,000	3,926,223	418,299,845
T 2.125 240930	2.125	20240930	4,480,000	4,747,400	505,787,996
T 2.125 241130	2.125	20241130	3,070,000	3,255,639	346,855,785
T 2.125 250515	2.125	20250515	6,770,000	7,200,001	767,088,083
T 2.125 260531	2.125	20260531	3,900,000	4,160,203	443,228,041
T 2.25 220415	2.250	20220415	4,800,000	4,915,688	523,717,346
T 2.25 231231	2.250	20231231	3,540,000	3,736,359	398,071,728
T 2.25 240131	2.250	20240131	4,070,000	4,300,527	458,178,182
T 2.25 240430	2.250	20240430	4,400,000	4,661,938	496,682,821
T 2.25 241031	2.250	20241031	4,000,000	4,259,063	453,760,518
T 2.25 241115	2.250	20241115	8,460,000	9,014,527	960,407,659
T 2.25 241231	2.250	20241231	4,000,000	4,263,125	454,193,337
T 2.25 251115	2.250	20251115	7,630,000	8,173,638	870,819,339
T 2.25 260331	2.250	20260331	4,000,000	4,291,563	457,223,068
T 2.25 270215	2.250	20270215	7,610,000	8,171,832	870,626,984
T 2.25 270815	2.250	20270815	7,420,000	7,966,645	848,766,391
T 2.25 271115	2.250	20271115	6,550,000	7,030,504	749,029,886
T 2.25 460815	2.250	20460815	3,560,000	3,603,666	383,934,536
T 2.25 490815	2.250	20490815	5,510,000	5,583,610	594,877,826
T 2.375 220315	2.375	20220315	3,000,000	3,070,664	327,148,548
T 2.375 230131	2.375	20230131	5,130,000	5,349,227	569,906,680
T 2.375 240229	2.375	20240229	3,060,000	3,247,664	346,006,128
T 2.375 240815	2.375	20240815	8,470,000	9,041,725	963,305,381
T 2.375 260430	2.375	20260430	3,900,000	4,209,867	448,519,250
T 2.375 270515	2.375	20270515	7,620,000	8,243,888	878,303,774
T 2.375 290515	2.375	20290515	5,800,000	6,287,563	669,876,908
T 2.375 491115	2.375	20491115	5,090,000	5,299,565	564,615,638
T 2.5 230331	2.500	20230331	4,640,000	4,866,200	518,444,948
T 2.5 230815	2.500	20230815	5,380,000	5,680,523	605,202,967
T 2.5 240131	2.500	20240131	4,460,000	4,745,022	505,534,631
T 2.5 240515	2.500	20240515	7,000,000	7,482,891	797,227,167
T 2.5 250131	2.500	20250131	4,600,000	4,951,109	527,491,193
T 2.5 260228	2.500	20260228	4,200,000	4,557,000	485,502,780
T 2.5 450215	2.500	20450215	4,070,000	4,322,467	460,515,654
T 2.5 460215	2.500	20460215	4,190,000	4,450,893	474,198,137
T 2.5 460515	2.500	20460515	3,900,000	4,139,180	440,988,204
T 2.625 230228	2.625	20230228	5,040,000	5,286,881	563,264,328
T 2.625 230630	2.625	20230630	3,360,000	3,550,050	378,222,327
T 2.625 231231	2.625	20231231	4,610,000	4,914,692	523,611,305
T 2.625 250331	2.625	20250331	3,850,000	4,168,527	444,114,902
T 2.625 251231	2.625	20251231	3,500,000	3,814,180	406,362,704
T 2.625 260131	2.625	20260131	4,350,000	4,743,539	505,376,651
T 2.625 290215	2.625	20290215	8,090,000	8,922,385	950,590,914
T 2.75 230430	2.750	20230430	3,100,000	3,272,438	348,645,491
T 2.75 230531	2.750	20230531	4,780,000	5,054,477	538,503,932
T 2.75 230731	2.750	20230731	4,780,000	5,072,402	540,413,662
T 2.75 230831	2.750	20230831	3,910,000	4,155,902	442,769,835
T 2.75 231115	2.750	20231115	7,100,000	7,577,031	807,256,909

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
T 2.75 240215	2.750	20240215	5,840,000	6,261,119	667,059,591
T 2.75 250630	2.750	20250630	4,000,000	4,363,750	464,913,925
T 2.75 250831	2.750	20250831	3,710,000	4,052,595	431,763,504
T 2.75 280215	2.750	20280215	8,200,000	9,079,578	967,338,253
T 2.75 420815	2.750	20420815	1,960,000	2,181,572	232,424,668
T 2.75 421115	2.750	20421115	2,920,000	3,247,359	345,973,668
T 2.75 470815	2.750	20470815	4,430,000	4,941,180	526,433,367
T 2.75 471115	2.750	20471115	4,700,000	5,243,070	558,596,710
T 2.750 250228	2.750	20250228	4,210,000	4,576,730	487,604,864
T 2.875 230930	2.875	20230930	3,540,000	3,780,333	402,756,657
T 2.875 231130	2.875	20231130	2,810,000	3,010,432	320,731,428
T 2.875 250430	2.875	20250430	3,080,000	3,369,231	358,957,897
T 2.875 250531	2.875	20250531	4,400,000	4,818,344	513,346,343
T 2.875 250731	2.875	20250731	3,600,000	3,950,719	420,909,575
T 2.875 251130	2.875	20251130	3,850,000	4,238,008	451,517,352
T 2.875 280515	2.875	20280515	6,000,000	6,702,188	714,051,056
T 2.875 280815	2.875	20280815	7,620,000	8,521,898	907,923,059
T 2.875 430515	2.875	20430515	3,700,000	4,200,656	447,537,916
T 2.875 450815	2.875	20450815	3,570,000	4,056,413	432,170,187
T 2.875 461115	2.875	20461115	3,300,000	3,756,328	400,199,198
T 2.875 490515	2.875	20490515	6,200,000	7,119,828	758,546,488
T 3 250930	3.000	20250930	3,410,000	3,764,853	401,107,452
T 3 251031	3.000	20251031	4,310,000	4,764,907	507,653,194
T 3 420515	3.000	20420515	2,050,000	2,372,074	252,720,787
T 3 441115	3.000	20441115	3,470,000	4,017,609	428,036,103
T 3 450515	3.000	20450515	2,500,000	2,900,000	308,966,000
T 3 451115	3.000	20451115	1,300,000	1,509,219	160,792,165
T 3 470215	3.000	20470215	3,300,000	3,846,820	409,840,235
T 3 470515	3.000	20470515	2,700,000	3,149,930	335,593,509
T 3 480215	3.000	20480215	4,400,000	5,145,594	548,211,558
T 3 480815	3.000	20480815	6,300,000	7,382,320	786,512,405
T 3 490215	3.000	20490215	5,700,000	6,690,820	712,839,995
T 3.125 281115	3.125	20281115	7,970,000	9,068,366	966,143,674
T 3.125 411115	3.125	20411115	1,440,000	1,699,425	181,056,739
T 3.125 420215	3.125	20420215	2,120,000	2,503,588	266,732,212
T 3.125 430215	3.125	20430215	2,900,000	3,424,266	364,821,260
T 3.125 440815	3.125	20440815	3,900,000	4,607,484	490,881,385
T 3.125 480515	3.125	20480515	5,440,000	6,506,750	693,229,145
T 3.375 440515	3.375	20440515	3,700,000	4,543,773	484,093,622
T 3.375 481115	3.375	20481115	5,800,000	7,272,203	774,780,521
T 3.5 390215	3.500	20390215	1,470,000	1,823,259	194,250,054
T 3.625 430815	3.625	20430815	3,080,000	3,920,744	417,716,039
T 3.625 440215	3.625	20440215	3,680,000	4,688,838	499,548,747
T 3.75 431115	3.750	20431115	3,170,000	4,109,113	437,784,845
T 3.875 400815	3.875	20400815	2,900,000	3,781,102	402,838,560
T 4.25 390515	4.250	20390515	1,620,000	2,198,264	234,203,052
T 4.25 401115	4.250	20401115	1,500,000	2,050,430	218,452,779
T 4.375 391115	4.375	20391115	2,460,000	3,394,223	361,620,565
T 4.375 400515	4.375	20400515	2,170,000	3,004,941	320,146,457
T 4.375 410515	4.375	20410515	1,740,000	2,421,319	257,967,299
T 4.5 360215	4.500	20360215	2,000,000	2,727,188	290,554,556

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
T 4.5 380515	4.500	20380515	1,600,000	2,219,125	236,425,577
T 4.5 390815	4.500	20390815	2,500,000	3,496,289	372,494,636
T 4.625 400215	4.625	20400215	2,450,000	3,487,422	371,549,927
T 4.75 410215	4.750	20410215	1,000,000	1,454,922	155,007,377
T 5 370515	5.000	20370515	1,050,000	1,520,203	161,962,441
T 5.25 290215	5.250	20290215	2,630,000	3,431,328	365,573,698
T 5.375 310215	5.375	20310215	1,120,000	1,536,588	163,708,032
T 6 260215	6.000	20260215	1,490,000	1,871,696	199,410,501
T 6.25 300515	6.250	20300515	1,010,000	1,442,091	153,640,335
US.T.B 5.5% 280815	5.500	20280815	2,720,000	3,558,950	379,170,533
<英ポンド・・・英国>	%		英ポンド	英ポンド	円
UKT 0.125 240131	0.125	20240131	500,000	498,910	74,314,427
UKT 0.125 260130	0.125	20260130	1,830,000	1,807,070	269,169,549
UKT 0.125 280131	0.125	20280131	500,000	483,868	72,073,823
UKT 0.25 310731	0.250	20310731	900,000	840,735	125,230,483
UKT 0.375 301022	0.375	20301022	2,210,000	2,117,401	315,394,446
UKT 0.5 220722	0.500	20220722	3,600,000	3,623,904	539,793,452
UKT 0.625 250607	0.625	20250607	1,600,000	1,623,825	241,874,483
UKT 0.625 350731	0.625	20350731	1,400,000	1,297,912	193,328,631
UKT 0.75 230722	0.750	20230722	2,120,000	2,152,500	320,622,508
UKT 0.875 291022	0.875	20291022	2,200,000	2,222,462	331,043,657
UKT 1 240422	1.000	20240422	4,630,000	4,751,399	707,737,802
UKT 1.25 270722	1.250	20270722	2,570,000	2,687,942	400,378,633
UKT 1.25 411022	1.250	20411022	950,000	934,373	139,178,123
UKT 1.5 260722	1.500	20260722	2,160,000	2,284,526	340,288,336
UKT 1.5 470722	1.500	20470722	2,500,000	2,574,225	383,440,014
UKT 1.625 281022	1.625	20281022	2,250,000	2,416,549	359,953,550
UKT 1.625 711022	1.625	20711022	1,220,000	1,411,015	210,175,786
UKT 1.75 220907	1.750	20220907	3,370,000	3,457,592	515,020,740
UKT 1.75 370907	1.750	20370907	2,770,000	2,986,725	444,883,333
UKT 1.75 490122	1.750	20490122	1,050,000	1,144,038	170,408,548
UKT 1.75 570722	1.750	20570722	2,300,000	2,579,680	384,252,555
UKT 2 250907	2.000	20250907	2,900,000	3,119,884	464,717,842
UKT 2.25 230907	2.250	20230907	3,020,000	3,180,568	473,756,964
UKT 2.5 650722	2.500	20650722	2,620,000	3,689,248	549,526,704
UKT 3.25 440122	3.250	20440122	2,670,000	3,669,921	546,647,910
UKT 3.5 450122	3.500	20450122	2,630,000	3,777,938	562,737,435
UKT 3.5 680722	3.500	20680722	1,990,000	3,563,274	530,762,412
UKT 3.75 520722	3.750	20520722	1,920,000	3,095,635	461,105,926
UKT 4 220307	4.000	20220307	2,150,000	2,237,307	333,254,839
UKT 4 600122	4.000	20600122	1,820,000	3,312,345	493,385,685
UKT 4.25 271207	4.250	20271207	1,460,000	1,819,541	271,027,100
UKT 4.25 320607	4.250	20320607	2,060,000	2,792,206	415,909,122
UKT 4.25 360307	4.250	20360307	2,150,000	3,072,673	457,685,550
UKT 4.25 390907	4.250	20390907	1,580,000	2,366,953	352,566,080
UKT 4.25 401207	4.250	20401207	1,630,000	2,476,182	368,836,143
UKT 4.25 461207	4.250	20461207	1,900,000	3,093,086	460,726,214
UKT 4.25 491207	4.250	20491207	1,840,000	3,105,994	462,648,847
UKT 4.25 551207	4.250	20551207	2,140,000	3,869,313	576,347,940
UKT 4.5 340907	4.500	20340907	1,600,000	2,292,560	341,485,005
UKT 4.5 421207	4.500	20421207	2,370,000	3,795,768	565,393,254

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
UKT 4.75 301207	4.750	20301207	2,350,000	3,218,089	479,345,796
UKT 4.75 381207	4.750	20381207	1,600,000	2,506,848	373,403,969
UKT 5 250307	5.000	20250307	1,600,000	1,902,995	283,457,936
UKT 6 281207	6.000	20281207	900,000	1,262,664	188,078,261
<カナダドル・・・カナダ>	%		カナダドル	カナダドル	円
CAN 0.25 220801	0.250	20220801	280,000	280,140	23,575,130
CAN 0.25 230201	0.250	20230201	2,230,000	2,229,175	187,595,808
CAN 0.25 260301	0.250	20260301	200,000	192,678	16,214,782
CAN 0.5 220301	0.500	20220301	1,800,000	1,806,102	151,992,185
CAN 0.5 250901	0.500	20250901	3,460,000	3,401,318	286,237,331
CAN 0.5 301201	0.500	20301201	500,000	460,130	38,722,156
CAN 1 220901	1.000	20220901	4,140,000	4,188,065	352,445,882
CAN 1 270601	1.000	20270601	1,900,000	1,892,514	159,264,171
CAN 1.25 250301	1.250	20250301	1,400,000	1,426,684	120,062,332
CAN 1.25 300601	1.250	20300601	3,000,000	2,978,010	250,613,890
CAN 1.5 230601	1.500	20230601	3,130,000	3,212,037	270,308,415
CAN 1.5 240901	1.500	20240901	1,400,000	1,442,322	121,378,345
CAN 1.5 260601	1.500	20260601	3,010,000	3,084,046	259,537,330
CAN 1.75 230301	1.750	20230301	5,160,000	5,311,188	446,962,061
CAN 2 230901	2.000	20230901	2,500,000	2,600,500	218,844,604
CAN 2 280601	2.000	20280601	1,880,000	1,991,052	167,556,585
CAN 2 511201	2.000	20511201	2,030,000	2,111,890	177,725,736
CAN 2.25 240301	2.250	20240301	1,500,000	1,578,825	132,865,731
CAN 2.25 250601	2.250	20250601	1,690,000	1,790,031	150,639,741
CAN 2.25 290601	2.250	20290601	1,300,000	1,401,816	117,969,570
CAN 2.5 240601	2.500	20240601	1,860,000	1,976,324	166,317,220
CAN 2.75 481201	2.750	20481201	1,700,000	2,042,159	171,857,519
CAN 2.75 641201	2.750	20641201	590,000	752,462	63,323,336
CAN 3.5 451201	3.500	20451201	1,630,000	2,177,354	183,234,830
CAN 4 410601	4.000	20410601	1,310,000	1,815,529	152,785,513
CAN 5 370601	5.000	20370601	1,200,000	1,773,324	149,233,759
CAN 5.75 290601	5.750	20290601	1,360,000	1,836,666	154,564,327
CAN 5.75 330601	5.750	20330601	1,800,000	2,644,668	222,561,555
<オーストラリアドル・・・オーストラリア>	%		オーストラリアドル	オーストラリアドル	円
ACGB 0.25 241121	0.250	20241121	3,210,000	3,187,467	262,912,670
ACGB 0.25 251121	0.250	20251121	2,800,000	2,736,665	225,729,073
ACGB 0.5 260921	0.500	20260921	1,350,000	1,310,715	108,112,056
ACGB 1 301221	1.000	20301221	3,380,000	3,117,373	257,131,080
ACGB 1 311121	1.000	20311121	2,230,000	2,021,792	166,763,986
ACGB 1.25 320521	1.250	20320521	2,200,000	2,033,611	167,738,914
ACGB 1.5 310621	1.500	20310621	2,850,000	2,740,596	226,053,309
ACGB 1.75 510621	1.750	20510621	1,700,000	1,340,960	110,606,763
ACGB 2.25 221121	2.250	20221121	3,210,000	3,328,449	274,541,350
ACGB 2.25 280521	2.250	20280521	3,430,000	3,646,433	300,769,710
ACGB 2.5 300521	2.500	20300521	3,630,000	3,855,027	317,975,222
ACGB 2.75 240421	2.750	20240421	1,340,000	1,450,282	119,623,998
ACGB 2.75 271121	2.750	20271121	2,800,000	3,076,360	253,748,226
ACGB 2.75 281121	2.750	20281121	2,400,000	2,614,096	215,619,147
ACGB 2.75 291121	2.750	20291121	3,000,000	3,287,400	271,155,495
ACGB 2.75 350621	2.750	20350621	600,000	634,931	52,371,211
ACGB 2.75 410521	2.750	20410521	1,070,000	1,081,693	89,221,605

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
ACGB 3 470321	3.000	20470321	1,580,000	1,666,742	137,478,327
ACGB 3.25 250421	3.250	20250421	3,330,000	3,693,001	304,610,761
ACGB 3.25 290421	3.250	20290421	4,270,000	4,809,916	396,737,580
ACGB 3.25 390621	3.250	20390621	1,110,000	1,241,535	102,405,864
ACGB 3.75 370421	3.750	20370421	1,510,000	1,779,981	146,818,616
ACGB 4.25 260421	4.250	20260421	3,020,000	3,538,836	291,894,758
ACGB 4.5 330421	4.500	20330421	1,900,000	2,402,220	198,142,937
ACGB 4.75 270421	4.750	20270421	2,730,000	3,309,964	273,016,619
ACGB 5.5 230421	5.500	20230421	2,030,000	2,263,605	186,709,562
ACGB 5.75 220715	5.750	20220715	2,080,000	2,241,200	184,861,500
<デンマーククローネ・・・デンマーク>			デンマーククローネ	デンマーククローネ	円
DGB 0.25 221115	0.250	20221115	5,890,000	5,959,502	103,640,129
DGB 0.25 521115	0.250	20521115	3,050,000	2,966,674	51,592,646
DGB 0.5 271115	0.500	20271115	11,600,000	12,196,182	212,100,588
DGB 0.5 291115	0.500	20291115	4,700,000	4,952,860	86,133,883
DGB 1.5 231115	1.500	20231115	9,360,000	9,859,824	171,469,602
DGB 1.75 251115	1.750	20251115	8,240,000	9,068,120	157,701,286
DGB 4.5 391115	4.500	20391115	15,800,000	28,440,000	494,592,548
<スウェーデンクローナ・・・スウェーデン>	%		スウェーデンクローナ	スウェーデンクローナ	円
SGB 0.125 310512	0.125	20310512	3,800,000	3,687,301	46,766,714
SGB 0.75 280512	0.750	20280512	6,600,000	6,867,894	87,106,751
SGB 0.75 291112	0.750	20291112	6,730,000	6,988,600	88,637,690
SGB 1 261112	1.000	20261112	6,300,000	6,644,264	84,270,405
SGB 1.5 231113	1.500	20231113	10,860,000	11,379,492	144,328,177
SGB 2.5 250512	2.500	20250512	10,150,000	11,259,395	142,804,959
SGB 3.5 220601	3.500	20220601	11,660,000	12,214,783	154,922,317
SGB 3.5 390330	3.500	20390330	5,230,000	7,696,306	97,613,650
<マレーシアリング・・・マレーシア>	%		マレーシアリング	マレーシアリング	円
MGS 3.418 220815	3.418	20220815	1,200,000	1,228,063	32,325,584
MGS 3.48 230315	3.480	20230315	2,220,000	2,288,004	60,225,808
MGS 3.733 280615	3.733	20280615	1,700,000	1,796,993	47,301,206
MGS 3.757 400522	3.757	20400522	1,800,000	1,760,547	46,341,869
MGS 3.795 220930	3.795	20220930	1,530,000	1,577,311	41,518,639
MGS 3.8 230817	3.800	20230817	1,540,000	1,605,938	42,272,173
MGS 3.828 340705	3.828	20340705	1,600,000	1,607,925	42,324,473
MGS 3.844 330415	3.844	20330415	1,560,000	1,577,164	41,514,768
MGS 3.882 220310	3.882	20220310	1,710,000	1,746,967	45,984,413
MGS 3.882 250314	3.882	20250314	1,600,000	1,705,224	44,885,620
MGS 3.885 290815	3.885	20290815	2,700,000	2,879,396	75,792,676
MGS 3.892 270315	3.892	20270315	1,660,000	1,777,715	46,793,756
MGS 3.899 271116	3.899	20271116	1,540,000	1,645,071	43,302,254
MGS 3.9 261130	3.900	20261130	1,100,000	1,183,767	31,159,615
MGS 3.906 260715	3.906	20260715	1,400,000	1,501,274	39,517,178
MGS 3.955 250915	3.955	20250915	1,920,000	2,054,910	54,090,195
MGS 4.059 240930	4.059	20240930	1,260,000	1,343,010	35,351,273
MGS 4.065 500615	4.065	20500615	800,000	784,500	20,649,951
MGS 4.181 240715	4.181	20240715	1,910,000	2,037,449	53,630,589
MGS 4.232 310630	4.232	20310630	1,100,000	1,199,158	31,564,729
MGS 4.254 350531	4.254	20350531	1,100,000	1,152,028	30,324,178
MGS 4.392 260415	4.392	20260415	1,480,000	1,620,790	42,663,106
MGS 4.498 300415	4.498	20300415	1,200,000	1,342,475	35,337,187
MGS 4.642 331107	4.642	20331107	1,600,000	1,736,181	45,700,478
MGS 4.736 460315	4.736	20460315	1,800,000	1,977,017	52,039,879

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
MGS 4.762 370407	4.762	20370407	2,000,000	2,187,861	57,589,793
MGS 4.921 480706	4.921	20480706	900,000	1,008,204	26,538,380
MGS 4.935 430930	4.935	20430930	1,620,000	1,809,458	47,629,307
<ノルウェークローネ・・・ノルウェー>	%		ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	円
NGB 1.25 310917	1.250	20310917	2,800,000	2,729,706	33,769,493
NGB 1.375 300819	1.375	20300819	5,550,000	5,514,674	68,222,642
NGB 1.5 260219	1.500	20260219	4,300,000	4,408,205	54,534,391
NGB 1.75 250313	1.750	20250313	3,490,000	3,615,832	44,731,855
NGB 1.75 270217	1.750	20270217	5,220,000	5,378,949	66,543,570
NGB 1.75 290906	1.750	20290906	4,590,000	4,727,346	58,482,519
NGB 2 230524	2.000	20230524	8,140,000	8,408,924	104,027,730
NGB 2 280426	2.000	20280426	4,070,000	4,258,238	52,679,124
NGB 3 240314	3.000	20240314	9,650,000	10,326,755	127,753,416
<シンガポールドル・・・シンガポール>	%		シンガポールドル	シンガポールドル	円
SIGB 1.75 220401	1.750	20220401	220,000	223,432	17,902,117
SIGB 1.75 230201	1.750	20230201	900,000	923,310	73,978,677
SIGB 1.875 500301	1.875	20500301	600,000	604,704	48,450,901
SIGB 2.125 260601	2.125	20260601	760,000	811,452	65,016,241
SIGB 2.25 360801	2.250	20360801	600,000	648,417	51,953,333
SIGB 2.375 250601	2.375	20250601	800,000	857,840	68,733,002
SIGB 2.625 280501	2.625	20280501	960,000	1,061,760	85,071,753
SIGB 2.75 230701	2.750	20230701	1,100,000	1,157,750	92,762,792
SIGB 2.75 420401	2.750	20420401	640,000	750,720	60,150,190
SIGB 2.75 460301	2.750	20460301	890,000	1,057,320	84,716,005
SIGB 2.875 300901	2.875	20300901	1,230,000	1,398,774	112,074,475
SIGB 3 240901	3.000	20240901	1,280,000	1,388,160	111,224,010
SIGB 3.125 220901	3.125	20220901	610,000	635,208	50,895,004
SIGB 3.375 330901	3.375	20330901	900,000	1,087,650	87,146,146
SIGB 3.5 270301	3.500	20270301	900,000	1,033,200	82,783,430
<メキシコペソ・・・メキシコ>	%		メキシコペソ	メキシコペソ	円
MBONO 10 241205	10.000	20241205	32,430,000	38,261,563	194,944,494
MBONO 10 361120	10.000	20361120	9,010,000	11,759,809	59,916,788
MBONO 5.75 260305	5.750	20260305	22,330,000	22,965,512	117,010,382
MBONO 6.5 220609	6.500	20220609	37,900,000	39,015,359	198,785,123
MBONO 6.75 230309	6.750	20230309	24,400,000	25,614,256	130,505,862
MBONO 7.5 270603	7.500	20270603	34,000,000	37,634,495	191,749,552
MBONO 7.75 310529	7.750	20310529	21,230,000	23,684,990	120,676,161
MBONO 7.75 341123	7.750	20341123	11,000,000	12,125,331	61,779,141
MBONO 7.75 421113	7.750	20421113	22,800,000	24,464,817	124,649,415
MBONO 8 231207	8.000	20231207	30,000,000	32,835,600	167,298,954
MBONO 8 240905	8.000	20240905	26,940,000	29,816,923	151,918,648
MBONO 8 471107	8.000	20471107	18,680,000	20,488,598	104,390,386
MBONO 8.5 290531	8.500	20290531	33,930,000	39,727,012	202,411,027
MBONO 8.5 381118	8.500	20381118	23,240,000	26,911,785	137,116,834
<イスラエルシェケル・・・イスラエル>	%		イスラエルシェケル	イスラエルシェケル	円
ILGOV 0.75 220731	0.750	20220731	3,000,000	3,028,931	97,413,696
ILGOV 1 300331	1.000	20300331	2,630,000	2,599,359	83,598,174
ILGOV 1.5 231130	1.500	20231130	2,200,000	2,277,003	73,230,871
ILGOV 1.5 370531	1.500	20370531	1,300,000	1,243,815	40,002,431
ILGOV 1.75 250831	1.750	20250831	3,100,000	3,282,968	105,583,783
ILGOV 2 270331	2.000	20270331	4,000,000	4,315,994	138,807,028
ILGOV 2.25 280928	2.250	20280928	1,400,000	1,535,369	49,379,105

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
ILGOV 3.75 240331	3.750	20240331	3,300,000	3,655,690	117,570,933
ILGOV 3.75 470331	3.750	20470331	2,100,000	2,732,278	87,873,012
ILGOV 4.25 230331	4.250	20230331	4,000,000	4,340,438	139,593,174
ILGOV 5.5 420131	5.500	20420131	2,200,000	3,556,698	114,387,230
ILGOV 6.25 261030	6.250	20261030	1,600,000	2,106,049	67,732,813
<ポーランドズロティ・・・ポーランド>	%		ポーランドズロティ	ポーランドズロティ	円
POLGB 1.25 301025	1.250	20301025	3,720,000	3,604,999	103,113,333
POLGB 2.25 220425	2.250	20220425	3,110,000	3,189,305	91,223,301
POLGB 2.25 241025	2.250	20241025	3,600,000	3,830,400	109,560,463
POLGB 2.5 230125	2.500	20230125	6,700,000	7,007,396	200,431,692
POLGB 2.5 240425	2.500	20240425	6,130,000	6,540,318	187,071,926
POLGB 2.5 260725	2.500	20260725	7,610,000	8,310,120	237,693,348
POLGB 2.5 270725	2.500	20270725	5,170,000	5,634,266	161,156,223
POLGB 2.75 280425	2.750	20280425	5,760,000	6,347,808	181,565,577
POLGB 2.75 291025	2.750	20291025	450,000	497,925	14,242,088
POLGB 3.25 250725	3.250	20250725	3,970,000	4,414,640	126,271,409
POLGB 4 231025	4.000	20231025	3,780,000	4,169,340	119,255,123
POLGB 5.75 220923	5.750	20220923	2,750,000	2,996,978	85,722,181
POLGB 5.75 290425	5.750	20290425	1,040,000	1,392,092	39,817,837
<ユーロ・・・ベルギー>	%		ユーロ	ユーロ	円
BGB 0 311022	0.000	20311022	300,000	298,706	38,628,150
BGB 0.2 231022	0.200	20231022	1,580,000	1,614,444	208,777,076
BGB 0.4 400622	0.400	20400622	900,000	888,302	114,873,676
BGB 0.5 241022	0.500	20241022	2,020,000	2,098,517	271,376,601
BGB 0.65 710622	0.650	20710622	570,000	504,202	65,202,486
BGB 0.8 250622	0.800	20250622	1,220,000	1,288,198	166,587,513
BGB 0.8 270622	0.800	20270622	1,760,000	1,887,503	244,088,545
BGB 0.8 280622	0.800	20280622	2,430,000	2,614,194	338,062,998
BGB 0.9 290622	0.900	20290622	1,970,000	2,143,600	277,206,648
BGB 1 260622	1.000	20260622	2,000,000	2,152,946	278,415,213
BGB 1 310622	1.000	20310622	1,100,000	1,213,960	156,987,185
BGB 1.25 330422	1.250	20330422	2,110,000	2,400,547	310,434,541
BGB 1.45 370622	1.450	20370622	520,000	611,819	79,119,363
BGB 1.6 470622	1.600	20470622	1,200,000	1,470,823	190,204,285
BGB 1.7 500622	1.700	20500622	900,000	1,135,953	146,899,456
BGB 1.9 380622	1.900	20380622	900,000	1,130,369	146,177,394
BGB 2.15 660622	2.150	20660622	730,000	1,050,324	135,826,063
BGB 2.25 230622	2.250	20230622	1,890,000	2,016,755	260,803,197
BGB 2.25 570622	2.250	20570622	750,000	1,094,765	141,573,128
BGB 2.6 240622	2.600	20240622	1,040,000	1,150,760	148,814,271
BGB 3 340622	3.000	20340622	1,300,000	1,781,650	230,399,863
BGB 3.75 450622	3.750	20450622	1,090,000	1,860,630	240,613,419
BGB 4 220328	4.000	20220328	2,150,000	2,257,704	291,962,367
BGB 4 320328	4.000	20320328	580,000	835,350	108,025,970
BGB 4.25 220928	4.250	20220928	1,080,000	1,163,916	150,515,582
BGB 4.25 410328	4.250	20410328	1,910,000	3,286,294	424,977,851
BGB 4.5 260328	4.500	20260328	1,120,000	1,404,844	181,671,970
BGB 5 350328	5.000	20350328	2,100,000	3,500,905	452,730,964
BGB 5.5 280328	5.500	20280328	2,950,000	4,175,132	539,920,741
<ユーロ・・・フランス>	%		ユーロ	ユーロ	円
FRTR 0 220525	0.000	20220525	2,940,000	2,962,750	383,137,614

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
FRTR 0 230225	0.000	20230225	2,600,000	2,632,058	340,373,139
FRTR 0 230325	0.000	20230325	5,010,000	5,073,627	656,112,574
FRTR 0 240325	0.000	20240325	4,800,000	4,881,840	631,311,015
FRTR 0 250325	0.000	20250325	5,260,000	5,368,549	694,251,310
FRTR 0 260225	0.000	20260225	4,210,000	4,298,187	555,834,012
FRTR 0 291125	0.000	20291125	3,620,000	3,650,064	472,019,909
FRTR 0 301125	0.000	20301125	2,300,000	2,304,223	297,978,064
FRTR 0.25 261125	0.250	20261125	4,180,000	4,330,722	560,041,455
FRTR 0.5 250525	0.500	20250525	4,700,000	4,902,006	633,918,847
FRTR 0.5 260525	0.500	20260525	4,500,000	4,706,100	608,584,625
FRTR 0.5 290525	0.500	20290525	4,700,000	4,949,960	640,120,187
FRTR 0.5 400525	0.500	20400525	1,210,000	1,219,596	157,715,994
FRTR 0.5 720525	0.500	20720525	550,000	462,000	59,745,032
FRTR 0.75 280525	0.750	20280525	5,310,000	5,690,727	735,914,868
FRTR 0.75 281125	0.750	20281125	4,800,000	5,155,210	666,662,694
FRTR 0.75 520525	0.750	20520525	2,400,000	2,412,600	311,993,214
FRTR 1 251125	1.000	20251125	4,330,000	4,633,100	599,144,393
FRTR 1 270525	1.000	20270525	3,700,000	4,011,096	518,707,923
FRTR 1.25 340525	1.250	20340525	3,800,000	4,327,011	559,561,447
FRTR 1.25 360525	1.250	20360525	4,500,000	5,150,700	666,079,520
FRTR 1.5 310525	1.500	20310525	6,280,000	7,241,970	936,518,953
FRTR 1.5 500525	1.500	20500525	3,420,000	4,162,516	538,289,318
FRTR 1.75 230525	1.750	20230525	5,040,000	5,308,395	686,472,377
FRTR 1.75 241125	1.750	20241125	4,710,000	5,118,223	661,879,682
FRTR 1.75 390625	1.750	20390625	3,900,000	4,850,559	627,265,772
FRTR 1.75 660525	1.750	20660525	1,650,000	2,207,482	285,467,739
FRTR 2 480525	2.000	20480525	3,240,000	4,345,809	561,992,392
FRTR 2.25 221025	2.250	20221025	5,140,000	5,385,238	696,409,582
FRTR 2.25 240525	2.250	20240525	4,330,000	4,727,689	611,376,458
FRTR 2.5 300525	2.500	20300525	5,590,000	6,927,067	895,796,132
FRTR 2.75 271025	2.750	20271025	5,470,000	6,598,166	853,263,244
FRTR 3 220425	3.000	20220425	5,740,000	5,980,380	773,372,251
FRTR 3.25 450525	3.250	20450525	2,800,000	4,519,900	584,505,567
FRTR 3.5 260425	3.500	20260425	5,090,000	6,135,232	793,397,413
FRTR 4 381025	4.000	20381025	3,260,000	5,310,696	686,769,985
FRTR 4 550425	4.000	20550425	2,290,000	4,544,883	587,736,305
FRTR 4 600425	4.000	20600425	1,890,000	3,928,639	508,044,734
FRTR 4.25 231025	4.250	20231025	5,130,000	5,796,644	749,611,804
FRTR 4.5 410425	4.500	20410425	4,490,000	8,028,749	1,038,263,734
FRTR 4.75 350425	4.750	20350425	3,200,000	5,245,485	678,336,925
FRTR 5.5 290425	5.500	20290425	5,960,000	8,757,177	1,132,462,822
FRTR 5.75 321025	5.750	20321025	3,710,000	6,174,820	798,516,944
FRTR 6 251025	6.000	20251025	840,000	1,097,254	141,894,995
FRTR 8.5 230425	8.500	20230425	100,000	119,777	15,489,326
<ユーロ・・・ドイツ>	%		ユーロ	ユーロ	円
DBR 0 260815	0.000	20260815	3,670,000	3,786,302	489,637,994
DBR 0 271115	0.000	20271115	800,000	826,512	106,883,087
DBR 0 290815	0.000	20290815	3,100,000	3,196,565	413,374,198
DBR 0 300215	0.000	20300215	2,900,000	2,987,377	386,322,371
DBR 0 300815	0.000	20300815	2,300,000	2,365,113	305,852,278
DBR 0 310215	0.000	20310215	1,500,000	1,539,255	199,053,765

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
DBR 0 350515	0.000	20350515	2,200,000	2,218,986	286,955,390
DBR 0 500815	0.000	20500815	2,200,000	2,077,482	268,656,340
DBR 0.25 270215	0.250	20270215	3,750,000	3,930,750	508,317,719
DBR 0.25 280815	0.250	20280815	3,700,000	3,892,252	503,339,224
DBR 0.25 290215	0.250	20290215	3,540,000	3,726,310	481,879,921
DBR 0.5 250215	0.500	20250215	4,070,000	4,256,691	550,467,826
DBR 0.5 260215	0.500	20260215	3,390,000	3,577,230	462,601,091
DBR 0.5 270815	0.500	20270815	3,660,000	3,904,671	504,945,228
DBR 0.5 280215	0.500	20280215	4,000,000	4,274,480	552,768,281
DBR 1 240815	1.000	20240815	3,560,000	3,767,690	487,231,136
DBR 1 250815	1.000	20250815	4,190,000	4,496,834	581,522,673
DBR 1.25 480815	1.250	20480815	2,900,000	3,749,526	484,882,148
DBR 1.5 220904	1.500	20220904	2,700,000	2,789,235	360,698,994
DBR 1.5 230215	1.500	20230215	3,800,000	3,963,742	512,584,186
DBR 1.5 230515	1.500	20230515	3,600,000	3,774,564	488,120,018
DBR 1.5 240515	1.500	20240515	3,500,000	3,746,120	484,441,690
DBR 1.75 220704	1.750	20220704	3,170,000	3,272,359	423,175,784
DBR 1.75 240215	1.750	20240215	3,590,000	3,851,280	498,040,823
DBR 2 230815	2.000	20230815	4,050,000	4,319,973	558,651,357
DBR 2.5 440704	2.500	20440704	3,230,000	5,055,854	653,814,253
DBR 2.5 460815	2.500	20460815	3,290,000	5,265,481	680,922,734
DBR 3.25 420704	3.250	20420704	2,290,000	3,864,558	499,757,911
DBR 4 370104	4.000	20370104	2,500,000	4,125,275	533,473,352
DBR 4.25 390704	4.250	20390704	2,250,000	4,021,268	520,023,283
DBR 4.75 280704	4.750	20280704	1,660,000	2,309,359	298,642,243
DBR 4.75 340704	4.750	20340704	2,830,000	4,711,412	609,271,603
DBR 4.75 400704	4.750	20400704	2,370,000	4,559,975	589,687,970
DBR 5.5 310104	5.500	20310104	3,000,000	4,748,790	614,105,221
DBR 6.25 240104	6.250	20240104	790,000	947,621	122,544,665
DBR 6.25 300104	6.250	20300104	770,000	1,231,138	159,208,562
DBR 6.5 270704	6.500	20270704	1,130,000	1,644,523	212,666,826
GERMANY 5.625%280104	5.625	20280104	3,250,000	4,639,343	599,951,662
OBL 0 221007	0.000	20221007	3,950,000	3,991,949	516,231,866
OBL 0 230414	0.000	20230414	2,900,000	2,941,731	380,419,510
OBL 0 231013	0.000	20231013	2,800,000	2,850,512	368,623,229
OBL 0 240405	0.000	20240405	2,900,000	2,960,436	382,838,408
OBL 0 250411	0.000	20250411	1,600,000	1,640,987	212,209,554
OBL 0 251010	0.000	20251010	2,440,000	2,508,930	324,450,441
OBL 0 251010	0.000	20251010	300,000	308,646	39,913,561
RAGB 1.5 861102	1.500	20861102	210,000	293,412	37,943,526
<ユーロ・・・イタリア>	%		ユーロ	ユーロ	円
BTPS 0.3 230815	0.300	20230815	1,700,000	1,720,740	222,523,088
BTPS 0.35 250201	0.350	20250201	1,060,000	1,075,211	139,044,407
BTPS 0.5 260201	0.500	20260201	880,000	895,686	115,828,547
BTPS 0.6 310801	0.600	20310801	1,500,000	1,472,315	190,397,145
BTPS 0.65 231015	0.650	20231015	1,200,000	1,226,640	158,626,940
BTPS 0.85 270115	0.850	20270115	1,300,000	1,343,225	173,703,509
BTPS 0.9 220801	0.900	20220801	2,080,000	2,115,776	273,608,453
BTPS 0.9 310401	0.900	20310401	1,510,000	1,531,806	198,090,462
BTPS 0.95 230301	0.950	20230301	2,370,000	2,426,335	313,769,388
BTPS 0.95 230315	0.950	20230315	2,170,000	2,223,382	287,523,873

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
BTPS 0.95 270915	0.950	20270915	1,000,000	1,035,900	133,960,777
BTPS 0.95 300801	0.950	20300801	1,300,000	1,331,460	172,182,079
BTPS 1 220715	1.000	20220715	2,300,000	2,341,584	302,809,549
BTPS 1.2 220401	1.200	20220401	1,740,000	1,768,884	228,748,986
BTPS 1.25 261201	1.250	20261201	2,720,000	2,876,672	372,006,194
BTPS 1.35 220415	1.350	20220415	1,460,000	1,487,375	192,344,735
BTPS 1.35 300401	1.350	20300401	2,890,000	3,068,602	396,826,246
BTPS 1.45 220915	1.450	20220915	2,170,000	2,228,829	288,228,231
BTPS 1.45 241115	1.450	20241115	2,130,000	2,246,937	290,569,965
BTPS 1.45 360301	1.450	20360301	190,000	198,759	25,703,166
BTPS 1.5 250601	1.500	20250601	3,560,000	3,781,003	488,952,747
BTPS 1.6 260601	1.600	20260601	3,090,000	3,317,733	429,043,432
BTPS 1.65 301201	1.650	20301201	1,800,000	1,957,654	253,160,380
BTPS 1.65 320301	1.650	20320301	2,660,000	2,886,898	373,328,603
BTPS 1.7 510901	1.700	20510901	760,000	768,382	99,365,822
BTPS 1.75 240701	1.750	20240701	2,110,000	2,240,082	289,683,423
BTPS 1.8 410301	1.800	20410301	1,300,000	1,389,310	179,663,140
BTPS 1.85 240515	1.850	20240515	2,100,000	2,232,720	288,731,447
BTPS 2 251201	2.000	20251201	2,700,000	2,943,540	380,653,447
BTPS 2 280201	2.000	20280201	3,400,000	3,769,580	487,475,496
BTPS 2.05 270801	2.050	20270801	2,400,000	2,659,920	343,976,204
BTPS 2.1 260715	2.100	20260715	3,000,000	3,306,300	427,564,936
BTPS 2.2 270601	2.200	20270601	2,500,000	2,793,000	361,185,877
BTPS 2.25 360901	2.250	20360901	1,980,000	2,295,414	296,838,926
BTPS 2.45 231001	2.450	20231001	2,800,000	2,988,440	386,459,837
BTPS 2.45 330901	2.450	20330901	2,070,000	2,432,871	314,614,625
BTPS 2.45 500901	2.450	20500901	1,780,000	2,121,582	274,359,275
BTPS 2.5 241201	2.500	20241201	2,840,000	3,107,244	401,823,362
BTPS 2.5 251115	2.500	20251115	2,230,000	2,482,659	321,053,122
BTPS 2.7 470301	2.700	20470301	2,210,000	2,752,334	355,927,021
BTPS 2.8 281201	2.800	20281201	3,000,000	3,520,500	455,264,906
BTPS 2.8 670301	2.800	20670301	1,050,000	1,322,895	171,074,468
BTPS 2.95 380901	2.950	20380901	1,880,000	2,354,512	304,481,376
BTPS 3 290801	3.000	20290801	2,100,000	2,517,690	325,583,269
BTPS 3.1 400301	3.100	20400301	1,620,000	2,096,280	271,087,265
BTPS 3.25 460901	3.250	20460901	2,030,000	2,760,394	356,969,326
BTPS 3.35 350301	3.350	20350301	1,700,000	2,204,730	285,111,829
BTPS 3.45 480301	3.450	20480301	2,260,000	3,141,626	406,269,582
BTPS 3.5 300301	3.500	20300301	3,220,000	4,019,526	519,798,076
BTPS 3.75 240901	3.750	20240901	2,650,000	3,003,245	388,374,393
BTPS 3.85 490901	3.850	20490901	1,600,000	2,420,000	312,950,169
BTPS 4 370201	4.000	20370201	3,480,000	4,894,272	632,918,699
BTPS 4.5 230501	4.500	20230501	2,570,000	2,835,686	366,706,000
BTPS 4.5 240301	4.500	20240301	3,050,000	3,474,560	449,324,025
BTPS 4.5 260301	4.500	20260301	3,160,000	3,845,404	497,280,923
BTPS 4.75 230801	4.750	20230801	3,430,000	3,845,716	497,321,270
BTPS 4.75 280901	4.750	20280901	2,990,000	3,928,262	507,995,975
BTPS 4.75 440901	4.750	20440901	2,050,000	3,376,350	436,623,680
BTPS 5 220301	5.000	20220301	1,810,000	1,907,251	246,642,404
BTPS 5 250301	5.000	20250301	3,940,000	4,728,122	611,432,439
BTPS 5 340801	5.000	20340801	2,800,000	4,196,640	542,702,149

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
BTPS 5 390801	5.000	20390801	2,810,000	4,528,596	585,630,118
BTPS 5 400901	5.000	20400901	2,660,000	4,318,244	558,427,765
BTPS 5.5 220901	5.500	20220901	2,900,000	3,151,865	407,593,672
BTPS 5.5 221101	5.500	20221101	4,000,000	4,386,160	567,210,544
BTPS 5.75 330201	5.750	20330201	2,930,000	4,537,105	586,730,487
BTPS 9 231101	9.000	20231101	500,000	622,900	80,552,339
ITALY	6.000	20310501	2,850,000	4,308,915	557,221,355
ITALY 5.250%291101	5.250	20291101	3,720,000	5,181,960	670,122,009
ITALY 6.5% 271101	6.500	20271101	2,670,000	3,738,267	483,426,153
<ユーロ・・・オランダ>	%		ユーロ	ユーロ	円
NETHER 0 240115	0.000	20240115	2,280,000	2,321,268	300,182,320
NETHER 0 520115	0.000	20520115	850,000	780,124	100,884,321
NETHER 0.25 250715	0.250	20250715	2,330,000	2,412,016	311,917,692
NETHER 0.25 290715	0.250	20290715	1,740,000	1,818,126	235,116,876
NETHER 0.5 260715	0.500	20260715	3,440,000	3,626,276	468,943,673
NETHER 0.5 400115	0.500	20400115	1,240,000	1,327,696	171,695,360
NETHER 0.75 270715	0.750	20270715	1,200,000	1,290,456	166,879,514
NETHER 0.75 280715	0.750	20280715	2,540,000	2,746,502	355,172,837
NETHER 1.75 230715	1.750	20230715	1,800,000	1,903,551	246,163,833
NETHER 2 240715	2.000	20240715	2,080,000	2,264,496	292,840,664
NETHER 2.25 220715	2.250	20220715	1,030,000	1,070,582	138,445,792
NETHER 2.5 330115	2.500	20330115	1,800,000	2,355,300	304,583,278
NETHER 2.75 470115	2.750	20470115	1,870,000	3,068,483	396,810,857
NETHER 3.75 230115	3.750	20230115	1,240,000	1,342,920	173,664,066
NETHER 3.75 420115	3.750	20420115	1,930,000	3,377,759	436,805,840
NETHER 4 370115	4.000	20370115	1,780,000	2,896,950	374,628,510
NETHER 5.5 280115	5.500	20280115	1,800,000	2,542,680	328,814,932
<ユーロ・・・オーストリア>	%		ユーロ	ユーロ	円
RAGB 0 220920	0.000	20220920	1,000,000	1,009,659	130,567,388
RAGB 0 230420	0.000	20230420	900,000	911,628	117,890,139
RAGB 0 230715	0.000	20230715	980,000	993,720	128,506,133
RAGB 0 300220	0.000	20300220	430,000	434,298	56,162,694
RAGB 0 401020	0.000	20401020	100,000	93,610	12,105,481
RAGB 0.5 270420	0.500	20270420	1,100,000	1,159,876	149,993,175
RAGB 0.5 290220	0.500	20290220	1,600,000	1,691,360	218,723,718
RAGB 0.75 261020	0.750	20261020	1,300,000	1,386,462	179,294,803
RAGB 0.75 280220	0.750	20280220	1,530,000	1,643,013	212,471,627
RAGB 0.75 510320	0.750	20510320	360,000	386,389	49,967,113
RAGB 0.85 200630	0.850	21200630	300,000	301,246	38,956,632
RAGB 1.2 251020	1.200	20251020	1,280,000	1,381,757	178,686,456
RAGB 1.5 470220	1.500	20470220	800,000	1,013,440	131,056,289
RAGB 1.65 241021	1.650	20241021	1,600,000	1,729,963	223,715,817
RAGB 1.75 231020	1.750	20231020	1,640,000	1,741,860	225,254,321
RAGB 2.1 170920	2.100	21170920	740,000	1,320,637	170,782,507
RAGB 2.4 340523	2.400	20340523	1,300,000	1,692,851	218,916,519
RAGB 3.15 440620	3.150	20440620	760,000	1,243,022	160,745,455
RAGB 3.4 221122	3.400	20221122	1,500,000	1,604,651	207,510,694
RAGB 3.65 220420	3.650	20220420	270,000	283,132	36,614,099
RAGB 3.8 620126	3.800	20620126	600,000	1,305,740	168,856,004
RAGB 4.15 370315	4.150	20370315	1,700,000	2,770,397	358,262,832
RAGB 4.85 260315	4.850	20260315	1,700,000	2,163,420	279,769,692

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
RAGB 6.25 270715	6.250	20270715	890,000	1,270,009	164,235,297
<ユーロ・・・アイルランド>	%		ユーロ	ユーロ	円
IRISH 0 221018	0.000	20221018	600,000	605,611	78,316,504
IRISH 0 311018	0.000	20311018	460,000	455,698	58,930,079
IRISH 0.2 270515	0.200	20270515	190,000	195,960	25,341,243
IRISH 0.4 350515	0.400	20350515	650,000	663,307	85,777,675
IRISH 0.8 220315	0.800	20220315	700,000	709,986	91,814,147
IRISH 0.9 280515	0.900	20280515	1,000,000	1,081,418	139,847,085
IRISH 1 260515	1.000	20260515	1,880,000	2,016,253	260,738,362
IRISH 1.1 290515	1.100	20290515	1,570,000	1,726,965	223,328,154
IRISH 1.3 330515	1.300	20330515	600,000	682,678	88,282,751
IRISH 1.35 310318	1.350	20310318	520,000	589,898	76,284,562
IRISH 1.5 500515	1.500	20500515	720,000	874,276	113,059,823
IRISH 1.7 370515	1.700	20370515	910,000	1,105,285	142,933,535
IRISH 2 450218	2.000	20450218	1,020,000	1,353,199	174,993,370
IRISH 2.4 300515	2.400	20300515	700,000	858,381	111,004,369
IRISH 3.4 240318	3.400	20240318	1,040,000	1,165,043	150,661,303
IRISH 3.9 230320	3.900	20230320	980,000	1,070,047	138,376,646
IRISH 5.4 250313	5.400	20250313	1,370,000	1,697,548	219,523,916
<ユーロ・・・スペイン>	%		ユーロ	ユーロ	円
SPGB 0 230430	0.000	20230430	2,090,000	2,109,437	272,788,705
SPGB 0 240531	0.000	20240531	160,000	161,760	20,918,507
SPGB 0 250131	0.000	20250131	1,000,000	1,011,150	130,760,150
SPGB 0.1 310430	0.100	20310430	1,540,000	1,493,492	193,135,774
SPGB 0.35 230730	0.350	20230730	2,600,000	2,647,520	342,372,684
SPGB 0.4 220430	0.400	20220430	400,000	404,232	52,274,575
SPGB 0.45 221031	0.450	20221031	2,930,000	2,974,946	384,714,842
SPGB 0.5 300430	0.500	20300430	3,300,000	3,362,086	434,779,110
SPGB 1 501031	1.000	20501031	1,590,000	1,493,861	193,183,447
SPGB 1.2 401031	1.200	20401031	460,000	478,174	61,836,643
SPGB 1.25 301031	1.250	20301031	2,500,000	2,690,000	347,866,097
SPGB 1.3 261031	1.300	20261031	3,100,000	3,349,910	433,204,453
SPGB 1.4 280430	1.400	20280430	2,520,000	2,758,717	356,752,470
SPGB 1.4 280730	1.400	20280730	2,700,000	2,944,620	380,793,111
SPGB 1.45 271031	1.450	20271031	2,680,000	2,933,394	379,341,384
SPGB 1.45 290430	1.450	20290430	2,650,000	2,922,224	377,896,886
SPGB 1.5 270430	1.500	20270430	2,670,000	2,926,454	378,443,851
SPGB 1.6 250430	1.600	20250430	2,640,000	2,846,659	368,124,991
SPGB 1.85 350730	1.850	20350730	2,340,000	2,703,711	349,639,164
SPGB 1.95 260430	1.950	20260430	3,170,000	3,519,421	455,125,312
SPGB 1.95 300730	1.950	20300730	2,900,000	3,340,322	431,964,537
SPGB 2.15 251031	2.150	20251031	3,100,000	3,438,830	444,703,484
SPGB 2.35 330730	2.350	20330730	2,200,000	2,671,240	345,440,087
SPGB 2.7 481031	2.700	20481031	2,630,000	3,566,843	461,257,878
SPGB 2.75 241031	2.750	20241031	3,350,000	3,729,763	482,326,392
SPGB 2.9 461031	2.900	20461031	2,310,000	3,214,543	415,699,064
SPGB 3.45 660730	3.450	20660730	1,770,000	2,848,004	368,298,942
SPGB 3.8 240430	3.800	20240430	3,600,000	4,074,840	526,951,185
SPGB 4.2 370131	4.200	20370131	2,520,000	3,822,273	494,289,663
SPGB 4.4 231031	4.400	20231031	2,220,000	2,507,543	324,271,113
SPGB 4.65 250730	4.650	20250730	3,280,000	3,994,974	516,623,106

銘柄	年利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				外貨建金額	円貨建金額
SPGB 4.7 410730	4.700	20410730	2,300,000	3,890,061	503,055,927
SPGB 4.8 240131	4.800	20240131	2,680,000	3,090,028	399,597,081
SPGB 4.9 400730	4.900	20400730	2,300,000	3,933,099	508,621,474
SPGB 5.15 281031	5.150	20281031	3,910,000	5,377,814	695,449,506
SPGB 5.15 441031	5.150	20441031	1,870,000	3,463,904	447,945,990
SPGB 5.4 230131	5.400	20230131	3,560,000	3,961,710	512,321,463
SPGB 5.75 320730	5.750	20320730	2,470,000	3,918,655	506,753,614
SPGB 5.9 260730	5.900	20260730	3,100,000	4,117,894	532,518,892
SPGB 6 290131	6.000	20290131	1,620,000	2,366,264	306,001,104
<ユーロ・・・フィンランド>	%		ユーロ	ユーロ	円
RFGB 0 220415	0.000	20220415	300,000	302,127	39,070,473
RFGB 0 230915	0.000	20230915	800,000	813,040	105,140,911
RFGB 0 300915	0.000	20300915	100,000	100,967	13,056,914
RFGB 0.125 360415	0.125	20360415	450,000	445,726	57,640,494
RFGB 0.125 520415	0.125	20520415	340,000	309,304	39,998,624
RFGB 0.5 260415	0.500	20260415	850,000	893,031	115,485,240
RFGB 0.5 270915	0.500	20270915	1,040,000	1,098,812	142,096,447
RFGB 0.5 280915	0.500	20280915	730,000	769,566	99,518,929
RFGB 0.5 290915	0.500	20290915	900,000	952,946	123,233,323
RFGB 0.75 310415	0.750	20310415	650,000	704,451	91,098,391
RFGB 0.875 250915	0.875	20250915	730,000	776,808	100,455,495
RFGB 1.125 340415	1.125	20340415	700,000	793,779	102,650,112
RFGB 1.375 470415	1.375	20470415	460,000	577,865	74,728,535
RFGB 1.5 230415	1.500	20230415	680,000	711,297	91,983,684
RFGB 1.625 220915	1.625	20220915	680,000	704,196	91,065,434
RFGB 2 240415	2.000	20240415	540,000	584,496	75,586,001
RFGB 2.625 420704	2.625	20420704	670,000	995,233	128,701,767
RFGB 4 250704	4.000	20250704	890,000	1,068,178	138,134,911
合計	722		—	—	248,901,088,569