



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19期

(決算日 2020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19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			
		%		%	%	%	百万円
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
18期(2019年5月15日)	19,854	0.7	21,287	0.9	98.7	—	14,516
19期(2020年5月15日)	20,833	4.9	22,382	5.1	98.6	—	15,815

(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) 2019年 5月15日	19,854	—	21,287	—	98.7	—
5月末	19,923	0.3	21,362	0.4	98.7	—
6月末	20,180	1.6	21,638	1.7	98.8	—
7月末	20,235	1.9	21,704	2.0	98.9	—
8月末	20,369	2.6	21,847	2.6	98.9	—
9月末	20,460	3.1	21,949	3.1	99.0	—
10月末	20,657	4.0	22,166	4.1	98.9	—
11月末	20,667	4.1	22,179	4.2	98.7	—
12月末	20,754	4.5	22,276	4.7	98.9	—
2020年 1月末	20,917	5.4	22,461	5.5	98.8	—
2月末	21,165	6.6	22,718	6.7	98.9	—
3月末	21,197	6.8	22,726	6.8	98.9	—
4月末	20,790	4.7	22,327	4.9	98.4	—
(期末) 2020年 5月15日	20,833	4.9	22,382	5.1	98.6	—

(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。

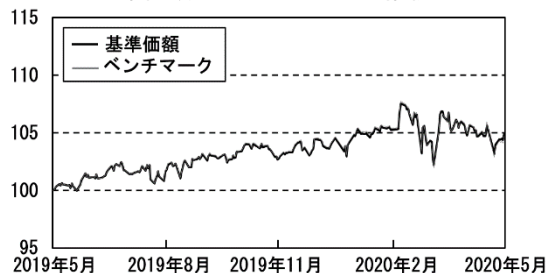
(注3) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(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

【基準価額の主な変動要因】

＜上昇要因＞

F R Bによる利下げや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大で景気の先行きに不透明感が高まった結果、金利が低下したことがプラスに影響しました。

＜下落要因＞

年明け以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景に相場が乱高下する局面において一時的に円高に振れたこと、金利が大幅に上昇したことなどがマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2019年5月15日	2020年2月21日	2019年6月3日	2020年5月15日
基準価額	19,854円	21,351円	19,850円	20,833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19,854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)とほぼ連動して動き、20,833円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は+4.9%となり、ベンチマーク騰落率+5.1%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】

当期は、期初より欧米長期金利の低下による債券価格の上昇、9月からは円安が進行したため、堅調な推移が続きました。2月以降は、新型コロナウイルス感染の拡大を背景に長期金利、為替が不安定な動きとなり、外国債券相場は大きく上下しましたが、各国の中央銀行による流動性供給を背景に、期末にかけて徐々に落ち着きを取り戻しました。結果、通期ではプラスの収益を確保しました。

米国金利

市場の金融緩和期待が高まるなか、F R B(連邦準備制度理事会)は7月に利下げに舵を切り、9月、10月と3会合連続で政策金利を引き下げた結果、米国長期金利は5月の2.5%前後から、

9月には1%半ばまで低下しました。追加利下げ観測の後退とともに、9月以降は1%台後半で安定的に推移しましたが、2月下旬から米国での新型コロナウイルス感染が急拡大し、株価が急落したことから再び大きく低下し、一時0.31%台をつけた後、0.6%台で期末を迎えました。年度では、短期ゾーンの低下幅が長期に比べ大きく「ブルスティープ」となりました。

ユーロ金利

ドイツ等コア国は、3月にやや上昇する局面もみられましたが、比較的落ち着いた展開が続く、年度を通してはやや低下しました。イタリアは、6月から緩和観測を背景に大きく低下し、9月に欧州中銀が大規模な緩和パッケージを発表した後は、緩やかな上昇に転じました。しかし3月以降、新型コロナウイルスの欧州での急拡大により、先行き不透明感が急速に高まり、イタリア、スペインの長期金利は急上昇し、欧州中銀による潤沢な流動性供給や量的緩和の拡大等で一旦低下に向かいましたが、4月以降も不安定な展開が続きました。

＜外国為替市況＞

米ドル・円レートは、期初より米国金利の低下等を背景に円高が進行しました。しかし、9月以降は株価の上昇からリスク選好が高まり、緩やかな上昇に転じました。年明け以降は新型コロナウイルス感染拡大を背景に乱高下し、3月には年度安値となる101円台を記録しましたが、投機的な動きに留まりその後は急反発し、年度では小幅の円高に留まりました。ユーロは、対ドルで安定的に推移しましたが、2月以降は新型コロナウイルス感染拡大を材料に乱高下し当期の高値と安値を記録し、小幅のユーロ安で期末を終えました。他の資源国、新興国通貨は、米中対立等を背景に神経質な展開が続きましたが、年明け以降、新型コロナウイルス感染拡大を背景に、グローバル景気後退懸念が高まり下落しました。

【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

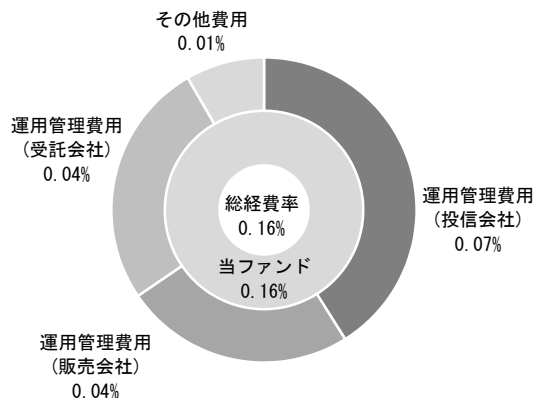
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2019. 5. 16～2020. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	32円	0.154%	信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は20,609円です。
（投 信 会 社）	(14)	(0.069)	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	(8)	(0.041)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(9)	(0.044)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)そ の 他 費 用	3	0.014	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕
（保 管 費 用）	(3)	(0.014)	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	35	0.168	

(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。

<参考情報>

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.16%です。



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

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

(注)各比率は、年率換算した値です。

(注)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2019年5月16日から2020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 674,711	千円 1,520,590	千口 431,768	千円 976,000

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2019年5月16日から2020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)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	208,254
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,107
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,925
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	144,559
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,765
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,033	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	133,482
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	128,420

(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(2019年5月16日から2020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(2020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	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日立外国債券インデックスマザーファンド	6,655,223	6,898,166	15,797,491

(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(2020年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立外国債券インデックスマザーファンド	15,797,491	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,619	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	15,942,110	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(40,031,807千円)の投資信託財産総額(40,069,301千円)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、2020年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=107.43円、1カナダドル=76.50円、1メキシコペソ=4.49円、1ユーロ=116.08円、1英ポンド=131.33円、1スウェーデンクローナ=10.97円、1ノルウェークローネ=10.59円、1デンマーククローネ=15.57円、1ポーランドズロチ=25.46円、1オーストラリアドル=69.45円、1シンガポールドル=75.47円、1マレーシアリングギット=24.72円、1イスラエルシェケル=30.32円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,942,110,481円
コール・ローン等	85,918,494
日立外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	15,797,491,987
未 収 入 金	58,700,000
(B) 負 債	126,981,259
未 払 解 約 金	114,988,911
未 払 信 託 報 酬	11,992,101
未 払 利 息	247
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,815,129,222
元 本	7,591,513,868
次 期 繰 越 損 益 金	8,223,615,354
(D) 受 益 権 総 口 数	7,591,513,868口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,833円

(注1) 当ファンドの期首元本額は7,311,701,258円、期中追加設定元本額は1,617,211,806円、期中一部解約元本額は1,337,399,196円です。

(注2) 1口当たり純資産額は2.0833円です。

■損益の状況

当期(自2019年5月16日 至2020年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△26,558円
支 払 利 息	△26,558
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	661,338,343
売 買 益	760,099,878
売 買 損	△98,761,535
(C) 信 託 報 酬 等	△25,887,449
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	635,424,336
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,506,028,700
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,082,162,318
(配 当 等 相 当 額)	(5,840,240,740)
(売 買 損 益 相 当 額)	(241,921,578)
(G) 計 (D+E+F)	8,223,615,354
次 期 繰 越 損 益 金(G)	8,223,615,354
追 加 信 託 差 損 益 金	6,082,162,318
(配 当 等 相 当 額)	(5,840,240,740)
(売 買 損 益 相 当 額)	(241,921,578)
分 配 準 備 積 立 金	2,141,479,594
繰 越 損 益 金	△26,558

(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(382,295,894円)、信託約款に規定する収益調整金(6,082,135,760円)および分配準備積立金(1,759,183,700円)より分配対象収益は8,223,615,354円(10,000口当たり10,832円)ですが、当期に分配した金額はありません。

＜お知らせ＞

2019年11月16日付で信託報酬率を年率0.187%（税抜0.17%）から年率0.154%（税抜0.14%）に引き下げる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(2020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(17,471,283千口)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	2020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	153,160	172,772	18,560,901	46.4	—	20.9	17.2	8.3
カナダ	千カナダドル 8,470	千カナダドル 10,012	765,926	1.9	—	0.9	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 59,900	千メキシコペソ 65,734	295,149	0.7	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	19,870	24,549	2,849,679	7.1	—	4.3	2.0	0.8
イタリア	26,470	29,572	3,432,758	8.6	—	5.0	2.4	1.1
フランス	27,520	33,478	3,886,187	9.7	—	6.7	2.2	0.8
オランダ	5,200	6,501	754,733	1.9	—	1.2	0.5	0.1
スペイン	16,300	19,559	2,270,447	5.7	—	3.8	1.3	0.6
ベルギー	6,730	8,395	974,502	2.4	—	1.8	0.4	0.2
オーストリア	4,030	5,102	592,310	1.5	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	1,740	1,967	228,386	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	2,200	2,535	294,338	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イギリス	千英ポンド 13,930	千英ポンド 20,047	2,632,773	6.6	—	5.3	1.0	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 8,350	千スウェーデンクローナ 9,729	106,733	0.3	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 8,610	千ノルウェークローネ 9,307	98,564	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,860	千デンマーククローネ 12,678	197,405	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,420	千ポーランドズロチ 9,145	232,837	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 9,730	千オーストラリアドル 11,481	797,424	2.0	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,070	千シンガポールドル 2,413	182,143	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,390	千マレーシアリンギット 7,952	196,593	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千シェケイ 4,000	千シェケイ 4,788	145,189	0.4	—	0.2	0.2	—
合 計	—	—	39,494,985	98.7	—	55.3	30.2	13.2

(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	
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	690	697	74,925	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,070	1,082	116,279	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,100	1,113	119,585	2021/ 8/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,300	1,317	141,492	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,105	118,775	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	860	870	93,559	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	720	77,380	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,170	1,212	130,288	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	940	975	104,826	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,059	113,850	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	800	840	90,274	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	582	62,525	2026/ 8/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	807	86,785	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,280	1,319	141,775	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	931	100,078	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	622	66,839	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	680	705	75,814	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,630	1,717	184,523	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,929	207,254	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	400	427	45,912	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,300	1,409	151,420	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	774	83,178	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,585	170,300	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	560	583	62,703	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	470	490	52,669	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	920	964	103,599	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	980	1,048	112,618	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,550	2,732	293,572	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,181	126,952	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,552	166,816	2029/ 8/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	509	54,751	2021/ 7/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,280	1,311	140,840	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	503	54,133	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	885	95,125	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	73,102	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	73,147	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	774	83,159	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	713	76,611	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,499	161,091	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	632	67,979	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	969	104,148	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,084	116,486	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	677	72,787	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	910	937	100,762	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	840	866	93,117	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	929	99,897	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	776	83,373	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	600	622	66,875	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,204	129,447	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,403	150,786	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	520	55,951	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	1,014	109,027	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,218	130,877	2026/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	682	73,367	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	736	79,168	2021/ 8/31

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	
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	920	944	101,422	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	894	96,063	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,114	119,731	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	686	73,767	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,055	113,353	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,401	150,591	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	986	106,009	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	587	63,134	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,594	171,275	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,413	151,900	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,976	212,293	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,976	212,310	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,520	1,670	179,482	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	490	576	61,902	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	705	75,771	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,004	107,872	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	930	954	102,579	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	750	774	83,172	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	645	69,380	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,502	161,450	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,610	1,717	184,529	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	835	89,719	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,479	158,978	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	937	100,663	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	540	58,020	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,461	157,040	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	670	729	78,399	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	645	69,378	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	830	863	92,712	2022/ 4/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	933	100,269	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	967	103,893	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	815	87,584	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,555	167,067	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	871	93,672	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,350	1,487	159,839	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,353	145,396	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,110	1,249	134,265	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,080	1,219	131,025	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	949	102,014	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	2,134	229,268	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	826	88,757	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,872	201,178	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,446	155,448	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,750	1,818	195,316	2022/ 1/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,560	1,623	174,399	2022/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	874	93,928	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,630	1,775	190,720	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	672	72,290	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	900	1,008	108,342	2026/ 2/28
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,048	112,601	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,054	113,248	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	979	105,178	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,400	1,437	154,420	2021/ 6/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	889	95,565	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,230	1,383	148,635	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	950	1,116	119,998	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	840	868	93,336	2021/ 9/15

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	
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	550	591	63,531	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	754	81,017	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,223	131,486	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,090	2,273	244,262	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,158	124,471	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,040	2,387	256,448	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	651	70,005	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	1,071	115,070	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,327	142,566	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,200	1,245	133,820	2021/10/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	580	653	70,161	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,330	142,940	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,260	2,675	287,442	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,640	1,948	209,357	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	700	931	100,070	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	850	1,147	123,233	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	1,036	111,313	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,197	128,699	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	406	43,670	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	610	835	89,728	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	840	1,154	124,032	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	630	870	93,478	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,298	139,460	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	1,256	135,036	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,860	2,607	280,091	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,837	197,388	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	220	226	24,338	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	371	39,921	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	510	54,835	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	759	81,585	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	1,267	136,216	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	2,324	249,701	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	840	1,213	130,377	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	330	35,542	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	997	107,134	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	1,284	138,036	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	340	508	54,652	2041/ 8/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	408	43,871	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	376	40,477	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	348	37,488	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	463	49,774	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	516	55,517	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	464	49,944	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	47	5,153	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	372	39,970	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	370	609	65,440	2040/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	66	7,136	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	1,260	1,755	188,586	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	168	18,089	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	344	37,013	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	168	18,083	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	540	713	76,653	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	370	524	56,375	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	239	25,711	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	279	30,016	2030/ 5/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	1,010	1,129	121,295	2021/11/15
小計	—	—	—	—	18,560,901	—

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	
0.50% CANADA GOV'T	国債証券	0.5	150	150	11,525	2022/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	760	764	58,516	2021/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	710	722	55,235	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	290	301	23,054	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	550	570	43,663	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	500	524	40,126	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	210	224	17,138	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV'T	国債証券	1.75	460	479	36,648	2023/ 3/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	180	189	14,534	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	390	437	33,463	2028/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV'T	国債証券	2.25	340	372	28,492	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV'T	国債証券	2.5	490	533	40,784	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	670	704	53,865	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	330	466	35,698	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	180	287	22,016	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV'T	国債証券	3.25	490	505	38,652	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	370	571	43,723	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV'T	国債証券	4.0	300	470	36,000	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV'T	国債証券	5.0	310	511	39,127	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	320	468	35,828	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	370	603	46,183	2033/ 6/ 1
8.000% CANADA GOV'T	国債証券	8.0	100	152	11,646	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	765,926	—
(メキシコ)						
		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	5,680	6,792	30,497	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	840	1,108	4,978	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	3,195	14,349	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	7,410	7,523	33,779	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,200	8,445	37,918	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	6,880	7,598	34,119	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,600	11,674	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	3,155	14,170	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,680	3,951	17,740	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,534	20,358	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	5,044	22,650	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	2,800	3,089	13,872	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,539	20,384	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	4,154	18,654	2038/11/18
小計	—	—	—	—	295,149	—
(ユーロ…ドイツ)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	504	58,585	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	600	608	70,616	2022/ 4/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	417	48,454	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	300	306	35,611	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	513	59,589	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	360	372	43,201	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	610	637	74,016	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	200	210	24,458	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	130	133	15,546	2050/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	800	842	97,804	2030/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	617	71,716	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	650	699	81,208	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	604	70,188	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	493	57,252	2026/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	610	662	76,947	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	469	54,456	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	340	365	42,478	2024/ 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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	670	732	85,037	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	360	501	58,266	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	463	53,761	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	478	55,542	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	780	833	96,780	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	910	993	115,372	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	410	47,697	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	470	515	59,800	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	520	543	63,083	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	447	51,938	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	470	487	56,619	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	790	1,315	152,713	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	941	109,294	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	540	563	65,441	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	300	536	62,265	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	820	1,428	165,832	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	290	548	63,636	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	400	578	67,108	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	648	75,230	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	440	897	104,147	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	563	65,393	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	480	714	82,942	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	180	226	26,276	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	367	42,716	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	350	40,648	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	400	399	46,334	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	420	420	48,816	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	420	416	48,300	2023/10/15
0.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.85	420	401	46,637	2027/ 1/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	562	65,258	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	510	511	59,342	2023/ 3/15
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	640	630	73,147	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	750	759	88,130	2022/ 4/15
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	600	575	66,771	2030/ 4/ 1
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	467	54,240	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	310	313	36,362	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	670	675	78,426	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	383	44,467	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	358	41,583	2032/ 3/ 1
1.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.75	370	378	43,941	2024/ 7/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	400	411	47,732	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	520	536	62,317	2025/12/ 1
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	504	58,562	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	341	39,670	2026/ 7/15
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	409	47,583	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	280	291	33,795	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	310	310	36,078	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	332	38,623	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	443	51,449	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	330	336	39,007	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	590	640	74,308	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	370	370	43,014	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	490	529	61,486	2038/ 9/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	330	368	42,726	2046/ 9/ 1
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	250	285	33,169	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	461	53,540	2048/ 3/ 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	
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	652	75,786	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	655	76,048	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	380	420	48,777	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	772	89,650	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	400	441	51,298	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	660	742	86,243	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	560	654	76,010	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	660	696	80,849	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	638	74,131	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	600	739	85,862	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	370	508	59,029	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	530	571	66,296	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	1,120	1,312	152,384	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	764	88,701	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	550	763	88,679	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	650	904	105,014	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	790	91,789	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	586	68,092	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	489	56,872	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	618	71,750	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	837	97,172	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	881	102,339	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	175	20,384	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	127	14,763	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	—	470	472	54,819	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	570	576	66,900	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	990	1,005	116,688	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	850	867	100,661	2025/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	710	712	82,721	2029/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	900	930	108,034	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	820	858	99,602	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	787	91,404	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	789	91,682	2029/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	700	751	87,203	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	710	763	88,598	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	950	1,022	118,668	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	660	717	83,239	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	720	822	95,520	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	940	1,090	126,573	2031/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	200	244	28,349	2050/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	850	909	105,604	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	968	112,436	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	470	584	67,804	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	340	468	54,362	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV' T	国債証券	2.0	630	845	98,199	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	800	855	99,271	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	890	989	114,830	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	1,100	1,377	159,954	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	730	892	103,635	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	1,040	1,111	129,065	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	1,070	1,127	130,937	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	520	841	97,719	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	800	983	114,176	2026/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	630	1,035	120,182	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	410	824	95,713	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	655	76,140	2060/ 4/25

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	
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	1,040	1,213	140,847	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	740	1,333	154,747	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	640	1,062	123,330	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	810	1,218	141,394	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	740	1,255	145,693	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	297	34,485	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	215	24,984	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	39,881	2022/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	190	194	22,569	2024/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	320	333	38,761	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	160	168	19,583	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	290	308	35,814	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	440	478	55,585	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	150	164	19,069	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	366	42,502	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	360	399	46,423	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	329	38,277	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.5	400	538	62,529	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.75	340	582	67,670	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.25	150	156	18,179	2021/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	310	346	40,263	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	290	530	61,529	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	410	693	80,507	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	5.5	320	467	54,254	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	7.5	80	97	11,330	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% SPANISH GOV'T	国債証券	0.35	450	455	52,920	2023/ 7/30
0.400% SPANISH GOV'T	国債証券	0.4	720	729	84,630	2022/ 4/30
0.450% SPANISH GOV'T	国債証券	0.45	370	375	43,641	2022/10/31
0.600% SPANISH GOV'T	国債証券	0.6	410	406	47,131	2029/10/31
0.750% SPANISH GOV'T	国債証券	0.75	450	455	52,915	2021/ 7/30
1.300% SPANISH GOV'T	国債証券	1.3	460	487	56,573	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	430	457	53,123	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	380	404	46,968	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	450	480	55,777	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	600	640	74,342	2029/ 4/30
1.500% SPANISH GOV'T	国債証券	1.5	370	396	46,080	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV'T	国債証券	1.6	420	449	52,185	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	480	526	61,078	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	650	723	84,038	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV'T	国債証券	2.15	440	485	56,330	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV'T	国債証券	2.35	480	560	65,023	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV'T	国債証券	2.7	370	469	54,554	2048/10/31
2.750% SPANISH GOV'T	国債証券	2.75	620	692	80,440	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV'T	国債証券	2.9	370	482	56,044	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV'T	国債証券	3.45	260	400	46,535	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV'T	国債証券	3.8	740	849	98,655	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV'T	国債証券	4.2	490	715	83,094	2037/ 1/31
4.400% SPANISH GOV'T	国債証券	4.4	470	542	62,948	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV'T	国債証券	4.65	400	491	57,092	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV'T	国債証券	4.7	370	596	69,294	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV'T	国債証券	4.8	420	494	57,412	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV'T	国債証券	4.9	370	604	70,188	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV'T	国債証券	5.15	780	1,070	124,206	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV'T	国債証券	5.15	280	491	57,109	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV'T	国債証券	5.4	570	655	76,130	2023/ 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	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	360	379	44,099	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	780	1,217	141,300	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	508	58,971	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	500	669	77,703	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	188	21,900	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	220	225	26,127	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	290	306	35,605	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	267	31,004	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	461	53,563	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	300	325	37,745	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	290	311	36,214	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	380	416	48,389	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	130	147	17,079	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	90	104	12,134	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	320	391	45,432	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	235	27,390	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	120	179	20,859	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	369	42,865	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	120	175	20,377	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	472	54,823	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	247	28,706	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	200	343	39,885	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	300	325	37,794	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	150	217	25,247	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	180	191	22,250	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	420	468	54,340	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	440	754	87,619	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	256	29,751	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	636	73,867	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	390	563	65,425	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	270	285	33,197	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	490	525	60,957	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	210	228	26,546	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	183	21,352	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	60	89	10,387	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	252	29,274	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	421	48,901	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	130	253	29,421	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	170	225	26,172	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	180	304	35,357	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	400	440	51,154	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	160	168	19,586	2021/ 9/15
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	270	292	33,942	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	114	13,343	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	418	48,596	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	235	27,354	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	450	661	76,760	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.125% FINNISH GOV' T	国債証券	0.125	80	80	9,318	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	200	210	24,467	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	84	9,825	2027/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	130	137	16,007	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	196	22,841	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	96	11,183	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	60	78	9,061	2047/ 4/15

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…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	106	12,323	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	240	252	29,330	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	220	242	28,106	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	120	184	21,388	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	161	18,789	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	110	135	15,742	2025/ 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	140	143	16,616	2022/ 3/15
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	374	43,463	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	230	245	28,489	2026/ 5/15
1.300% IRISH GOV' T	国債証券	1.3	150	168	19,522	2033/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	80	94	10,946	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	220	261	30,346	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	170	221	25,681	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	305	35,459	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	171	19,893	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	230	257	29,939	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	230	292	33,979	2025/ 3/13
小 計	—	—	—	—	15,283,344	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	380	380	49,990	2023/ 1/31
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	240	246	32,430	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	440	450	59,154	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	140	149	19,592	2029/10/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	340	368	48,411	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	468	61,588	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	460	564	74,161	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	740	834	109,546	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	250	393	51,740	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	728	95,672	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	430	516	67,794	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	310	440	57,880	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	210	232	30,522	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	740	795	104,443	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	677	88,962	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	313	41,107	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	480	759	99,688	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	780	102,550	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	809	106,299	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	200	209	27,537	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	680	89,393	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	570	611	80,315	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	310	703	92,359	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	380	49,926	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	511	67,219	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	460	724	95,100	2036/ 3/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	503	66,103	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	509	66,970	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	719	94,460	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	577	75,843	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	450	993	130,424	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	270	422	55,507	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	420	767	100,736	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	442	58,058	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	577	75,856	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	370	457	60,132	2025/ 3/ 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) 6.000% UK TREASURY	国債証券	% 6.0	千英ポンド 230	千英ポンド 344	千円 45,287	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,632,773	—
(スウェーデン) 0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	% 0.75	千スウェーデンクローナ 470	千スウェーデンクローナ 505	千円 5,540	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	300	323	3,552	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,276	14,006	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,948	21,373	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,175	12,895	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	2,160	2,330	25,564	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	2,169	23,800	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	106,733	—
(ノルウェー) 1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	% 1.5	千ノルウェークローネ 880	千ノルウェークローネ 952	千円 10,085	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	909	9,636	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	1,063	11,259	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,303	13,799	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	2,360	2,503	26,511	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	926	9,807	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,590	1,649	17,464	2021/ 5/25
小計	—	—	—	—	98,564	—
(デンマーク) 0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	% 0.5	千デンマーククローネ 1,740	千デンマーククローネ 1,861	千円 28,982	2027/11/15
0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,710	1,844	28,712	2029/11/15
1.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,220	18,999	2023/11/15
1.750% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,250	1,406	21,897	2025/11/15
3.000% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,460	1,536	23,930	2021/11/15
4.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,560	4,809	74,883	2039/11/15
小計	—	—	—	—	197,405	—
(ポーランド) 1.750% POLAND GOV' T	国債証券	% 1.75	千ポーランドズロチ 640	千ポーランドズロチ 649	千円 16,535	2021/ 7/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	830	857	21,839	2022/ 4/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	600	639	16,281	2024/10/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	820	20,897	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	751	19,136	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	830	21,147	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	890	991	25,251	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	300	339	8,637	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,153	29,362	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,069	27,237	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	280	301	7,666	2021/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	740	18,843	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	232,837	—
(オーストラリア) 2.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	% 2.0	千オーストラリアドル 90	千オーストラリアドル 92	千円 6,421	2021/12/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	590	657	45,658	2028/ 5/21
2.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.5	740	853	59,261	2030/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	460	504	35,007	2024/ 4/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	570	656	45,583	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	520	603	41,934	2028/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	200	234	16,254	2029/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	288	20,048	2035/ 6/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	80	94	6,561	2041/ 5/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	290	364	25,320	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	210	269	18,726	2039/ 6/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	900	1,025	71,249	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	710	857	59,585	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	320	430	29,900	2037/ 4/21

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	
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	670	818	56,817	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	490	695	48,298	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	630	807	56,052	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	490	565	39,257	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	750	790	54,921	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	780	872	60,563	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	797,424	—
(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	
1.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.75	160	164	12,415	2022/ 4/ 1
2.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.125	80	87	6,610	2026/ 6/ 1
2.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	240	245	18,502	2021/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	120	128	9,733	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	183	13,885	2042/ 4/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	148	11,211	2046/ 3/ 1
2.875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.875	300	356	26,892	2029/ 7/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	200	222	16,755	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	110	117	8,839	2022/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	300	389	29,431	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	310	369	27,864	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	182,143	—
(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	309	7,645	2023/ 3/15
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	449	11,118	2027/ 5/31
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	360	372	9,210	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	940	999	24,712	2033/ 4/15
3.885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.885	500	540	13,348	2029/ 8/15
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	300	321	7,942	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	250	265	6,574	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	641	15,852	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	310	317	7,859	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	777	19,213	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	990	1,055	26,087	2024/ 7/15
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	440	493	12,210	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	530	606	14,993	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	320	374	9,251	2037/ 4/ 7
4.893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.893	180	214	5,295	2038/ 6/ 8
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	213	5,275	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	196,593	—
(イスラエル)						
		%	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	千円	
0.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.75	650	662	20,078	2022/ 7/31
1.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.25	700	722	21,918	2022/11/30
2.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.25	700	800	24,282	2028/ 9/28
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	600	682	20,693	2024/ 3/31
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	650	941	28,535	2047/ 3/31
6.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.25	700	978	29,681	2026/10/30
小計	—	—	—	—	145,189	—
合計	—	—	—	—	39,494,985	—

(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			
16期(2016年3月31日)	21,780	△3.4	98.7	—	百万円 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
19期(2019年4月1日)	22,105	2.8	99.1	—	39,970
20期(2020年3月31日)	23,297	5.4	99.0	—	41,812

(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) 2019年 4月 1日	22,105	—	23,154	—	99.1	—
4月末	22,040	△0.3	23,091	△0.3	98.9	—
5月末	21,865	△1.1	22,907	△1.1	98.8	—
6月末	22,150	0.2	23,203	0.2	98.9	—
7月末	22,214	0.5	23,273	0.5	99.0	—
8月末	22,365	1.2	23,427	1.2	99.0	—
9月末	22,468	1.6	23,537	1.7	99.0	—
10月末	22,688	2.6	23,769	2.7	99.0	—
11月末	22,703	2.7	23,783	2.7	98.8	—
12月末	22,801	3.1	23,887	3.2	99.0	—
2020年 1月末	22,984	4.0	24,085	4.0	98.9	—
2月末	23,259	5.2	24,361	5.2	98.9	—
(期末) 2020年 3月31日	23,297	5.4	24,370	5.3	99.0	—

(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
	(2019.4.2～2020.3.31)
	金額
(a) その他費用 (保管費用)	3円 (3)
(その他)	(0)
合計	3

(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、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目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(2019年4月2日から2020年3月31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	
			39,500	33,771	
	カナダ	国債証券	千カナダドル	千カナダドル	
			1,823	1,614	
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ	千メキシコペソ	
			9,880	4,579	
	ユー ロ	国債証券	千ユーロ	千ユーロ	
			ドイツ	3,476	3,877
			イタリア	4,046	3,400
			フランス	4,746	4,538
			オランダ	458	637
			スペイン	2,292	2,461
			ベルギー	934	1,042
			オーストリア	539	607
			フィンランド	330	513
	アイルランド	298	399		
	イ ギ リ ス	国債証券	千英ポンド	千英ポンド	
			2,044	2,863	
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
				317	2,749
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
				1,209	961
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
				1,093	825
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
				1,243	1,590
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		
		1,150	1,218		
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		
		376	101		
マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
		903	382		
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		
		3,467	1,728		

(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(2019年4月2日から2020年3月31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)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	179,434	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	124,601
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	121,036
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	116,744
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	3.500% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	104,972
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,489
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	91,019
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	90,005

(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(2019年4月2日から2020年3月31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(2020年3月31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 170,400	千米ドル 192,003	千円 20,895,747	% 50.0	% —	% 22.7	% 18.5	% 8.7
カナダ	千カナダドル 8,530	千カナダドル 9,812	751,650	1.8	—	0.9	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 60,900	千メキシコペソ 62,888	287,398	0.7	—	0.3	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	17,210	21,197	2,534,111	6.1	—	3.5	1.9	0.7
イタリア	25,900	29,748	3,556,489	8.5	—	4.9	2.5	1.1
フランス	26,850	32,988	3,943,809	9.4	—	6.5	2.3	0.7
オランダ	4,980	6,220	743,626	1.8	—	1.2	0.4	0.2
スペイン	15,120	18,443	2,204,939	5.3	—	3.6	1.2	0.4
ベルギー	6,370	8,016	958,430	2.3	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	3,670	4,687	560,376	1.3	—	0.9	0.4	0.0
フィンランド	1,670	1,892	226,304	0.5	—	0.4	0.2	—
アイルランド	2,070	2,413	288,484	0.7	—	0.4	0.2	0.0
イギリス	千英ポンド 13,660	千英ポンド 19,393	2,585,511	6.2	—	5.0	0.9	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 7,850	千スウェーデンクローナ 9,271	100,221	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,610	千ノルウェークローネ 8,052	82,619	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,630	千デンマーククローネ 12,499	200,122	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,020	千ポーランドズロチ 8,560	225,313	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 9,210	千オーストラリアドル 10,943	723,256	1.7	—	1.2	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 2,020	千シンガポールドル 2,264	172,904	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,290	千マレーシアリンギット 7,552	189,858	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 34,280	千南アフリカランド 26,075	157,756	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	41,388,933	99.0	—	55.0	30.8	13.1

(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) —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	
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	490	494	53,809	2021/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	690	698	75,996	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,070	1,083	117,921	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,100	1,114	121,265	2021/ 8/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,300	1,317	143,391	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	730	738	80,345	2021/ 3/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,102	119,959	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,330	1,347	146,643	2021/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	860	871	94,895	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,500	1,542	167,836	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,170	1,209	131,648	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	940	973	105,968	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,056	114,987	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	649	70,658	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	579	63,097	2026/ 8/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	808	87,963	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,280	1,318	143,470	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	930	101,283	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	621	67,603	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	630	652	71,032	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,630	1,713	186,525	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,921	209,062	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	400	425	46,324	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	647	70,460	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	774	84,300	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,583	172,363	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	560	582	63,425	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	970	1,009	109,903	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	920	962	104,777	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,480	1,577	171,676	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,550	2,720	296,075	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,176	128,064	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,543	167,988	2029/ 8/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	510	55,541	2021/ 7/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,280	1,312	142,817	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	504	54,851	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	886	96,430	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	74,094	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	681	74,167	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	774	84,281	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	713	77,621	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,500	163,252	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	632	68,834	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	968	105,442	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,070	1,118	121,679	2023/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,080	117,587	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	678	73,808	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	910	938	102,153	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	840	867	94,395	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	930	101,275	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	776	84,485	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	600	622	67,777	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,205	131,164	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,405	152,912	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	520	56,668	2022/10/31

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	
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	1,012	110,157	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,213	132,088	2026/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	220	223	24,354	2021/ 2/28
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	684	74,465	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	738	80,347	2021/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	920	945	102,876	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	895	97,441	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,116	121,457	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	686	74,745	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,054	114,813	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,401	152,531	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	985	107,295	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	586	63,854	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,591	173,152	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,411	153,644	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,970	214,500	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,969	214,380	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,040	2,234	243,156	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	430	505	55,037	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	706	76,934	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,006	109,486	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	930	956	104,082	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	750	774	84,307	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	646	70,336	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,502	163,517	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,610	1,715	186,660	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	833	90,763	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,477	160,792	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	936	101,879	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	539	58,678	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,459	158,788	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,670	1,813	197,393	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	520	56,669	2021/ 3/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,900	1,943	211,542	2021/ 4/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	647	70,437	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,380	1,436	156,321	2022/ 4/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	932	101,457	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	965	105,086	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	813	88,573	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,552	168,976	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	870	94,743	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,350	1,483	161,486	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,350	146,951	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,280	1,437	156,388	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,600	1,800	195,975	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	949	103,310	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	2,126	231,469	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,020	1,043	113,608	2021/ 4/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	826	89,907	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,869	203,493	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,170	1,320	143,665	2027/ 5/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,439	156,623	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,750	1,821	198,219	2022/ 1/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,560	1,625	176,950	2022/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	873	95,103	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,160	1,244	135,474	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,630	1,773	192,984	2024/ 5/15

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	
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	671	73,123	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	900	1,005	109,459	2026/ 2/28
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,047	113,969	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,054	114,731	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	979	106,595	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,400	1,441	156,909	2021/ 6/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	887	96,620	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,230	1,381	150,311	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	950	1,111	120,940	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	840	870	94,759	2021/ 9/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	850	914	99,472	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	754	82,067	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,223	133,123	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,090	2,272	247,339	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,158	126,030	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,040	2,378	258,905	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	638	69,499	2042/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	652	70,958	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	1,068	116,298	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,323	144,007	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,200	1,248	135,901	2021/10/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	580	651	70,937	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,328	144,542	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,260	2,666	290,150	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,640	1,940	211,137	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	900	1,197	130,376	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	850	1,147	124,839	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	1,036	112,783	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,194	130,028	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	406	44,217	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	920	1,258	136,934	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	840	1,153	125,570	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,284	139,834	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,298	141,332	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	1,257	136,865	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,860	2,602	283,195	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,830	199,198	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	780	806	87,739	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	371	40,472	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	509	55,499	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	759	82,667	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	1,267	137,891	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	2,317	252,218	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	840	1,212	131,969	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	330	35,915	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	997	108,519	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	1,284	139,820	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	360	539	58,688	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	830	1,259	137,116	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	408	44,459	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	375	40,877	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	348	37,930	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	462	50,339	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	200	320	34,856	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	517	56,292	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	630	973	105,905	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	47	5,201	2038/ 5/15

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	
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	371	40,393	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	430	707	77,010	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	380	639	69,645	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	66	7,190	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	1,260	1,750	190,497	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	167	18,248	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	342	37,268	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	167	18,274	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	540	713	77,658	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	370	524	57,039	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	240	26,132	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	278	30,267	2030/ 5/15
6.500% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	125	13,625	2026/11/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	1,010	1,137	123,829	2021/11/15
小計	—	—	—	—	20,895,747	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.50% CANADA GOV'T	国債証券	0.5	150	150	11,495	2022/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	490	491	37,650	2021/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	760	762	58,443	2021/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	710	718	55,067	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	290	296	22,712	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	550	566	43,414	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	500	519	39,800	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	400	420	32,229	2026/ 6/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	180	188	14,464	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	390	430	32,992	2028/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV'T	国債証券	2.25	340	368	28,209	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV'T	国債証券	2.5	490	528	40,483	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	670	702	53,841	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	330	444	34,074	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	140	209	16,049	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV'T	国債証券	3.25	490	505	38,740	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	370	548	42,043	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV'T	国債証券	4.0	330	499	38,265	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV'T	国債証券	5.0	310	497	38,077	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	320	460	35,283	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	220	349	26,751	2033/ 6/ 1
8.000% CANADA GOV'T	国債証券	8.0	100	150	11,558	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	751,650	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	6,680	7,582	34,650	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	840	1,029	4,704	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	2,976	13,602	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,910	8,886	40,612	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	6,200	6,175	28,220	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	6,880	7,023	32,098	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,392	10,932	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	2,888	13,198	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,068	18,594	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,338	19,827	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	4,789	21,887	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	2,800	2,786	12,732	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,171	19,063	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,779	17,272	2038/11/18
小計	—	—	—	—	287,398	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	330	332	39,711	2021/ 4/ 9

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	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	505	60,426	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	600	608	72,791	2022/ 4/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	480	489	58,462	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	300	306	36,686	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	513	61,376	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	290	299	35,810	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	610	637	76,156	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	200	210	25,198	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	130	133	15,900	2050/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	617	73,825	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	650	699	83,683	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	604	72,272	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	492	58,930	2026/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	500	59,810	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	469	56,146	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	340	366	43,776	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	320	349	41,836	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	340	471	56,389	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	464	55,500	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	479	57,321	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	430	460	55,061	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	338	40,521	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	412	49,263	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	470	516	61,689	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	520	545	65,181	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	448	53,652	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	470	489	58,537	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	540	896	107,171	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	934	111,693	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	540	566	67,759	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	300	537	64,212	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	470	821	98,166	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	290	550	65,802	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	400	582	69,597	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	652	77,948	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	320	654	78,214	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	567	67,884	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	480	719	86,012	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	180	227	27,251	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	370	44,322	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	352	42,152	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	400	400	47,872	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	420	421	50,341	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	420	421	50,331	2023/10/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	565	67,664	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	420	425	50,853	2023/ 3/15
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	640	647	77,353	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	750	764	91,348	2022/ 4/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	470	56,301	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	310	318	38,094	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	670	688	82,357	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	392	46,928	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	372	44,560	2032/ 3/ 1
1.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.75	370	384	45,976	2024/ 7/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	400	417	49,967	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	520	548	65,609	2025/12/ 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	
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	519	62,152	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	350	41,861	2026/ 7/15
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	412	49,273	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	470	503	60,194	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	310	325	38,883	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	347	41,599	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	451	53,926	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	330	356	42,607	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	590	660	78,921	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	370	396	47,436	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	430	487	58,330	2038/ 9/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	360	426	50,939	2046/ 9/ 1
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	250	298	35,682	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	490	58,593	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	675	80,770	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	30	30	3,704	2021/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	660	685	81,932	2021/ 5/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	659	78,811	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	709	84,828	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	808	96,623	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	540	605	72,329	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	660	755	90,343	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	560	671	80,230	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	660	701	83,873	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	648	77,547	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	600	763	91,305	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	320	466	55,819	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	530	576	68,949	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	681	81,513	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	795	95,094	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	450	655	78,415	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	650	950	113,577	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	817	97,771	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	593	71,009	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	496	59,329	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	644	77,082	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	868	103,822	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	909	108,775	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	180	21,577	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	129	15,482	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	—	470	473	56,548	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	720	729	87,229	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	840	854	102,139	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	180	181	21,727	2029/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	950	983	117,627	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	1,170	1,226	146,615	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	788	94,271	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	794	94,952	2029/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	700	755	90,262	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	710	767	91,721	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	950	1,023	122,397	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	660	719	86,004	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	720	829	99,125	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	860	1,005	120,260	2031/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	850	912	109,096	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	971	116,134	2024/11/25

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	
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	470	587	70,263	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	400	541	64,759	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV'T	国債証券	2.0	630	850	101,692	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	800	859	102,765	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	890	992	118,688	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	680	859	102,812	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV'T	国債証券	2.75	730	897	107,282	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV'T	国債証券	3.0	1,040	1,118	133,756	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	1,070	1,135	135,747	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	520	846	101,249	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	800	988	118,134	2026/ 4/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	730	763	91,312	2021/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	720	1,190	142,318	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	410	828	99,016	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	310	658	78,749	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	1,040	1,220	145,965	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	740	1,345	160,833	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	640	1,074	128,410	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	940	1,426	170,532	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	740	1,268	151,623	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	298	35,743	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	217	26,040	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	344	41,146	2022/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	190	194	23,284	2024/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	320	334	39,946	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	160	168	20,202	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	320	340	40,696	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	440	479	57,273	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	150	164	19,657	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	367	43,951	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	360	401	47,974	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	331	39,591	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.5	260	352	42,117	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.75	300	515	61,626	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.25	250	262	31,408	2021/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	130	146	17,495	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	340	620	74,144	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	370	628	75,126	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	5.5	320	470	56,198	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	7.5	80	98	11,782	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	850	860	102,908	2022/ 4/30
0.450% SPANISH GOV'T	国債証券	0.45	280	284	33,972	2022/10/31
0.750% SPANISH GOV'T	国債証券	0.75	450	456	54,534	2021/ 7/30
1.300% SPANISH GOV'T	国債証券	1.3	460	490	58,622	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	510	550	65,787	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	380	410	49,045	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	580	625	74,740	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	600	651	77,877	2029/ 4/30
1.500% SPANISH GOV'T	国債証券	1.5	370	399	47,758	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV'T	国債証券	1.6	420	451	53,966	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	480	529	63,357	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	650	738	88,291	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV'T	国債証券	2.15	440	488	58,404	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV'T	国債証券	2.35	450	539	64,535	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV'T	国債証券	2.7	170	221	26,501	2048/10/31

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	
(ユーロ…スペイン)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	570	639	76,409	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	370	501	59,980	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	290	467	55,883	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	740	853	102,002	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	490	739	88,408	2037/ 1/31
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	470	544	65,049	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	400	495	59,282	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	370	616	73,693	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	420	496	59,379	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	370	624	74,644	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	780	1,089	130,250	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	280	511	61,163	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	570	657	78,617	2023/ 1/31
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	360	382	45,702	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	500	800	95,669	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	511	61,130	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	460	622	74,383	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	192	22,985	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	220	225	26,900	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	290	306	36,666	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	267	31,991	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	463	55,411	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	90	98	11,738	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	340	365	43,748	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	230	254	30,375	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	130	148	17,756	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	164	19,682	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	320	395	47,337	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	238	28,543	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	120	179	21,470	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	370	44,256	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	140	205	24,621	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	473	56,597	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	250	29,892	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	200	347	41,596	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	300	327	39,157	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	150	220	26,305	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	180	192	23,066	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	360	403	48,236	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	330	573	68,617	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	257	30,769	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	644	77,038	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	440	641	76,651	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	270	285	34,115	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	240	256	30,654	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	210	228	27,309	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	179	21,471	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	60	81	9,695	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	251	30,125	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	421	50,443	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	100	177	21,270	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	170	224	26,784	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	200	332	39,714	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	250	276	33,079	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	160	169	20,277	2021/ 9/15

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…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	270	293	35,112	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	109	13,044	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	300	499	59,715	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	236	28,269	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	450	663	79,292	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.125% FINNISH GOV' T	国債証券	0.125	80	80	9,565	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	100	104	12,543	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	84	10,098	2027/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	150	158	19,001	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	196	23,539	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	96	11,486	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	30	38	4,608	2047/ 4/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	106	12,710	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	240	253	30,284	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	220	242	29,017	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	120	183	21,914	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	162	19,378	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	150	185	22,153	2025/ 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	140	143	17,158	2022/ 3/15
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	377	45,168	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	330	353	42,295	2026/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	80	95	11,467	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	150	181	21,718	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	190	251	30,092	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	309	36,961	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	171	20,561	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	150	169	20,236	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	280	358	42,823	2025/ 3/13
小 計	—	—	—	—	15,016,571	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	220	225	29,999	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	610	622	82,976	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	140	148	19,754	2029/10/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	440	475	63,412	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	466	62,223	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	460	545	72,740	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	740	830	110,683	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	330	496	66,167	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	727	97,019	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	250	294	39,306	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	310	425	56,682	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	210	231	30,894	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	740	793	105,809	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	639	85,283	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	312	41,648	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	480	740	98,690	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	761	101,503	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	782	104,284	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	200	210	28,069	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	662	88,331	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	540	580	77,399	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	310	683	91,114	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	380	50,675	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	507	67,627	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	460	715	95,412	2036/ 3/ 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	
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	495	66,033	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	504	67,193	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	701	93,516	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	561	74,909	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	752	100,337	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	542	72,368	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	440	786	104,873	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	439	58,618	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	559	74,568	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	360	445	59,418	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	230	344	45,964	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,585,511	—
(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	
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	470	506	5,480	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	300	326	3,526	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,281	13,850	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,956	21,145	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,181	12,776	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,660	1,801	19,478	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	2,216	23,963	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	100,221	—
(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	920	9,445	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	886	9,092	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	1,023	10,497	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,235	12,674	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,425	14,624	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	909	9,335	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,590	1,652	16,949	2021/ 5/25
小計	—	—	—	—	82,619	—
(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	1,740	1,861	29,801	2027/11/15
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,010	1,087	17,413	2029/11/15
1.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,224	19,605	2023/11/15
1.750%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,720	1,935	30,993	2025/11/15
3.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,460	1,544	24,735	2021/11/15
4.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,560	4,845	77,573	2039/11/15
小計	—	—	—	—	200,122	—
(ポーランド)		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
1.750% POLAND GOV' T	国債証券	1.75	640	647	17,038	2021/ 7/25
2.000% POLAND GOV' T	国債証券	2.0	200	202	5,329	2021/ 4/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	830	852	22,439	2022/ 4/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	813	21,410	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	731	19,254	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	803	21,157	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	890	952	25,078	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	300	326	8,586	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,131	29,779	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,060	27,910	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	280	301	7,929	2021/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	737	19,400	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	225,313	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.0	90	91	6,058	2021/12/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	590	663	43,871	2028/ 5/21
2.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.5	340	396	26,178	2030/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	460	504	33,332	2024/ 4/21

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	
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	570	660	43,682	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	520	608	40,202	2028/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	200	236	15,631	2029/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	290	19,199	2035/ 6/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	80	94	6,243	2041/ 5/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	370	467	30,921	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	210	271	17,922	2039/ 6/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	500	568	37,591	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	710	857	56,688	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	320	430	28,421	2037/ 4/21
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	670	819	54,179	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	490	703	46,521	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	630	807	53,361	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	690	796	52,652	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	750	795	52,605	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	780	877	57,988	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	723,256	—
(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	
1.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.75	160	163	12,463	2022/ 4/ 1
2.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.125	80	84	6,480	2026/ 6/ 1
2.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	240	244	18,658	2021/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	220	233	17,802	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	170	13,042	2042/ 4/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	136	10,409	2046/ 3/ 1
2.875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.875	100	114	8,722	2029/ 7/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	250	271	20,757	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	110	116	8,866	2022/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	300	371	28,350	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	310	358	27,351	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	172,904	—
(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	304	7,663	2023/ 3/15
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	436	10,982	2027/ 5/31
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	360	368	9,253	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	940	931	23,407	2033/ 4/15
3.885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.885	500	519	13,066	2029/ 8/15
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	800	827	20,815	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	250	258	6,504	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	622	15,639	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	310	315	7,942	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	773	19,456	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	640	667	16,784	2024/ 7/15
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	440	470	11,836	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	280	302	7,613	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	320	351	8,844	2037/ 4/ 7
4.893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.893	180	198	5,000	2038/ 6/ 8
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	200	5,047	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	189,858	—
(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	5,270	5,266	31,864	2026/12/21
6.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	2,710	1,578	9,550	2036/ 3/31
6.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,820	2,160	13,069	2041/ 2/28
6.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	280	284	1,721	2021/ 3/31
7.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,310	13,980	2031/ 2/28
7.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	1,700	1,721	10,413	2023/ 2/28
8.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,150	1,701	10,294	2030/ 1/31
8.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	1,420	1,083	6,556	2032/ 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	
(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	
8.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.5	3,550	2,584	15,637	2037/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	2,680	1,933	11,700	2044/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	5,830	4,217	25,515	2048/ 2/28
8.875% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.875	1,600	1,231	7,452	2035/ 2/28
小計	—	—	—	—	157,756	—
合計	—	—	—	—	41,388,933	—

(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) —印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2020年3月31日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公債	千円 41,388,933	% 99.0
コール・ローン等、その他	424,044	1.0
投資信託財産総額	41,812,977	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(41,794,823千円)の投資信託財産総額(41,812,977千円)に対する比率は100.0%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、2020年3月31日における邦貨換算レートは1米ドル=108.83円、1カナダドル=76.60円、1メキシコペソ=4.57円、1ユーロ=119.55円、1英ポンド=133.32円、1スウェーデンクローナ=10.81円、1ノルウェークローネ=10.26円、1デンマーククローネ=16.01円、1ポーランドズロチ=26.32円、1オーストラリアドル=66.09円、1シンガポールドル=76.37円、1マレーシアリングギット=25.14円、1南アフリカランド=6.05円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,823,857,640円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	113,649,583
公 社 債(評価額)	41,388,933,601
未 収 入 金	10,880,000
未 収 利 息	301,757,845
前 払 費 用	8,636,611
(B) 負 債	10,881,240
未 払 金	10,881,000
未 払 利 息	52
そ の 他 未 払 費 用	188
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	41,812,976,400
元 本	17,947,491,892
次 期 繰 越 損 益 金	23,865,484,508
(D) 受 益 権 総 口 数	17,947,491,892口
1万口当たり基準価額(C / D)	23,297円

(注1) 当ファンドの期首元本額は18,082,227,329円、期中追加設定元本額は807,475,440円、期中一部解約元本額は942,210,877円です。

(注2) 元本の内訳

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)	8,957,832,316円
日立外国債券インデックスファンド	6,866,613,862円
日立バランスファンド(株式50)	890,236,499円
日立バランスファンド(株式70)	869,598,579円
日立バランスファンド(株式30)	363,210,636円

(注3) 1口当たり純資産額は2,3297円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	933,858,456円
受 取 利 息	933,905,151
支 払 利 息	△46,695
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,231,609,837
売 買 益	3,055,409,685
売 買 損	△1,823,799,848
(C) 信 託 報 酬 等	△5,750,062
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	2,159,718,231
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	21,888,167,997
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	999,126,336
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,181,528,056
(H) 計 (D + E + F + G)	23,865,484,508
次 期 繰 越 損 益 金(H)	23,865,484,508

(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。