



日立外国債券インデックスファンド

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、中長期的に投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	日立外国債券インデックスファンド	次の日立外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日立外国債券インデックスファンド	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	期中には分配を行わず、投資信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。	

運用報告書(全体版)

第17期

(決算日 2018年5月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、日立外国債券インデックスファンドは、このたび、第17期の決算を行いました。
ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

◎ 日立投資顧問株式会社

東京都千代田区神田練塀町3番地

〈運用報告書(全体版)に関するお問い合わせ先〉

企画総務グループ TEL : (03) 4554-5100

受付時間 : 9 : 00~17 : 00

土、日、祝日および12月31日~1月3日を除く

ホームページアドレス <http://www.hitachi-im.co.jp/>

日立外国債券インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
13期(2014年5月15日)	18,444	4.9	19,551	5.2	98.6	—	百万円 13,633
14期(2015年5月15日)	20,649	12.0	21,949	12.3	98.7	—	15,554
15期(2016年5月16日)	19,281	△ 6.6	20,537	△ 6.4	98.8	—	14,022
16期(2017年5月15日)	19,473	1.0	20,797	1.3	98.8	—	13,948
17期(2018年5月15日)	19,723	1.3	21,097	1.4	98.7	—	14,253

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注3) FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCが開発した債券指数です。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券組入 比率	債券先物 比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2017年 5月15日	19,473	—	20,797	—	98.8	—
5月末	19,388	△0.4	20,699	△0.5	98.7	—
6月末	19,764	1.5	21,088	1.4	98.7	—
7月末	19,735	1.3	21,078	1.4	98.7	—
8月末	20,017	2.8	21,379	2.8	98.8	—
9月末	20,235	3.9	21,620	4.0	98.8	—
10月末	20,227	3.9	21,624	4.0	98.7	—
11月末	20,258	4.0	21,642	4.1	98.7	—
12月末	20,502	5.3	21,910	5.4	98.8	—
2018年 1月末	19,991	2.7	21,371	2.8	98.6	—
2月末	19,476	0.0	20,826	0.1	98.6	—
3月末	19,591	0.6	20,965	0.8	98.9	—
4月末	19,830	1.8	21,218	2.0	98.7	—
(期末) 2018年 5月15日	19,723	1.3	21,097	1.4	98.7	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCが開発した債券指数です。

《当期中の運用経過》

【期中の基準価額等の推移】

基準価額とベンチマークの推移



*期首を100として指数化

【基準価額の変動要因】

〈上昇要因〉

ユーロ圏の政治リスクの後退や域内景気の堅調さをサポート材料として欧州周辺国債の金利が低下したことや、ECBの金融正常化への思惑から円安ユーロ高が進行したことがプラスに影響しました。

〈下落要因〉

グローバルでの堅調な経済環境が続く中で、FRBが利上げを継続したことや米国のトランプ政権が大型減税を決定したことによる一段の景気加速観測がマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2017年5月15日	2017年12月28日	2018年3月5日	2018年5月15日
基準価額	19,473円	20,560円	19,262円	19,723円

【当ファンドのベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額は前期末の19,473円からFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)とほぼリンクして動き、19,723円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は+1.3%となり、ベンチマーク騰落率+1.4%にほぼ追随したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となりました。

【投資環境】

当期、米国長期金利は昨年末まで概ね横ばいで推移しましたが、年明けから株価上昇が加速したことや、年末に成立した大型減税を背景に上昇に転じました。一方、欧州では、ドイツはやや上昇、イタリアは低下し、利回り格差は縮小しました。為替市場では、ドル円は横ばい推移の後、年初から円高が進行し、ユーロ円はユーロ高に振れました。

米国金利

米国10年国債利回りは年末までは2%台前半で推移しました。失業率の低下にもインフレ率が安定しており、利上げは緩やかなペースに留まるといった期待が金利上昇を抑制したものと

思われます。しかし、年末に大型減税法案が成立した後、急激な株価上昇に伴って長期金利も上昇しました。その後は、保護貿易に対する懸念等から金利低下に転じる局面もありましたが、期末にかけては中東の地政学リスクの高まりから原油高が進行すると、インフレ懸念により利上げ加速観測が浮上した結果、10年債は3.0%を上回る水準まで上昇しました。FRBは当期間中3度の利上げを実施し、10月からは資産残高縮小に舵を切りました。

ユーロ金利

ドイツの長期金利は、好調な欧州経済や中央銀行の緩和縮小観測等を背景に、上下しながらもやや上昇しました。一方、イタリア等の周縁国は、5月のフランス大統領選挙を好感し先行き不安感が後退したことから、金利低下基調が続きましたが、期末にはポピュリスト政権樹立懸念から、やや金利が上昇しました。その結果、周縁国とドイツとの利回り格差は縮小しました。欧州中銀は量的緩和を今年1月から縮小し、9月まで実施することを決定しました。英国では、11月金融危機以降初めてとなる利上げが決定され、長期金利は上昇しました。

〈外国為替市況〉

ドル円は、好調なグローバル景気や欧州政治リスクの後退と、米国政治の混乱や極東での地政学リスク等の綱引きとなり、110円前後で上下する展開が続きました。しかし、年明け以降は、保護貿易に対する懸念や株価下落とともに円高が進行し、一時105円を割り込む局面も見られましたが、期末にかけては、米利上げ観測などを背景に110円近辺まで値を戻しました。一方、ユーロは、フランス大統領選挙の結果や欧州中銀の出口戦略観測から堅調に推移し、ユーロ円もユーロ高円安に振れました。

【当ファンドのポートフォリオ】

〈当ファンド〉

日立外国債券インデックスマザーファンドへの投資を高位に保つ運用を行いました。

〈日立外国債券インデックスマザーファンド〉

海外の国債を主要投資対象とします。具体的には、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークに連動する収益率の実現を目指しインデックス運用を行いました。

【今後の運用方針】

パッシブ運用につき、投資するマザーファンドにおいては、ベンチマークに連動すべく適宜リバランスを実施してまいります。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2017.5.16~2018.5.15)		
	金 額	比 率	
(a)信託報酬	37円	0.184%	信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は19,917円です。
(投信会社)	(15)	(0.076)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(13)	(0.065)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(9)	(0.043)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)その他費用	3	0.016	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕
(保管費用)	(3)	(0.016)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	
合 計	40	0.200	

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

(注2) 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2017年5月16日から2018年5月15日まで)

フ ァ ン ド 名 称	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日 立 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口	千円	千口	千円
	575,706	1,253,600	529,823	1,145,700

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2017年5月16日から2018年5月15日まで)

公社債(日立外国債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	155,853	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	96,304
2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	121,684	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	89,161
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,582	4.250% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	89,095
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,265	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	89,031
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	103,128	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	77,311
1.750% UK TREASURY (イギリス)	83,343	4.250% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	76,514
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	82,288	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,851
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	80,478	1.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,757
2.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	79,934	4.500% BUONI POLIENNALI(ユーロ・イタリア)	75,648
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	79,091	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,463

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2017年5月16日から2018年5月15日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細(2018年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	金 額	口 数	評 価 額
日立外国債券インデックスマザーファンド	千口	千円	千口	千円
	6,544,272	6,590,155	6,590,155	14,237,371

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2018年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日 立 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ェ ン ド	千円 14,237,371	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	38,839	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	14,276,210	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(31,346,414千円)の投資信託財産総額(31,381,649千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=109.74円、1カナダドル=85.75円、1メキシコペソ=5.60円、1ユーロ=131.00円、1英ポンド=148.90円、1スイスフラン=109.73円、1スウェーデンクローナ=12.71円、1ノルウェークローネ=13.66円、1デンマーククローネ=17.59円、1ポーランドズロチ=30.65円、1オーストラリアドル=82.67円、1シンガポールドル=82.21円、1マレーシアリングギット=27.78円、1南アフリカランド=8.90円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2018年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,276,210,689円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,538,752
日 立 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ェ ン ド (評 価 額)	14,237,371,937
未 収 入 金	15,300,000
(B) 負 債	22,526,148
未 払 解 約 金	9,490,580
未 払 信 託 報 酬	13,035,504
未 払 利 息	64
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,253,684,541
元 本	7,226,788,845
次 期 繰 越 損 益 金	7,026,895,696
(D) 受 益 権 総 口 数	7,226,788,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,723円

(注1) 当ファンドの期首元本額は7,163,159,509円、期中追加設定元本額は1,169,639,537円、期中一部解約元本額は1,106,010,201円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,9723円です。

■損益の状況

当期(自2017年5月16日 至2018年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△20,948円
支 払 利 息	△20,948
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	159,605,140
売 買 益	210,969,599
売 買 損	△51,364,459
(C) 信 託 報 酬 等	△26,145,760
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	133,438,432
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,845,892,613
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,047,564,651
(配 当 等 相 当 額)	(4,805,067,518)
(売 買 損 益 相 当 額)	(242,497,133)
(G) 計 (D + E + F)	7,026,895,696
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	7,026,895,696
追 加 信 託 差 損 益 金	5,047,564,651
(配 当 等 相 当 額)	(4,805,067,518)
(売 買 損 益 相 当 額)	(242,497,133)
分 配 準 備 積 立 金	2,429,255,171
繰 越 損 益 金	△449,924,126

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(4,805,067,518円)および分配準備積立金(2,429,255,171円)より分配対象収益は7,234,322,689円(10,000口当たり10,010円)ですが、当期に分配した金額はありません。

＜お知らせ＞

2018年2月13日付で投資信託及び投資法人に関する法律等の改正に伴う投資信託財産に係る分散投資規制対応の約款変更を行いました。また、同日付でインデックス名称変更の約款変更を行いました。

〈補足情報〉

日立外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2018年5月15日現在)

下記は、日立外国債券インデックスマザーファンド全体(14,518,481千口)の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	2018年5月15日現在							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	124,120	121,531	13,336,864	42.5	—	17.9	17.2	7.5
カナダ	千カナダドル 7,290	千カナダドル 7,733	663,156	2.1	—	1.0	0.6	0.6
メキシコ	千メキシコペソ 43,140	千メキシコペソ 42,955	240,549	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	14,220	16,586	2,172,869	6.9	—	4.1	2.3	0.5
イタリア	20,760	23,699	3,104,641	9.9	—	5.8	2.9	1.2
フランス	20,990	24,489	3,208,134	10.2	—	6.6	2.6	1.1
オランダ	4,440	5,165	676,730	2.2	—	1.3	0.6	0.2
スペイン	12,360	14,575	1,909,411	6.1	—	3.9	1.3	0.8
ベルギー	4,990	6,025	789,381	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	3,080	3,727	488,335	1.6	—	1.1	0.4	—
フィンランド	1,360	1,494	195,770	0.6	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	1,820	2,060	269,903	0.9	—	0.5	0.2	0.2
イギリス	千英ポンド 11,730	千英ポンド 14,549	2,166,377	6.9	—	5.1	1.5	0.3
スイス	千スイスフラン 390	千スイスフラン 459	50,373	0.2	—	0.0	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 7,920	千スウェーデンクローナ 9,211	117,084	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 6,590	千ノルウェークローネ 6,799	92,875	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 8,360	千デンマーククローネ 10,409	183,105	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 6,370	千ポーランドズロチ 6,573	201,466	0.6	—	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 7,550	千オーストラリアドル 7,967	658,676	2.1	—	1.2	0.6	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 1,390	千シンガポールドル 1,433	117,866	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 5,290	千マレーシアリンギット 5,206	144,646	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 24,700	千南アフリカランド 22,668	201,753	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	30,989,973	98.8	—	53.4	32.0	13.4

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

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	610	598	65,686	2019/ 7/15
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	550	538	59,121	2019/ 8/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	333	36,638	2019/ 7/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	460	450	49,435	2019/ 9/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	550	541	59,446	2019/ 6/30
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	294	32,320	2019/ 8/31
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	392	43,031	2019/ 9/30
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	420	411	45,154	2019/10/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	480	469	51,527	2019/11/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	361	39,693	2019/11/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	500	489	53,678	2019/12/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	438	48,098	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	410	398	43,756	2020/ 4/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	860	823	90,402	2021/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	600	571	62,695	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	570	541	59,458	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	200	189	20,797	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	560	553	60,686	2019/ 6/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	660	650	71,341	2019/ 8/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	270	265	29,111	2019/10/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	720	704	77,339	2020/ 1/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	500	488	53,639	2020/ 2/29
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	730	700	76,905	2021/ 3/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	620	571	62,707	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	691	75,887	2019/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	600	591	64,887	2019/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	460	451	49,600	2019/12/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	300	294	32,312	2020/ 1/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	420	412	45,215	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	200	196	21,512	2020/ 2/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	519	56,971	2020/ 2/29
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	590	577	63,355	2020/ 3/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	605	66,486	2020/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	614	67,461	2020/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	680	74,675	2020/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	270	262	28,794	2020/ 9/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	660	640	70,323	2020/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	500	484	53,202	2020/10/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	598	65,715	2021/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	450	432	47,515	2021/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	210	201	22,141	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	670	622	68,304	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	648	71,158	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	520	481	52,789	2023/ 9/30
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,170	1,153	126,600	2019/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	850	837	91,887	2019/11/30
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	380	372	40,824	2020/ 5/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	750	733	80,517	2020/ 5/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	488	53,656	2020/ 6/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	754	82,786	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	720	676	74,253	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	550	516	56,655	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,310	1,167	128,080	2026/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,070	1,061	116,449	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	653	71,760	2019/ 7/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	544	59,734	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	800	788	86,564	2019/12/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	780	764	83,878	2020/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	645	70,883	2020/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	760	741	81,415	2020/10/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,110	1,081	118,689	2020/11/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	640	609	66,897	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,340	1,272	139,595	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	500	471	51,753	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	400	376	41,354	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	420	393	43,174	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,240	1,123	123,288	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	993	108,991	2026/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	485	53,255	2019/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	620	606	66,566	2020/10/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	489	53,665	2020/11/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	650	634	69,664	2020/12/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	450	434	47,689	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	730	702	77,118	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	692	75,975	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	634	69,576	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	633	69,553	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	719	78,993	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	460	50,506	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	582	63,970	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	815	89,510	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	260	256	28,106	2020/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	640	70,283	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	630	609	66,867	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	370	357	39,233	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	400	386	42,369	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	482	52,923	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	580	557	61,222	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	480	52,683	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	469	51,569	2024/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	594	65,273	2020/ 1/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	630	621	68,223	2020/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	512	56,222	2020/ 9/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	590	64,763	2020/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	510	500	54,931	2021/ 2/28
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	655	71,986	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	703	77,148	2021/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	701	77,012	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	848	93,079	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	758	83,216	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	638	70,074	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	510	492	54,026	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,292	141,881	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,280	1,232	135,199	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	522	57,339	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	320	303	33,322	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	380	360	39,534	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,050	988	108,502	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,210	1,133	124,382	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,110	1,026	112,656	2026/11/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	563	61,848	2020/ 8/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	610	601	65,963	2021/ 1/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	677	74,348	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	961	105,478	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	700	685	75,245	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	490	479	52,566	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	603	66,215	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	740	717	78,695	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	460	441	48,504	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	480	459	50,477	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	530	507	55,685	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	460	438	48,173	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	476	52,280	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	770	732	80,387	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,070	1,013	111,211	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	430	427	46,930	2020/ 3/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	503	55,272	2021/ 3/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	660	651	71,483	2021/ 4/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	620	68,088	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	500	482	52,983	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	430	412	45,267	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,080	1,035	113,630	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,270	1,207	132,531	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	960	904	99,235	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	910	854	93,754	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,500	1,406	154,321	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	651	71,520	2046/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	330	327	35,939	2020/12/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	510	499	54,808	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,210	1,171	128,563	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	990	940	103,252	2027/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	890	873	95,883	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,330	1,299	142,579	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	300	291	32,019	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	682	74,920	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	630	556	61,077	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	580	512	56,190	2046/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	600	590	64,794	2023/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	820	90,014	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,150	1,149	126,102	2020/11/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	600	587	64,475	2025/ 3/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	960	953	104,609	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,051	115,388	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	350	342	37,571	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	460	50,491	2042/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	469	51,496	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,160	1,075	118,039	2047/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	570	546	59,922	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	780	744	81,725	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	723	79,401	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	294	32,340	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	700	684	75,125	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	770	752	82,591	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	690	674	74,016	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	720	702	77,111	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	190	185	20,324	2048/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	780	789	86,593	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	271	29,745	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	371	40,762	2042/ 2/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	410	410	45,091	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	640	640	70,272	2044/ 8/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	780	790	86,740	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	840	877	96,344	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	550	559	61,436	2020/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	245	26,910	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	380	385	42,326	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	750	763	83,828	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,000	1,024	112,474	2021/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	728	79,988	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	936	102,781	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	270	299	32,821	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	830	921	101,139	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	304	33,370	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	210	248	27,254	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	290	344	37,799	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	300	33,016	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	450	542	59,537	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	387	42,507	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	250	300	32,928	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	36	4,001	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	250	305	33,517	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	420	522	57,361	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	470	596	65,511	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	166	18,267	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	240	288	31,638	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	144	15,867	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	287	31,514	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	146	16,051	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	169	18,597	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	120	150	16,563	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	232	25,559	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	100	132	14,529	2030/ 5/15
6.500% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	113	12,483	2026/11/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	305	33,498	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	149	16,443	2019/ 8/15
8.750% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	238	26,134	2020/ 8/15
小計	—	—	—	—	13,336,864	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.750% CANADA GOV' T	国債証券	0.75	300	296	25,403	2019/ 8/ 1
0.750% CANADA GOV' T	国債証券	0.75	400	385	33,057	2021/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV' T	国債証券	0.75	310	296	25,410	2021/ 9/ 1
1.250% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	200	197	16,962	2020/ 2/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	590	585	50,175	2020/ 3/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	350	337	28,916	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	320	299	25,677	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	480	479	41,113	2019/ 9/ 1
2.250% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	460	456	39,169	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	310	313	26,847	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	420	428	36,779	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	220	234	20,072	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	120	131	11,243	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV' T	国債証券	3.25	440	454	38,979	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	470	484	41,505	2020/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	200	241	20,675	2045/12/ 1
3.750% CANADA GOV' T	国債証券	3.75	560	571	49,005	2019/ 6/ 1
4.000% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	290	367	31,511	2041/ 6/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
5.000% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	310	429	36,789	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	240	316	27,162	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	200	282	24,235	2033/ 6/ 1
8.000% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	145	12,459	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	663,156	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
5.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	6,270	6,034	33,791	2019/12/11
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	2,819	15,789	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	3,960	3,849	21,555	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	2,100	2,021	11,317	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,078	17,240	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,329	13,047	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	2,805	15,709	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,174	23,378	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,570	4,613	25,835	2020/ 6/11
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,221	23,643	2023/12/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,170	17,754	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,836	21,486	2038/11/18
小計	—	—	—	—	240,549	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	430	434	56,927	2020/ 4/17
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	414	54,343	2021/ 4/ 9
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	414	54,290	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	190	191	25,021	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	210	210	27,529	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	360	347	45,542	2026/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	300	303	39,779	2019/10/11
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	490	498	65,339	2020/10/16
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	530	519	68,096	2027/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	360	366	47,985	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	450	454	59,592	2026/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	300	315	41,316	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	750	788	103,241	2025/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	340	364	47,724	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	230	247	32,392	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	333	43,708	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	335	43,907	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	600	648	84,935	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	280	306	40,146	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	320	346	45,403	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	310	342	44,817	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	390	414	54,354	2020/ 9/ 4
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	401	52,633	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	560	604	79,133	2021/ 1/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	360	464	60,808	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	450	585	76,735	2046/ 8/15
3.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	462	60,594	2020/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	390	414	54,349	2020/ 1/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	280	312	40,872	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	270	389	51,031	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	390	587	76,972	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	270	431	56,553	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	190	267	35,079	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	582	76,257	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	290	498	65,266	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	260	408	53,566	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	440	650	85,151	2028/ 1/ 4

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	200	269	35,288	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	140	227	29,784	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	280	430	56,395	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.05	100	100	13,158	2019/10/15
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	200	200	26,278	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	200	201	26,448	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	340	345	45,288	2020/11/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	260	256	33,620	2023/10/15
0.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.7	360	365	47,942	2020/ 5/ 1
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	160	162	21,261	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	320	323	42,343	2023/ 3/15
1.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	270	275	36,080	2019/12/ 1
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	360	348	45,660	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	440	455	59,622	2022/ 4/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	290	300	39,391	2022/ 9/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	350	357	46,849	2019/ 8/ 1
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	330	332	43,580	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	300	300	39,335	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	343	44,970	2032/ 3/ 1
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	370	383	50,229	2025/12/ 1
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	60	61	8,012	2027/ 8/ 1
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	426	55,816	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	470	486	63,688	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	250	239	31,345	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	130	130	17,115	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	330	338	44,397	2019/ 5/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	453	59,355	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	260	249	32,660	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	190	173	22,727	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	30	31	4,082	2038/ 9/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	270	288	37,732	2046/ 9/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	250	271	35,609	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	380	432	56,599	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	470	518	67,905	2021/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	300	332	43,501	2021/ 5/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	701	91,905	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	370	427	56,036	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	520	568	74,482	2020/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	642	84,128	2037/ 2/ 1
4.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	508	66,589	2019/ 9/ 1
4.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	518	67,910	2020/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	460	497	65,122	2020/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	330	389	51,058	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	680	811	106,352	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	320	390	51,104	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	350	401	52,654	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	510	612	80,205	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	390	490	64,235	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	290	387	50,731	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	539	70,703	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	470	583	76,420	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	410	549	71,939	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	476	62,411	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	360	489	64,123	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	480	634	83,102	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	496	64,978	2022/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	460	558	73,179	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	330	467	61,274	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	480	682	89,383	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	928	121,640	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	317	41,616	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	143	18,738	2023/11/ 1
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	500	504	66,115	2020/ 5/25
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	320	322	42,284	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	340	341	44,700	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	290	288	37,830	2023/ 3/25
0.250% FRANCE GOV'T	国債証券	0.25	410	416	54,580	2020/11/25
0.250% FRANCE GOV'T	国債証券	0.25	650	630	82,535	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	650	660	86,486	2019/11/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	500	503	65,906	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	560	557	73,081	2026/ 5/25
0.750% FRANCE GOV'T	国債証券	0.75	240	238	31,210	2028/ 5/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	340	345	45,243	2019/ 5/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	590	612	80,242	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	400	410	53,783	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV'T	国債証券	1.25	380	375	49,142	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV'T	国債証券	1.5	650	684	89,628	2031/ 5/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	670	726	95,116	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	600	654	85,791	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	270	262	34,369	2066/ 5/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	830	914	119,755	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	590	660	86,557	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	650	696	91,246	2020/10/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	610	715	93,718	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV'T	国債証券	2.75	730	865	113,369	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV'T	国債証券	3.0	740	831	108,950	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	760	851	111,507	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	450	613	80,431	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	650	700	91,749	2020/ 4/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	670	827	108,369	2026/ 4/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	700	743	97,385	2019/10/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	730	817	107,153	2021/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	480	706	92,553	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	310	499	65,378	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	270	446	58,431	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	770	941	123,394	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	620	989	129,659	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	440	679	88,978	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	520	772	101,165	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	640	1,040	136,240	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	310	40,679	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	80	90	11,856	2019/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	240	31,554	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	340	342	44,865	2022/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	230	233	30,548	2020/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	280	277	36,335	2025/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	300	299	39,284	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	170	171	22,517	2027/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	369	48,423	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	290	321	42,108	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	340	44,650	2022/ 7/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.5	280	338	44,291	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	160	217	28,444	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.25	280	312	40,872	2021/ 7/15
3.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.5	320	348	45,592	2020/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	30	35	4,626	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	300	460	60,317	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	210	221	28,998	2019/ 7/15
4.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	270	404	52,970	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	250	364	47,710	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	108	14,174	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.400% SPANISH GOV' T	国債証券	0.4	320	323	42,423	2022/ 4/30
0.750% SPANISH GOV' T	国債証券	0.75	450	461	60,500	2021/ 7/30
1.150% SPANISH GOV' T	国債証券	1.15	260	268	35,126	2020/ 7/30
1.300% SPANISH GOV' T	国債証券	1.3	420	427	55,988	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	280	288	37,765	2020/ 1/31
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	100	100	13,204	2028/ 4/30
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	50	50	6,670	2027/10/31
1.500% SPANISH GOV' T	国債証券	1.5	470	482	63,263	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	443	58,068	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	270	289	37,913	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	540	562	73,704	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	440	479	62,804	2025/10/31
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	390	401	52,632	2019/ 4/30
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	400	452	59,285	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	150	166	21,850	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	310	372	48,837	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	370	439	57,567	2024/ 4/30
4.000% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	500	542	71,002	2020/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	440	593	77,710	2037/ 1/31
4.300% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	363	47,590	2019/10/31
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	370	448	58,765	2023/10/31
4.600% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	370	392	51,412	2019/ 7/30
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	340	430	56,445	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	270	394	51,636	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	400	496	65,028	2024/ 1/31
4.850% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	440	494	64,810	2020/10/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	320	475	62,259	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	380	520	68,128	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	230	360	47,225	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	390	483	63,336	2023/ 1/31
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	480	559	73,318	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	530	803	105,221	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	559	73,270	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	330	456	59,761	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	189	24,882	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2	40	40	5,245	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	310	317	41,556	2025/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	420	432	56,709	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	120	118	15,526	2031/ 6/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	140	18,450	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	90	88	11,606	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	204	26,848	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	70	74	9,818	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	240	266	34,914	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	60	66	8,752	2057/ 6/22

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	340	387	50,753	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	210	220	28,833	2019/ 9/28
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	140	175	22,954	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	329	43,202	2020/ 9/28
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	150	220	28,922	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	250	290	38,058	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	170	233	30,592	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	310	357	46,803	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	260	309	40,497	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	290	445	58,402	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	261	34,264	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	350	549	71,966	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	493	64,703	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	290	292	38,366	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	190	199	26,196	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	80	79	10,433	2047/ 2/20
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	249	32,666	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	200	217	28,468	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	40	43	5,645	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	100	117	15,416	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	220	303	39,713	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	220	254	33,287	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	320	360	47,180	2021/ 9/15
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	172	22,560	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	83	10,943	2062/ 1/26
3.900% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	262	34,404	2020/ 7/15
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	372	48,781	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	240	31,507	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	320	479	62,762	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.375% FINNISH GOV' T	国債証券	0.375	40	40	5,335	2020/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	100	99	13,077	2026/ 4/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	110	106	14,003	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	92	12,155	2025/ 9/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	117	15,414	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	107	14,053	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	99	13,006	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	90	115	15,194	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	155	20,350	2028/ 7/ 4
3.375% FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	118	15,479	2020/ 4/15
3.500% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	177	23,301	2021/ 4/15
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	100	125	16,406	2025/ 7/ 4
4.375% FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	130	137	17,990	2019/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.800% IRISH GOV' T	国債証券	0.8	30	31	4,062	2022/ 3/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	160	163	21,431	2026/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	100	102	13,419	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	190	201	26,343	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	210	239	31,339	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	120	141	18,533	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	94	12,397	2023/ 3/20
4.400% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	110	115	15,182	2019/ 6/18
4.500% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	54	7,177	2020/ 4/18
5.000% IRISH GOV' T	国債証券	5.0	240	271	35,568	2020/10/18
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	280	371	48,711	2025/ 3/13
5.900% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	272	35,736	2019/10/18
小計	—	—	—	—	12,815,178	—

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	150	146	21,832	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	560	569	84,809	2021/ 1/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	433	64,539	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	200	182	27,153	2047/ 7/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	30	30	4,522	2019/ 7/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	770	793	118,081	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	130	127	18,921	2037/ 9/ 7
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	500	512	76,370	2020/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	460	482	71,857	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	440	464	69,197	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	320	403	60,117	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	320	349	52,036	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	410	520	77,446	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	380	504	75,174	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	320	518	77,165	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	240	249	37,165	2019/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	390	416	62,014	2020/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	400	437	65,093	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	476	70,957	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	300	334	49,766	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	250	419	62,418	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	299	44,541	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	458	68,333	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	409	61,001	2036/ 3/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	367	54,733	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	270	386	57,574	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	514	76,668	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	407	60,691	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	330	554	82,505	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	482	71,819	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	370	557	83,080	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	321	47,895	2020/ 3/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	290	390	58,151	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	250	372	55,483	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	300	373	55,560	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	170	243	36,260	2028/12/ 7
8.000% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	36	5,431	2021/ 6/ 7
小計	—	—	—	—	2,166,377	—
(スイス)		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
2.000% SWITZERLAND	国債証券	2.0	60	64	7,099	2021/ 4/28
3.000% SWITZERLAND	国債証券	3.0	130	134	14,802	2019/ 5/12
4.000% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	121	13,297	2023/ 2/11
4.000% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	138	15,173	2028/ 4/ 8
小計	—	—	—	—	50,373	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円	
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	780	807	10,260	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,200	1,288	16,376	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	700	802	10,203	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,860	2,133	27,115	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,899	24,147	2039/ 3/30
5.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	2,000	2,280	28,981	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	117,084	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.5	880	862	11,775	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	842	11,513	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	300	297	4,058	2027/ 2/17
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,393	19,032	2023/ 5/24

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)						
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	千ノルウェークロネ 480	千ノルウェークロネ 517	千円 7,064	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,506	20,583	2021/ 5/25
4.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	1,330	1,379	18,847	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	92,875	—
(デンマーク)						
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	千デンマーククロネ 450	千デンマーククロネ 445	千円 7,832	2027/11/15
1.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	840	903	15,898	2023/11/15
1.750%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,310	1,443	25,393	2025/11/15
3.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,570	1,750	30,797	2021/11/15
4.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,820	1,944	34,209	2019/11/15
4.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,370	3,921	68,973	2039/11/15
小計	—	—	—	—	183,105	—
(ポーランド)						
1.500% POLAND GOV' T	国債証券	1.5	千ポーランドズロチ 710	千ポーランドズロチ 709	千円 21,741	2020/ 4/25
1.750% POLAND GOV' T	国債証券	1.75	210	208	6,391	2021/ 7/25
2.000% POLAND GOV' T	国債証券	2.0	420	421	12,910	2021/ 4/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	658	20,188	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	490	462	14,186	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	260	249	7,648	2028/ 4/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	410	419	12,842	2019/ 7/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	430	436	13,386	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	780	833	25,547	2023/10/25
5.250% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	630	683	20,958	2020/10/25
5.500% POLAND GOV' T	国債証券	5.5	400	423	12,972	2019/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	280	314	9,637	2021/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	752	23,054	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	201,466	—
(オーストラリア)						
1.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.75	千オーストラリアドル 590	千オーストラリアドル 583	千円 48,272	2020/11/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	410	389	32,223	2028/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	410	414	34,286	2019/10/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	460	465	38,522	2024/ 4/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	450	449	37,119	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	230	19,077	2035/ 6/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	290	273	22,648	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	660	686	56,761	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	610	636	52,602	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	260	283	23,458	2037/ 4/21
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	400	444	36,735	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	540	565	46,731	2020/ 4/15
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	280	328	27,191	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	470	544	45,048	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	310	354	29,274	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	450	496	41,033	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	720	818	67,688	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	658,676	—
(シンガポール)						
1.625% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.625	千シンガポールドル 30	千シンガポールドル 29	千円 2,459	2019/10/ 1
2.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.0	70	70	5,760	2020/ 7/ 1
2.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	120	120	9,896	2021/ 6/ 1
2.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.5	90	90	7,452	2019/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	120	122	10,080	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	136	11,210	2042/ 4/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	250	258	21,261	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	60	62	5,139	2022/ 9/ 1
3.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.25	100	102	8,444	2020/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	190	203	16,733	2033/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	220	236	19,426	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	117,866	—
(マレーシア)		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
3.480% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	293	8,143	2023/ 3/15
3.492% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.492	410	407	11,330	2020/ 3/31
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	407	11,325	2027/ 5/31
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	30	29	828	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	520	476	13,241	2033/ 4/15
3.889% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	300	8,349	2020/ 7/31
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	300	295	8,206	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	150	146	4,073	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	589	16,372	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	251	6,995	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	766	21,299	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	310	311	8,657	2024/ 7/15
4.378% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	212	5,896	2019/11/29
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	240	240	6,671	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	140	136	3,794	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	160	159	4,435	2037/ 4/ 7
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	180	5,025	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	144,646	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
10.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	2,870	3,246	28,891	2026/12/21
6.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	2,560	1,922	17,113	2036/ 3/31
6.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,120	2,312	20,584	2041/ 2/28
6.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	1,980	1,946	17,324	2021/ 3/31
7.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,813	25,040	2031/ 2/28
7.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	750	750	6,681	2020/ 1/15
7.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	1,010	1,010	8,993	2023/ 2/28
8.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	1,150	1,086	9,672	2030/ 1/31
8.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	920	870	7,749	2032/ 3/31
8.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.5	1,850	1,741	15,498	2037/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	1,880	1,780	15,850	2044/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	2,790	2,645	23,542	2048/ 2/28
8.875% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.875	550	540	4,812	2035/ 2/28
小計	—	—	—	—	201,753	—
合計	—	—	—	—	30,989,973	—

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

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

日立外国債券インデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率			
14期(2014年4月31日)	19,973	14.8	98.5	—	百万円 27,974
15期(2015年3月31日)	22,540	12.9	98.8	—	31,958
16期(2016年3月31日)	21,780	△3.4	98.7	—	31,196
17期(2017年3月31日)	20,758	△4.7	98.9	—	29,623
18期(2018年4月2日)	21,500	3.6	98.9	—	31,109

(注) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券組入 比率	債券先物 比率
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2017年 3月31日	20,758	—	21,736	—	98.9	—
4月末	20,876	0.6	21,869	0.6	98.4	—
5月末	21,199	2.1	22,196	2.1	98.8	—
6月末	21,614	4.1	22,613	4.0	98.8	—
7月末	21,585	4.0	22,603	4.0	98.8	—
8月末	21,897	5.5	22,925	5.5	98.8	—
9月末	22,139	6.7	23,184	6.7	98.8	—
10月末	22,134	6.6	23,187	6.7	98.7	—
11月末	22,171	6.8	23,207	6.8	98.8	—
12月末	22,442	8.1	23,495	8.1	98.8	—
2018年 1月末	21,886	5.4	22,916	5.4	98.7	—
2月末	21,325	2.7	22,332	2.7	98.6	—
3月末	21,454	3.4	22,481	3.4	98.9	—
(期末) 2018年 4月2日	21,500	3.6	22,528	3.6	98.9	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

(注3) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年3月28日を10,000としています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCが開発した債券指数です。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項目	当期
	(2017.4.1～2018.4.2)
	金額
(a) その他費用	4円
(保管費用)	(4)
(その他)	(0)
合計	4

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

(a) その他費用は、期中の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) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2017年4月1日から2018年4月2日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額		
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル	千米ドル		
			37,985	31,196		
	カナダ	国債証券	千カナダドル	千カナダドル		
			2,408	1,988		
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ	千メキシコペソ		
			9,541	10,611		
	ユー ロ	ドイツ	国債証券	千ユーロ	千ユーロ	
				3,466	3,564	
				イタリア	3,930	3,348
				フランス	4,327	3,423
				オランダ	1,109	1,351
				スペイン	2,943	1,894
				ベルギー	855	935
				オーストリア	680	430
				フィンランド	106	56
	アイルランド	339	215			
	国	イギリス	国債証券	千英ポンド	千英ポンド	
				2,319	2,410	
		スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	
1,043				2,053		
ノルウェー		国債証券	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
			994	-		
デンマーク		国債証券	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
			1,157	1,337		
ポーランド		国債証券	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
			854	898		
オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
		1,394	613			
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル	千シンガポールドル			
		363	322			
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit	千マレーシアリングgit			
		1,648	1,301			
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド	千南アフリカランド			
		4,516	1,008			

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2017年4月1日から2018年4月2日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	155,853	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	96,304
2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	121,684	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	89,161
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,582	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	89,031
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,265	1.250% UK TREASURY(イギリス)	84,505
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	106,497	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	77,311
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	103,128	4.250% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	76,514
1.750% UK TREASURY(イギリス)	98,661	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,851
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	82,288	1.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,757
3.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	82,156	4.500% BUONI POLIENNALI(ユーロ・イタリア)	75,648
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	80,478	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	75,463

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2017年4月1日から2018年4月2日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細(2018年4月2日現在)

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 122,810	千米ドル 121,788	千円 12,946,134	% 41.6	% —	% 17.5	% 16.8	% 7.3
カナダ	千カナダドル 7,090	千カナダドル 7,662	631,816	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 41,840	千メキシコペソ 42,103	246,305	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	14,440	16,940	2,218,375	7.1	—	4.2	2.4	0.5
イタリア	20,590	23,714	3,105,404	10.0	—	6.0	2.8	1.2
フランス	21,230	25,006	3,274,551	10.5	—	6.8	2.7	1.1
オランダ	4,410	5,183	678,715	2.2	—	1.4	0.6	0.2
スペイン	12,250	14,648	1,918,175	6.2	—	4.0	1.5	0.6
ベルギー	4,990	6,106	799,698	2.6	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	3,030	3,715	486,490	1.6	—	1.1	0.4	—
フィンランド	1,360	1,506	197,333	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	1,760	2,015	263,989	0.8	—	0.5	0.2	0.2
イギリス	千英ポンド 11,770	千英ポンド 14,916	2,226,588	7.2	—	5.3	1.5	0.3
スイス	千スイスフラン 390	千スイスフラン 463	51,587	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 7,920	千スウェーデンクローナ 9,276	117,901	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 6,590	千ノルウェークローネ 6,806	92,166	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 8,160	千デンマーククローネ 10,300	180,978	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 6,430	千ポーランドズロチ 6,668	207,261	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 7,470	千オーストラリアドル 7,949	649,938	2.1	—	1.3	0.7	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 1,390	千シンガポールドル 1,452	117,894	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 5,290	千マレーシアリンギット 5,272	145,455	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 24,700	千南アフリカランド 23,376	210,158	0.7	—	0.6	0.1	0.0
合 計	—	—	30,766,921	98.9	—	54.0	32.2	12.7

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	610	598	63,667	2019/ 7/15
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	550	539	57,309	2019/ 8/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	430	423	44,998	2019/ 6/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	334	35,517	2019/ 7/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	460	451	47,954	2019/ 9/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	640	630	67,032	2019/ 6/30
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	294	31,346	2019/ 8/31
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	392	41,746	2019/ 9/30
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	420	412	43,815	2019/10/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	480	470	50,007	2019/11/15
1.000% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	362	38,532	2019/11/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	290	286	30,448	2019/ 5/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	500	490	52,120	2019/12/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	439	46,747	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	410	400	42,541	2020/ 4/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	600	578	61,507	2021/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	600	575	61,173	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	570	545	58,034	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	200	191	20,308	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	560	553	58,835	2019/ 6/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	660	651	69,209	2019/ 8/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	270	265	28,263	2019/10/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	720	706	75,130	2020/ 1/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	500	490	52,116	2020/ 2/29
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	730	705	75,028	2021/ 3/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	620	578	61,513	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	692	73,596	2019/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	600	592	62,967	2019/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	460	453	48,175	2019/12/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	300	295	31,391	2020/ 1/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	420	413	43,937	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	200	196	20,904	2020/ 2/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	521	55,383	2020/ 2/29
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	590	579	61,580	2020/ 3/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	608	64,644	2020/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	617	65,619	2020/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	683	72,706	2020/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	270	263	28,039	2020/ 9/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	660	644	68,480	2020/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	500	487	51,829	2020/10/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	602	64,083	2021/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	450	436	46,366	2021/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	210	203	21,606	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	670	630	66,997	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	656	69,823	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	520	487	51,778	2023/ 9/30
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	595	63,291	2019/ 5/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,170	1,156	122,913	2019/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	850	839	89,253	2019/11/30
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	380	373	39,715	2020/ 5/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	750	736	78,329	2020/ 5/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	491	52,215	2020/ 6/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	761	80,926	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	720	684	72,786	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	550	522	55,541	2023/ 3/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,310	1,189	126,437	2026/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,070	1,062	112,941	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	655	69,631	2019/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	545	57,980	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	800	791	84,109	2019/12/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	780	767	81,624	2020/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	649	69,028	2020/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	760	746	79,317	2020/10/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,110	1,088	115,716	2020/11/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	640	616	65,523	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,340	1,286	136,755	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	500	477	50,741	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	400	381	40,553	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	420	398	42,368	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,240	1,144	121,627	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,011	107,566	2026/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	486	51,712	2019/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	620	610	64,896	2020/10/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	492	52,319	2020/11/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	650	639	67,950	2020/12/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	450	438	46,616	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	730	709	75,458	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	699	74,389	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	640	68,091	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	640	68,097	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	727	77,308	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	465	49,449	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	589	62,684	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	825	87,789	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	260	257	27,368	2020/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	646	68,700	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	630	615	65,409	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	370	361	38,387	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	400	390	41,463	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	487	51,821	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	580	564	59,977	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	485	51,638	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	476	50,704	2024/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	597	63,471	2020/ 1/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	630	625	66,466	2020/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	515	54,805	2020/ 9/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	594	63,167	2020/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	510	504	53,615	2021/ 2/28
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	661	70,297	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	709	75,387	2021/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	708	75,304	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	856	90,999	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	766	81,443	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	645	68,656	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	510	498	52,946	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,308	139,047	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,052	111,871	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	529	56,322	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	320	308	32,745	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	380	365	38,872	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,050	1,004	106,784	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,210	1,152	122,563	2025/ 8/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,110	1,047	111,319	2026/11/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	566	60,269	2020/ 8/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	610	605	64,376	2021/ 1/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	683	72,630	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	969	103,050	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	700	691	73,549	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	490	483	51,423	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	610	64,865	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	740	725	77,156	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	460	448	47,633	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	480	466	49,584	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	530	514	54,706	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	460	445	47,366	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	483	51,422	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	770	743	79,075	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,070	1,030	109,529	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	507	53,980	2021/ 3/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	660	656	69,823	2021/ 4/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	626	66,545	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	500	489	52,049	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	430	418	44,534	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,080	1,051	111,790	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,270	1,229	130,676	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	960	922	98,109	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	910	872	92,772	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,500	1,437	152,760	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	671	71,370	2046/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	330	330	35,081	2020/12/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	510	505	53,768	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,210	1,189	126,392	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	990	960	102,153	2027/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	890	885	94,156	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,330	1,318	140,186	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	300	296	31,526	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	702	74,689	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	630	573	60,920	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	580	527	56,028	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	825	87,738	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,150	1,157	123,028	2020/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	960	966	102,733	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,066	113,399	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	472	50,276	2042/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	482	51,273	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,160	1,107	117,768	2047/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	570	561	59,691	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	780	765	81,391	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	744	79,178	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	303	32,223	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	700	704	74,869	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	770	774	82,317	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	690	693	73,725	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	720	723	76,888	2047/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	780	796	84,650	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	278	29,638	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	382	40,615	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	410	422	44,897	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	640	658	70,019	2044/ 8/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	780	794	84,403	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	900	967	102,837	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	550	563	59,885	2020/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	80	87	9,340	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	380	387	41,151	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	750	768	81,686	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,000	1,034	109,962	2021/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	749	79,689	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	963	102,373	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	270	307	32,683	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	830	947	100,725	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	312	33,252	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	210	255	27,155	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	290	354	37,647	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	309	32,896	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	450	557	59,281	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	398	42,344	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	250	308	32,828	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	37	3,989	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	250	314	33,418	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	420	537	57,108	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	470	613	65,245	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	171	18,209	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	240	295	31,359	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	147	15,724	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	294	31,327	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	149	15,913	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	172	18,368	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	120	154	16,407	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	236	25,159	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	100	135	14,426	2030/ 5/15
6.500% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	116	12,357	2026/11/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	309	32,925	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	151	16,077	2019/ 8/15
8.750% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	241	25,634	2020/ 8/15
小計	—	—	—	—	12,946,134	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	300	296	24,431	2019/ 8/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	400	387	31,921	2021/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	310	298	24,576	2021/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	590	586	48,384	2020/ 3/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	350	341	28,184	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	320	306	25,251	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV'T	国債証券	1.75	480	480	39,599	2019/ 9/ 1
2.250% CANADA GOV'T	国債証券	2.25	460	465	38,404	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV'T	国債証券	2.5	310	318	26,259	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	420	433	35,742	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	220	245	20,236	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	120	139	11,483	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV'T	国債証券	3.25	440	457	37,764	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	470	486	40,124	2020/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	200	251	20,758	2045/12/ 1
3.750% CANADA GOV'T	国債証券	3.75	560	573	47,293	2019/ 6/ 1
4.000% CANADA GOV'T	国債証券	4.0	290	381	31,486	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV'T	国債証券	5.0	310	444	36,683	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	240	325	26,853	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	200	292	24,083	2033/ 6/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
8.000% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	149	12,292	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	631,816	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
5.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	6,270	6,041	35,340	2019/12/11
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	2,844	16,641	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	3,960	3,870	22,642	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	2,100	2,045	11,965	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,127	18,296	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,355	13,776	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	1,500	1,532	8,963	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,220	24,690	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,570	4,643	27,164	2020/ 6/11
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,290	25,098	2023/12/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,231	18,906	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,900	22,817	2038/11/18
小計	—	—	—	—	246,305	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	430	435	56,989	2020/ 4/17
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	415	54,430	2021/ 4/ 9
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	415	54,387	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	190	191	25,104	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	360	350	45,892	2026/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	300	304	39,827	2019/10/11
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	490	499	65,468	2020/10/16
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	530	524	68,633	2027/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	360	368	48,292	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	450	458	60,041	2026/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	300	317	41,575	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	750	794	103,987	2025/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	340	366	47,951	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	230	248	32,561	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	335	43,939	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	337	44,195	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	600	651	85,350	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	280	308	40,405	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	320	348	45,595	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	310	344	45,100	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	390	416	54,573	2020/ 9/ 4
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	403	52,846	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	560	606	79,462	2021/ 1/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	360	475	62,246	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	450	601	78,780	2046/ 8/15
3.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	464	60,880	2020/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	390	416	54,594	2020/ 1/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	280	313	41,080	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	270	397	52,073	2042/ 7/ 4
3.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.5	530	557	73,047	2019/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	390	597	78,250	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	270	440	57,645	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	190	270	35,484	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	591	77,410	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	290	508	66,540	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	260	414	54,277	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	340	508	66,544	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	200	272	35,649	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	140	230	30,172	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	280	435	57,085	2027/ 7/ 4

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.05	100	100	13,165	2019/10/15
0.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.1	220	221	28,953	2019/ 4/15
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	140	140	18,441	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	200	202	26,499	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	340	346	45,364	2020/11/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	260	257	33,709	2023/10/15
0.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.7	360	366	48,018	2020/ 5/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	320	324	42,461	2023/ 3/15
1.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	270	275	36,141	2019/12/ 1
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	360	350	45,864	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	440	456	59,767	2022/ 4/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	290	301	39,486	2022/ 9/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	350	358	46,973	2019/ 8/ 1
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	330	334	43,753	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	300	301	39,536	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	346	45,428	2032/ 3/ 1
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	370	385	50,433	2025/12/ 1
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	427	56,015	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	470	490	64,168	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	250	242	31,729	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	130	131	17,283	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	330	340	44,557	2019/ 5/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	455	59,596	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	260	255	33,468	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	190	178	23,437	2067/ 3/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	270	294	38,588	2046/ 9/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	250	278	36,512	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	380	436	57,160	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	470	521	68,279	2021/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	300	333	43,708	2021/ 5/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	705	92,398	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	370	430	56,344	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	520	572	74,910	2020/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	652	85,449	2037/ 2/ 1
4.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	511	66,954	2019/ 9/ 1
4.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	521	68,274	2020/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	460	500	65,525	2020/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	330	392	51,372	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	680	817	107,077	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	320	393	51,529	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	350	404	52,973	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	510	616	80,769	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	390	495	64,890	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	290	394	51,646	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	543	71,163	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	370	462	60,574	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	410	556	72,926	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	485	63,533	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	360	498	65,235	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	500	669	87,677	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	499	65,399	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	460	562	73,669	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	330	473	62,015	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	480	692	90,682	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	939	123,028	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	320	41,968	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	144	18,910	2023/11/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	500	505	66,142	2020/ 5/25
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	320	323	42,310	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV'T	国債証券	—	340	341	44,776	2022/ 5/25
0.250% FRANCE GOV'T	国債証券	0.25	410	416	54,602	2020/11/25
0.250% FRANCE GOV'T	国債証券	0.25	650	634	83,108	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	650	661	86,615	2019/11/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	500	506	66,286	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV'T	国債証券	0.5	560	561	73,566	2026/ 5/25
0.750% FRANCE GOV'T	国債証券	0.75	240	240	31,478	2028/ 5/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	340	346	45,328	2019/ 5/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	590	617	80,806	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV'T	国債証券	1.0	320	331	43,391	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV'T	国債証券	1.25	380	381	49,935	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV'T	国債証券	1.5	650	692	90,709	2031/ 5/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	670	729	95,545	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	600	659	86,340	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	230	232	30,422	2066/ 5/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	830	918	120,307	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	590	665	87,095	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	650	698	91,526	2020/10/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	610	723	94,769	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV'T	国債証券	2.75	730	874	114,578	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV'T	国債証券	3.0	740	835	109,471	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	760	855	111,992	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	450	628	82,239	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	650	703	92,173	2020/ 4/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	670	835	109,381	2026/ 4/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	700	747	97,898	2019/10/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	730	822	107,657	2021/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	480	719	94,170	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	310	514	67,394	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	270	460	60,311	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	650	683	89,492	2019/ 4/25
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	770	949	124,385	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	620	1,010	132,289	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	440	690	90,379	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	520	782	102,495	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	640	1,055	138,241	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	313	41,078	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	80	91	11,974	2019/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	243	31,878	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	340	343	44,972	2022/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	230	233	30,597	2020/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	280	279	36,556	2025/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	300	302	39,575	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	170	173	22,711	2027/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	371	48,703	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	290	323	42,376	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	342	44,901	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.5	280	343	44,956	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.75	160	222	29,167	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.25	280	313	41,084	2021/ 7/15
3.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.5	320	349	45,817	2020/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	300	470	61,575	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	210	222	29,152	2019/ 7/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	270	412	53,975	2037/ 1/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
5.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	250	368	48,281	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	109	14,311	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.400% SPANISH GOV' T	国債証券	0.4	320	325	42,603	2022/ 4/30
0.750% SPANISH GOV' T	国債証券	0.75	450	463	60,724	2021/ 7/30
1.150% SPANISH GOV' T	国債証券	1.15	260	268	35,190	2020/ 7/30
1.300% SPANISH GOV' T	国債証券	1.3	420	431	56,456	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	280	288	37,835	2020/ 1/31
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	50	51	6,742	2027/10/31
1.500% SPANISH GOV' T	国債証券	1.5	470	487	63,891	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	446	58,513	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	270	291	38,227	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	540	570	74,694	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	440	483	63,316	2025/10/31
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	390	403	52,796	2019/ 4/30
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	480	547	71,731	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	150	172	22,582	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	310	389	51,059	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	370	443	58,054	2024/ 4/30
4.000% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	500	544	71,354	2020/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	440	607	79,616	2037/ 1/31
4.300% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	365	47,799	2019/10/31
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	370	452	59,285	2023/10/31
4.600% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	370	394	51,639	2019/ 7/30
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	340	435	57,060	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	270	405	53,080	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	400	501	65,642	2024/ 1/31
4.850% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	350	396	51,886	2020/10/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	320	488	63,937	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	380	527	69,078	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	230	371	48,596	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	390	487	63,889	2023/ 1/31
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	480	564	73,893	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	530	819	107,270	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	564	73,952	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	330	462	60,498	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	192	25,269	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2	40	40	5,261	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	310	319	41,812	2025/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	420	436	57,143	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	120	120	15,739	2031/ 6/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	143	18,855	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	90	91	11,969	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	209	27,460	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	70	78	10,245	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	240	267	35,079	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	60	69	9,072	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	340	390	51,103	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	210	221	28,962	2019/ 9/28
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	140	178	23,378	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	331	43,398	2020/ 9/28
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	150	226	29,713	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	250	292	38,279	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	170	237	31,092	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	310	359	47,065	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	260	311	40,754	2022/ 9/28

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	290	456	59,781	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	264	34,612	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	350	560	73,409	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	500	65,506	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	290	295	38,693	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	190	201	26,393	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	80	82	10,758	2047/ 2/20
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	250	32,838	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	200	218	28,581	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	40	45	5,925	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	50	59	7,843	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	220	311	40,810	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	220	255	33,493	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	320	362	47,405	2021/ 9/15
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	173	22,689	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	86	11,311	2062/ 1/26
3.900% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	263	34,567	2020/ 7/15
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	380	49,774	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	243	31,827	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	320	485	63,576	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.375% FINNISH GOV' T	国債証券	0.375	40	40	5,341	2020/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	100	100	13,165	2026/ 4/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	110	108	14,191	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	93	12,229	2025/ 9/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	118	15,481	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	107	14,108	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	99	13,081	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	90	118	15,555	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	157	20,595	2028/ 7/ 4
3.375% FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	118	15,549	2020/ 4/15
3.500% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	178	23,399	2021/ 4/15
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	100	126	16,544	2025/ 7/ 4
4.375% FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	130	138	18,089	2019/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.800% IRISH GOV' T	国債証券	0.8	30	31	4,074	2022/ 3/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	160	164	21,547	2026/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	40	41	5,440	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	190	204	26,761	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	210	241	31,687	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	120	142	18,635	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	95	12,463	2023/ 3/20
4.400% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	110	116	15,270	2019/ 6/18
4.500% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	55	7,220	2020/ 4/18
5.000% IRISH GOV' T	国債証券	5.0	240	273	35,818	2020/10/18
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	280	374	49,059	2025/ 3/13
5.900% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	275	36,011	2019/10/18
小 計	—	—	—	—	12,942,734	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	150	147	22,085	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	560	569	85,037	2021/ 1/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	436	65,225	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	170	161	24,122	2047/ 7/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	30	30	4,537	2019/ 7/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	770	795	118,673	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	130	130	19,550	2037/ 9/ 7

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	500	513	76,642	2020/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	460	486	72,612	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	440	466	69,691	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	320	427	63,801	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	320	351	52,495	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	410	538	80,374	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	380	522	78,010	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	320	544	81,250	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	310	323	48,258	2019/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	390	417	62,331	2020/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	400	438	65,481	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	497	74,219	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	300	335	50,136	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	250	440	65,697	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	302	45,200	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	467	69,814	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	420	62,742	2036/ 3/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	378	56,538	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	270	398	59,499	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	534	79,710	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	424	63,311	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	330	580	86,612	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	493	73,659	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	370	576	86,004	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	322	48,206	2020/ 3/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	290	396	59,222	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	250	383	57,286	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	300	376	56,222	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	170	246	36,840	2028/12/ 7
8.000% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	36	5,478	2021/ 6/ 7
小計	—	—	—	—	2,226,588	—
(スイス)		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
2.000% SWITZERLAND	国債証券	2.0	60	65	7,263	2021/ 4/28
3.000% SWITZERLAND	国債証券	3.0	130	135	15,113	2019/ 5/12
4.000% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	122	13,632	2023/ 2/11
4.000% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	139	15,577	2028/ 4/ 8
小計	—	—	—	—	51,587	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円	
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	780	812	10,328	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,200	1,293	16,444	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	700	807	10,260	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,860	2,145	27,269	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,923	24,450	2039/ 3/30
5.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	2,000	2,293	29,149	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	117,901	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.5	880	861	11,663	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	842	11,403	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	300	297	4,029	2027/ 2/17
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,393	18,863	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	480	517	7,012	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,509	20,436	2021/ 5/25
4.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	1,330	1,385	18,757	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	92,166	—
(デンマーク)		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	250	249	4,377	2027/11/15
1.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	840	907	15,948	2023/11/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)						
1.750%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	千デンマーククローネ 1,310	千デンマーククローネ 1,453	千円 25,539	2025/11/15
3.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,570	1,759	30,911	2021/11/15
4.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,820	1,955	34,353	2019/11/15
4.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,370	3,975	69,848	2039/11/15
小計	—	—	—	—	180,978	—
(ポーランド)						
0.000% POLAND GOV'T	国債証券	—	千ポーランドズロチ 60	千ポーランドズロチ 59	千円 1,838	2019/ 4/25
1.500% POLAND GOV'T	国債証券	1.5	710	709	22,062	2020/ 4/25
1.750% POLAND GOV'T	国債証券	1.75	210	209	6,501	2021/ 7/25
2.000% POLAND GOV'T	国債証券	2.0	420	422	13,135	2021/ 4/25
2.500% POLAND GOV'T	国債証券	2.5	690	664	20,641	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV'T	国債証券	2.5	490	465	14,473	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV'T	国債証券	2.75	260	250	7,786	2028/ 4/25
3.250% POLAND GOV'T	国債証券	3.25	410	420	13,053	2019/ 7/25
3.250% POLAND GOV'T	国債証券	3.25	430	439	13,673	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV'T	国債証券	4.0	780	839	26,092	2023/10/25
5.250% POLAND GOV'T	国債証券	5.25	630	687	21,372	2020/10/25
5.500% POLAND GOV'T	国債証券	5.5	400	425	13,221	2019/10/25
5.750% POLAND GOV'T	国債証券	5.75	280	316	9,839	2021/10/25
5.750% POLAND GOV'T	国債証券	5.75	660	758	23,569	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	207,261	—
(オーストラリア)						
1.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	1.75	千オーストラリアドル 590	千オーストラリアドル 585	千円 47,886	2020/11/21
2.250% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	2.25	410	397	32,472	2028/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	2.75	410	415	33,933	2019/10/21
2.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	2.75	460	467	38,252	2024/ 4/21
2.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	2.75	450	453	37,049	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	2.75	240	233	19,094	2035/ 6/21
3.000% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	3.0	290	279	22,840	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	3.25	660	692	56,584	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	3.25	530	561	45,885	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	3.75	260	285	23,323	2037/ 4/21
4.250% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	4.25	400	447	36,595	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	4.5	540	566	46,344	2020/ 4/15
4.500% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	4.5	280	333	27,299	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	4.75	470	551	45,125	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	5.5	310	356	29,165	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	5.75	450	499	40,806	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV'T	国債証券	5.75	720	822	67,279	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	649,938	—
(シンガポール)						
1.625% SINGAPORE GOV'T	国債証券	1.625	千シンガポールドル 30	千シンガポールドル 29	千円 2,429	2019/10/ 1
2.000% SINGAPORE GOV'T	国債証券	2.0	70	70	5,695	2020/ 7/ 1
2.250% SINGAPORE GOV'T	国債証券	2.25	120	120	9,786	2021/ 6/ 1
2.500% SINGAPORE GOV'T	国債証券	2.5	90	90	7,366	2019/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV'T	国債証券	2.75	120	123	10,054	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV'T	国債証券	2.75	140	138	11,281	2042/ 4/ 1
3.000% SINGAPORE GOV'T	国債証券	3.0	250	261	21,248	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV'T	国債証券	3.125	60	62	5,079	2022/ 9/ 1
3.250% SINGAPORE GOV'T	国債証券	3.25	100	102	8,353	2020/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV'T	国債証券	3.375	190	209	17,026	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV'T	国債証券	3.5	220	241	19,574	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	117,894	—
(マレーシア)						
3.480% MALAYSIAN GOV'T	国債証券	3.48	千マレーシアリンギット 300	千マレーシアリンギット 296	千円 8,169	2023/ 3/15
3.492% MALAYSIAN GOV'T	国債証券	3.492	410	410	11,313	2020/ 3/31
3.502% MALAYSIAN GOV'T	国債証券	3.502	430	409	11,286	2027/ 5/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)		%	千マレーシアリングgit	千マレーシアリングgit	千円	
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	30	30	829	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	520	488	13,464	2033/ 4/15
3.889% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	302	8,356	2020/ 7/31
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	300	299	8,253	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	150	148	4,101	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	599	16,541	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	254	7,010	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	775	21,398	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	310	315	8,701	2024/ 7/15
4.378% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	213	5,892	2019/11/29
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	240	243	6,713	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	140	138	3,830	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	160	164	4,531	2037/ 4/ 7
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	183	5,059	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	145,455	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
10.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	2,870	3,316	29,818	2026/12/21
6.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	2,560	1,990	17,895	2036/ 3/31
6.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,120	2,410	21,667	2041/ 2/28
6.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	1,980	1,966	17,675	2021/ 3/31
7.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,900	26,078	2031/ 2/28
7.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	750	755	6,795	2020/ 1/15
7.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	1,010	1,025	9,222	2023/ 2/28
8.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	1,150	1,123	10,102	2030/ 1/31
8.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	920	899	8,085	2032/ 3/31
8.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.5	1,850	1,812	16,293	2037/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	1,880	1,855	16,678	2044/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	2,790	2,758	24,796	2048/ 2/28
8.875% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.875	550	561	5,047	2035/ 2/28
小計	—	—	—	—	210,158	—
合計	—	—	—	—	30,766,921	—

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

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注3) ー印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2018年4月2日現在)

項目	当 期 末	
	評価額	比率
公 社 債	千円 30,766,922	% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	762,292	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	31,529,214	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(31,069,222千円)の投資信託財産総額(31,529,214千円)に対する比率は98.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年4月2日における邦貨換算レートは1米ドル=106.30円、1カナダドル=82.46円、1メキシコペソ=5.85円、1ユーロ=130.95円、1英ポンド=149.27円、1スイスフラン=111.38円、1スウェーデンクローナ=12.71円、1ノルウェークローネ=13.54円、1デンマーククローネ=17.57円、1ポーランドズロチ=31.08円、1オーストラリアドル=81.76円、1シンガポールドル=81.18円、1マレーシアリングgit=27.59円、1南アフリカランド=8.99円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2018年4月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	31,689,795,765円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	156,964,344
公 社 債(評価額)	30,766,922,241
未 収 入 金	495,833,448
未 収 利 息	260,371,366
前 払 費 用	9,704,366
(B) 負 債	580,019,518
未 払 金	577,819,402
未 払 解 約 金	2,200,000
未 払 利 息	116
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	31,109,776,247
元 本	14,469,869,081
次 期 繰 越 損 益 金	16,639,907,166
(D) 受 益 権 総 口 数	14,469,869,081口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,500円

(注1) 当ファンドの期首元本額は14,271,352,859円、期中追加設定元本額は1,072,431,510円、期中一部解約元本額は873,915,288円です。

(注2) 元本の内訳

日立外国債券インデックスファンド	6,558,021,077円
日立外国債券特化型ファンドU(為替ヘッジなし)(非課税適格機関投資家専用)	5,609,889,848円
日立バランスファンド(株式50)	974,556,790円
日立バランスファンド(株式70)	972,165,496円
日立バランスファンド(株式30)	355,235,870円

(注3) 1口当たり純資産額は2,150円です。

■損益の状況

当期(自2017年4月1日 至2018年4月2日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	767,041,036円
受 取 利 息	767,080,147
支 払 利 息	△39,111
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	305,742,946
売 買 益	1,568,319,600
売 買 損	△1,262,576,654
(C) 信 託 報 酬 等	△5,091,021
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,067,692,961
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	15,352,437,484
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,223,030,193
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,003,253,472
(H) 計 (D+E+F+G)	16,639,907,166
次 期 繰 越 損 益 金(H)	16,639,907,166

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。