



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20期

(決算日 2021年5月17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20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堀町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
		期 中 騰落率		期 中 騰落率			
16期(2017年5月15日)	円	%		%	%	%	百万円
	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
20期(2021年5月17日)	22,028	5.7	23,714	6.0	99.0	—	15,910

(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
		騰落率		騰落率		
(期 首) 2020年 5月15日	円	%		%	%	%
	20,833	—	22,382	—	98.6	—
5月末	21,079	1.2	22,647	1.2	98.6	—
6月末	21,415	2.8	23,020	2.8	98.9	—
7月末	21,625	3.8	23,250	3.9	98.9	—
8月末	21,599	3.7	23,222	3.8	99.0	—
9月末	21,694	4.1	23,335	4.3	99.0	—
10月末	21,368	2.6	22,984	2.7	98.3	—
11月末	21,588	3.6	23,216	3.7	98.9	—
12月末	21,763	4.5	23,414	4.6	98.9	—
2021年 1月末	21,732	4.3	23,386	4.5	99.0	—
2月末	21,531	3.4	23,172	3.5	98.9	—
3月末	22,008	5.6	23,687	5.8	99.0	—
4月末	21,998	5.6	23,684	5.8	99.0	—
(期 末) 2021年 5月17日	22,028	5.7	23,714	6.0	99.0	—

(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。

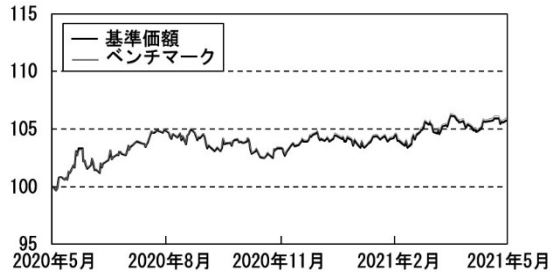
(注3) 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(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＞

期前半は、欧州復興基金の合意などを受けてユーロが上昇したこと、年明け以降は、米国長期金利の上昇を受けてドルが上昇したことが、プラスに影響しました。

＜下落要因＞

年明け以降、米国の大型経済対策や新型コロナウイルスワクチンの接種普及から、先行きの楽観的な見方やインフレへの警戒感が高まり、世界的に金利が上昇したことが、マイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2020年5月15日	2021年4月2日	2020年5月18日	2021年5月17日
基 準 価 額	20,833円	22,116円	20,758円	22,028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20,833円からF T S E 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、22,028円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は+5.7%となり、ベンチマーク騰落率+6.0%にはほぼ追従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、期初より欧米金利が緩やかな低下基調となる中、ユーロが対円で上昇したことから堅調な推移となりました。年明け後は、米国長期金利が急上昇し、債券価格は大きく下落しましたが、米ドルが対円で上昇したため、底堅く推移しました。結果、通期ではプラスの収益を確保しました。

米国金利

新型コロナウイルス感染拡大を背景とした金融緩和長期化観測から、米国長期金利は概ね0.7%を中心としたレンジでの推移が続きました。しかし、年明け後は、バイデン大統領の大規模な経済対策に加え、新型コロナウイルスワクチン接種が想定を上回るペースで進捗したため、先行きの楽観的な見方やインフレへの警戒感から、金利が上昇しました。2021年1月初に1%を超えた後は上昇が加速し、1%台半ばで終わりました。

ユーロ金利

欧州中央銀行の量的緩和継続や、当局から金利上昇を牽制する発言が続き、ドイツ等主要国の長期金利は安定的に推移しましたが、2月以降は、欧州でも先行き楽観的な見方が広がり、緩やかな上昇に転じました。一方、欧州復興基金の成立から先行き安心感が広がり、イタリア長期金利は大きく低下し、ドイツとの利回り格差が縮小しました。

＜外国為替市況＞

米ドル・円レートは、米国金融当局が緩和長期化の姿勢を鮮明にしたことから円高が進行し、1月には102円台を記録しました。しかし、その後は米国長期金利上昇を受けて急反転し、一時110円台にのせました。ユーロは、米国の金融緩和長期化から対円、対ドルで上昇しました。年明け以降、対ドルでは米国長期金利上昇を背景にやや反落したものの、対円では1年を通して上昇しました。他の資源国、新興国通貨は、グローバル景気の回復期待が高まるなか、概ね堅調に推移しました。

【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、F T S E 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す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
	(2020. 5. 16～2021. 5. 17)		
	金 額	比 率	
(a)信 託 報 酬	33円	0. 155%	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21, 616円です。
（投 信 会 社）	(15)	(0. 070)	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	(9)	(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）	(10)	(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. 015	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. 015)	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	36	0. 170	

(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。

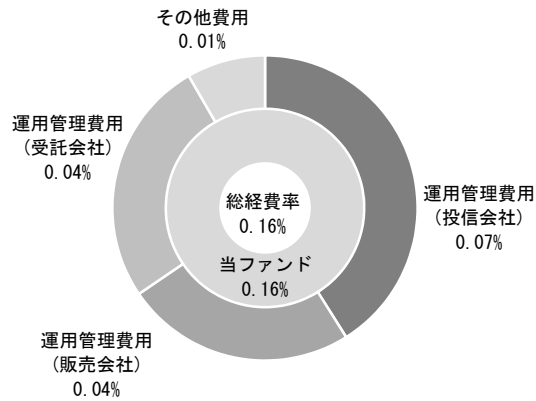
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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(2020年5月16日から2021年5月17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 454,566	千円 1,080,300	千口 800,351	千円 1,916,700

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2020年5月16日から2021年5月17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
0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	253,676	2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	207,316
0.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	233,962	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	188,088
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	202,827	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,239
0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	184,630	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	169,852
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	179,413	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,617
0.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	172,197	3.000% FRANCE GOV' T (ユーロ・フランス)	140,655
1.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	170,700	3.250% FRANCE GOV' T (ユーロ・フランス)	137,545
0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	170,304	1.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	137,236
0.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	166,580	1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,608
0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,002	2.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	127,869

(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(2020年5月16日から2021年5月17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(2021年5月17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	6,898,166	6,552,382	15,892,148

(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(2021年5月17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	15,892,148	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	65,595	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	15,957,743	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(40,755,097千円)の投資信託財産総額(40,784,051千円)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、2021年5月17日における邦貨換算レートは1米ドル＝109.45円、1カナダドル＝90.29円、1メキシコペソ＝5.4943円、1ユーロ＝132.77円、1英ポンド＝154.23円、1スウェーデンクローナ＝13.13円、1ノルウェークローネ＝13.28円、1デンマーククローネ＝17.86円、1ポーランドズロチ＝29.314円、1オーストラリアドル＝84.96円、1シンガポールドル＝82.02円、1マレーシアリンギット＝26.4629円、1イスラエルシェケル＝33.4627円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2021年5月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,957,743,911円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,995,723
日立外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	15,892,148,188
未 収 入 金	25,600,000
(B) 負 債	47,646,925
未 払 解 約 金	34,834,616
未 払 信 託 報 酬	12,812,200
未 払 利 息	109
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	15,910,096,986
元 本	7,222,594,024
次 期 繰 越 損 益 金	8,687,502,962
(D) 受 益 権 総 口 数	7,222,594,024口
1万口当たり基準価額 (C / D)	22,028円

(注1) 当ファンドの期首元本額は7,591,513,868円、期中追加設定元本額は1,372,682,770円、期中一部解約元本額は1,741,602,614円です。

(注2) 1口当たり純資産額は2,2028円です。

■損益の状況

当期(自2020年5月16日 至2021年5月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△27,580円
支 払 利 息	△27,580
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	793,529,620
売 買 益	937,945,465
売 買 損	△144,415,845
(C) 信 託 報 酬 等	△25,560,772
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	767,941,268
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,701,641,432
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,217,920,262
(配 当 等 相 当 額)	(5,892,177,560)
(売 買 損 益 相 当 額)	(325,742,702)
(G) 計 (D + E + F)	8,687,502,962
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	8,687,502,962
追 加 信 託 差 損 益 金	6,217,920,262
(配 当 等 相 当 額)	(5,892,177,560)
(売 買 損 益 相 当 額)	(325,742,702)
分 配 準 備 積 立 金	2,469,610,280
繰 越 損 益 金	△27,580

(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(767,947,747円)、信託約款に規定する収益調整金(6,217,892,682円)および分配準備積立金(1,701,662,533円)より分配対象収益は8,687,502,962円(10,000口当たり12,028円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

該当事項はございません。

＜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(2021年5月17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(16,804,600千口)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	2021年5月17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
アメリカ	千米ドル 157,680	千米ドル 163,505	千円 17,895,645	% 43.9	% —	% 19.0	% 17.4	% 7.5
カナダ	千カナダドル 8,470	千カナダドル 9,207	831,317	2.0	—	1.0	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 56,390	千メキシコペソ 59,747	328,272	0.8	—	0.4	0.3	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	19,620	23,068	3,062,739	7.5	—	4.6	1.9	1.0
イタリア	24,820	28,967	3,846,000	9.4	—	6.0	2.5	1.0
フランス	26,820	31,690	4,207,601	10.3	—	6.7	2.8	0.8
オランダ	5,000	5,987	794,948	2.0	—	1.4	0.4	0.2
スペイン	15,410	18,517	2,458,615	6.0	—	4.0	1.7	0.3
ベルギー	6,120	7,394	981,770	2.4	—	1.8	0.6	0.0
オーストリア	3,770	4,525	600,869	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	1,690	1,854	246,159	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	2,260	2,548	338,391	0.8	—	0.5	0.2	0.0
イギリス	千英ポンド 13,490	千英ポンド 17,098	2,637,107	6.5	—	4.9	1.2	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 9,950	千スウェーデンクローナ 10,983	144,213	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークロネ 7,520	千ノルウェークロネ 7,693	102,170	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククロネ 9,460	千デンマーククロネ 11,528	205,903	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,290	千ポーランドズロチ 8,777	257,302	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 9,740	千オーストラリアドル 10,578	898,707	2.2	—	1.5	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 1,960	千シンガポールドル 2,186	179,314	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,070	千マレーシアリンギット 7,348	194,464	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 4,980	千イスラエルシェケル 5,636	188,627	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	40,400,142	99.1	—	55.0	31.3	12.8

(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) —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	
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	2,220	2,216	242,637	2023/ 7/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,090	1,088	119,095	2023/ 8/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	300	299	32,759	2023/10/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,550	1,545	169,104	2023/12/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,120	1,115	122,114	2024/ 1/15
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,200	1,200	131,396	2023/11/15
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	800	799	87,457	2024/ 3/15
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,200	1,181	129,364	2025/ 6/30
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	550	540	59,207	2025/ 7/31
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,500	1,473	161,269	2025/ 8/31
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	400	391	42,897	2025/10/31
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	1,140	1,121	122,794	2025/11/30
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	1,500	1,472	161,160	2026/ 1/31
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	820	779	85,349	2027/ 9/30
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,500	1,448	158,518	2027/ 5/31
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	864	94,599	2027/ 8/31
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	861	94,260	2027/10/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,640	1,579	172,914	2027/11/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,200	1,154	126,327	2027/12/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,400	1,289	141,091	2030/ 5/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,550	1,421	155,532	2030/ 8/15
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	1,580	1,575	172,491	2026/ 3/31
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	850	823	90,110	2028/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,430	2,272	248,779	2030/11/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	300	306	33,564	2025/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,420	1,354	148,297	2031/ 2/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	980	809	88,645	2040/ 5/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,330	1,095	119,849	2040/ 8/15
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,094	119,842	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	712	77,973	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	640	656	71,815	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	900	924	101,136	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,048	114,709	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	800	825	90,344	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	563	61,690	2026/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,120	963	105,484	2040/11/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,410	1,110	121,596	2050/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	750	763	83,604	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	920	100,736	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	614	67,265	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	680	697	76,315	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,380	1,429	156,474	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,865	204,148	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	480	493	53,990	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,550	1,546	169,223	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	764	83,658	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,564	171,219	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	678	74,308	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	720	741	81,115	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	710	734	80,368	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,130	1,174	128,543	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,650	1,714	187,618	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,140	124,782	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,438	157,495	2029/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,080	908	99,417	2050/11/15

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	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	670	73,439	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	762	83,501	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	702	76,915	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,477	161,764	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	623	68,264	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	955	104,579	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,800	1,856	203,243	2023/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,041	114,046	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	915	100,186	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	763	83,604	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	720	735	80,497	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,186	129,853	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,382	151,324	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	512	56,118	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	995	109,001	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,177	128,852	2026/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,040	978	107,056	2041/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	675	73,901	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,037	113,562	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,378	150,891	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	970	106,198	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	577	63,169	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,564	171,266	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,387	151,867	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,931	211,403	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,923	210,536	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,520	1,604	175,617	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,040	960	105,095	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	634	69,401	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,476	161,557	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,060	1,110	121,536	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	819	89,742	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,451	158,899	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	918	100,566	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	528	57,880	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,428	156,380	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,210	1,283	140,509	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	915	100,183	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	948	103,765	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	796	87,179	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,519	166,271	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	851	93,155	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,750	1,869	204,600	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,293	141,591	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,110	1,185	129,742	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	990	1,056	115,597	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	764	83,663	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	1,688	184,770	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	809	88,615	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	160	169	18,528	2024/ 2/29
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,830	200,402	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,480	1,592	174,280	2027/ 5/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,339	146,592	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	855	93,675	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,200	1,261	138,091	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	110	117	12,820	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	654	71,654	2025/ 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	
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	780	843	92,294	2026/ 2/28
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	855	93,600	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	853	93,462	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	791	86,653	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	863	94,537	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	830	901	98,643	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,020	1,112	121,730	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	670	703	77,032	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	736	80,643	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,195	130,862	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,285	140,701	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,620	1,729	189,325	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,170	1,284	140,627	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	540	59,145	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	862	94,363	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,067	116,858	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	960	1,046	114,557	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,287	140,941	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,260	1,395	152,705	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,490	1,650	180,624	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	790	869	95,189	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	837	91,656	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,155	126,486	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	260	292	32,031	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	610	685	74,997	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	800	899	98,429	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	330	371	40,658	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,049	114,814	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	850	958	104,948	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,380	1,558	170,623	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,472	161,171	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	309	33,901	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	630	69,060	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	850	975	106,732	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	1,873	205,027	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	480	572	62,700	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	277	30,424	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	140	173	18,949	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	710	879	96,274	2044/ 2/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	317	34,766	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	450	598	65,544	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	390	42,720	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	340	459	50,240	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	210	284	31,165	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	399	43,775	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	40	4,442	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	313	34,348	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	320	444	48,623	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	50	70	7,751	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	56	6,195	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	860	1,100	120,489	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	154	16,896	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	100	134	14,717	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	155	16,966	2028/ 8/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	120	157	17,236	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	227	24,867	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	252	27,616	2030/ 5/15
小 計	—	—	—	—	17,895,645	—

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	
0.250% CANADA GOV' T	国債証券	0.25	170	164	14,850	2026/ 3/ 1
0.500% CANADA GOV' T	国債証券	0.5	350	317	28,643	2030/12/ 1
1.000% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	710	717	64,737	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	290	288	26,016	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	550	563	50,843	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	410	422	38,126	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	330	338	30,584	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	460	471	42,608	2023/ 3/ 1
2.000% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	680	705	63,655	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	390	410	37,043	2028/ 6/ 1
2.000% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	80	76	6,919	2051/12/ 1
2.250% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	740	784	70,838	2025/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	350	374	33,803	2029/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	280	296	26,792	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	670	687	62,094	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	330	370	33,468	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	180	205	18,528	2064/12/ 1
3.500% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	370	467	42,241	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	300	397	35,908	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	160	228	20,661	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	420	560	50,615	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	250	358	32,335	2033/ 6/ 1
小 計	—	—	—	—	831,317	—
(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	6,451	35,444	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	1,840	2,280	12,530	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	3,094	17,002	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,200	8,345	45,850	2022/ 6/ 9
6.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.75	3,000	3,092	16,988	2023/ 3/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	5,680	5,986	32,889	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,454	13,486	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	2,929	16,097	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,680	3,684	20,241	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,400	24,175	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	4,861	26,709	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,900	3,977	21,856	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,309	23,679	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,880	21,318	2038/11/18
小 計	—	—	—	—	328,272	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	413	54,936	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	540	547	72,627	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	508	67,480	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	450	459	61,037	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	330	337	44,843	2025/ 4/11
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	360	369	49,078	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	390	400	53,111	2027/11/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	510	520	69,148	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	750	761	101,160	2030/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	90	91	12,092	2031/ 2/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	280	246	32,736	2050/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	730	744	98,783	2030/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	604	80,217	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	430	448	59,585	2028/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	440	459	60,948	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	594	78,887	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	760	798	105,990	2026/ 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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	610	645	85,751	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	456	60,550	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	710	748	99,366	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	670	715	95,022	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	390	475	63,166	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	452	60,072	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	467	62,034	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	780	814	108,096	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	600	639	84,871	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	400	53,199	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	670	714	94,924	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	434	57,739	2023/ 8/15
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	670	1,002	133,086	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	837	111,163	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	370	600	79,680	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	680	1,091	144,914	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	380	658	87,399	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	280	384	51,001	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	460	749	99,459	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	410	762	101,299	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	529	70,281	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	360	506	67,279	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	345	45,925	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	329	43,784	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	—	200	200	26,620	2024/ 1/15
0.300% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.3	500	505	67,088	2023/ 8/15
0.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.5	270	272	36,238	2026/ 2/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	540	550	73,108	2023/10/15
0.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.85	420	429	57,051	2027/ 1/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	568	75,466	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	510	521	69,188	2023/ 3/15
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	660	676	89,792	2027/ 9/15
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	450	449	59,716	2030/ 8/ 1
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	520	544	72,243	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	430	445	59,186	2030/ 4/ 1
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	470	62,509	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	410	430	57,113	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	740	780	103,633	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	404	53,671	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	650	688	91,426	2030/12/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	389	51,689	2032/ 3/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	350	369	49,113	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	430	464	61,664	2025/12/ 1
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	535	71,094	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	359	47,748	2026/ 7/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	430	473	62,908	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	200	220	29,286	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	362	48,107	2033/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	410	446	59,226	2050/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	456	60,581	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	400	458	60,893	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	550	633	84,108	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	330	369	49,023	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	390	467	62,105	2038/ 9/ 1
3.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.1	410	501	66,563	2040/ 3/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	380	478	63,484	2046/ 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	
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	400	496	65,981	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	520	69,135	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	695	92,282	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	380	426	56,668	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	844	112,101	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	513	68,192	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	450	507	67,376	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	564	74,975	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	632	83,973	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	390	501	66,630	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	380	585	77,732	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	1,060	1,256	166,856	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	370	532	70,744	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	430	656	87,126	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	560	860	114,270	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	829	110,137	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	569	75,645	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	477	63,337	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	657	87,289	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	882	117,174	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	530	728	96,784	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	178	23,661	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	122	16,261	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	—	570	573	76,178	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	990	1,001	132,940	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	250	253	33,716	2024/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	880	895	118,870	2025/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	350	355	47,217	2026/ 2/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	710	705	93,682	2029/11/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	890	875	116,262	2030/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	700	720	95,624	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	820	851	113,019	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	550	573	76,090	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	779	103,451	2029/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	50	47	6,343	2040/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	190	139	18,495	2072/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	640	678	90,088	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	760	805	106,979	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	740	786	104,469	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	730	783	104,074	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	220	242	32,223	2034/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	610	671	89,177	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	850	959	127,367	2031/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	570	640	85,100	2050/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	1,050	1,100	146,086	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	950	126,149	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	690	819	108,779	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	340	411	54,576	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV' T	国債証券	2.0	600	749	99,529	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	800	833	110,655	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	260	282	37,457	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	950	1,155	153,350	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	960	1,142	151,740	2027/10/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	520	790	104,934	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	930	1,108	147,195	2026/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	953	126,562	2038/10/25

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	
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	410	753	100,069	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	593	78,827	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	1,040	1,163	154,512	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	680	1,158	153,789	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	710	1,125	149,375	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	760	1,094	145,283	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	760	1,229	163,274	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	570	734	97,489	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	200	26,586	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	—	240	244	32,411	2024/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	—	270	271	36,027	2030/ 7/15
0.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	—	80	68	9,048	2052/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	340	350	46,581	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	260	268	35,617	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.5	290	303	40,343	2026/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.5	140	143	19,104	2040/ 1/15
0.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.75	440	469	62,280	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.75	240	256	34,114	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.75	340	357	47,520	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	260	281	37,388	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.25	310	320	42,545	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.5	270	345	45,903	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	340	534	71,021	2047/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	50	53	7,131	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	280	470	62,406	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	450	711	94,411	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	320	444	59,009	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	90	12,079	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	600	610	81,119	2023/ 7/30
0.450% SPANISH GOV' T	国債証券	0.45	370	375	49,827	2022/10/31
0.600% SPANISH GOV' T	国債証券	0.6	510	518	68,877	2029/10/31
0.800% SPANISH GOV' T	国債証券	0.8	140	146	19,411	2027/ 7/30
1.000% SPANISH GOV' T	国債証券	1.0	180	156	20,775	2050/10/31
1.200% SPANISH GOV' T	国債証券	1.2	180	177	23,583	2040/10/31
1.250% SPANISH GOV' T	国債証券	1.25	300	320	42,491	2030/10/31
1.300% SPANISH GOV' T	国債証券	1.3	460	493	65,587	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	430	466	61,875	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	520	564	74,915	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	630	684	90,855	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	340	369	49,118	2029/ 4/30
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	120	100	13,389	2071/10/31
1.500% SPANISH GOV' T	国債証券	1.5	470	511	67,880	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	450	59,873	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	380	418	55,629	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	650	735	97,674	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	580	640	85,084	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV' T	国債証券	2.35	480	566	75,245	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV' T	国債証券	2.7	220	279	37,145	2048/10/31
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	620	686	91,108	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	330	432	57,435	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	310	459	60,947	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	620	697	92,565	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	490	716	95,146	2037/ 1/31
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	420	470	62,477	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	650	783	104,087	2025/ 7/30

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	
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	410	662	87,940	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	300	342	45,502	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	470	768	102,089	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	560	762	101,266	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	280	493	65,510	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	570	627	83,352	2023/ 1/31
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	680	1,052	139,777	2032/ 7/30
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	500	656	87,097	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	220	315	41,947	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	224	29,781	2023/10/22
0.650% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.65	90	70	9,343	2071/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	452	60,099	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	266	35,320	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	310	330	43,916	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	440	472	62,753	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	390	417	55,394	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	250	270	35,910	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	180	199	26,529	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	157	20,976	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	260	297	39,494	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	220	264	35,103	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	150	200	26,595	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	360	47,881	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	120	161	21,401	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	461	61,278	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	239	31,801	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	180	291	38,660	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	190	266	35,440	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	120	128	17,004	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	320	526	69,839	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	248	32,948	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	612	81,364	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	473	62,927	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% REP OF AUSTRIA	国債証券	—	120	118	15,739	2031/ 2/20
0.000% REP OF AUSTRIA	国債証券	—	70	62	8,309	2040/10/20
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	450	470	62,429	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	320	339	45,031	2026/10/20
0.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.85	60	50	6,725	2120/ 6/30
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	260	279	37,064	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	166	22,126	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	40	49	6,541	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	290	312	41,425	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	412	54,742	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	120	183	24,410	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	150	190	25,278	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	160	248	32,973	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	300	318	42,272	2022/11/22
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	70	140	18,686	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	394	52,367	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	226	30,052	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	400	562	74,691	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	120	114	15,258	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	83	11,091	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	170	178	23,638	2027/ 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…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	230	240	31,899	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	191	25,408	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	95	12,651	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	150	177	23,506	2047/ 4/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	104	13,825	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	103	13,680	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	140	150	20,009	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	90	127	16,938	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	157	20,901	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	110	130	17,348	2025/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% IRISH GOV' T	国債証券	0.2	130	129	17,256	2030/10/18
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	373	49,629	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	290	308	41,009	2026/ 5/15
1.300% IRISH GOV' T	国債証券	1.3	220	243	32,311	2033/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	120	134	17,895	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	220	256	34,087	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	170	211	28,141	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	300	39,900	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	166	22,124	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	130	140	18,678	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	230	281	37,356	2025/ 3/13
小 計	—	—	—	—	16,537,095	—
(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	58,648	2023/ 1/31
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	150	148	22,849	2026/ 1/30
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	60	57	8,942	2028/ 1/31
0.375% UK TREASURY	国債証券	0.375	410	390	60,230	2030/10/22
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	380	385	59,457	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	460	466	71,974	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	180	181	27,952	2029/10/22
1.000% UK TREASURY	国債証券	1.0	240	245	37,922	2024/ 4/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	390	406	62,730	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	453	69,986	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	350	357	55,060	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	190	203	31,346	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	250	290	44,757	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	715	110,368	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	520	555	85,741	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	350	390	60,188	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	350	375	57,958	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	650	682	105,231	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	521	80,359	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	303	46,833	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	430	585	90,352	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	669	103,324	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	627	96,765	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	559	86,255	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	280	507	78,288	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	433	66,784	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	468	72,317	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	508	78,459	2036/ 3/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	270	400	61,713	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	526	81,132	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	611	94,387	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	484	74,791	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	629	97,046	2055/12/ 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	
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	270	382	59,006	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	360	570	88,014	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	260	352	54,351	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	511	78,914	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	370	436	67,359	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	230	319	49,300	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,637,107	—
(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	1,270	1,316	17,287	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	1,100	1,136	14,921	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,240	16,289	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,909	25,077	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,137	14,935	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	2,160	2,245	29,486	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,996	26,215	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	144,213	—
(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	
1.250% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.25	500	487	6,468	2031/ 9/17
1.375% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.375	1,000	991	13,165	2030/ 8/19
1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.5	880	897	11,916	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	866	11,507	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	989	13,140	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,180	15,670	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,399	18,586	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	882	11,714	2024/ 3/14
小計	—	—	—	—	102,170	—
(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	
0.250%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.25	650	655	11,714	2022/11/15
0.250%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.25	560	510	9,115	2052/11/15
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,740	1,823	32,571	2027/11/15
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,710	1,791	31,994	2029/11/15
1.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,195	21,349	2023/11/15
1.750%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,250	1,370	24,470	2025/11/15
4.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,410	4,181	74,687	2039/11/15
小計	—	—	—	—	205,903	—
(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	
0.750% POLAND GOV' T	国債証券	0.75	580	577	16,925	2025/ 4/25
1.250% POLAND GOV' T	国債証券	1.25	410	387	11,346	2030/10/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	600	632	18,536	2024/10/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	810	23,756	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	730	21,399	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	803	23,557	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	590	634	18,604	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	1,230	1,322	38,756	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,123	32,925	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,046	30,668	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	710	20,823	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	257,302	—
(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	
0.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	0.25	200	196	16,704	2025/11/21
1.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.25	350	329	28,007	2032/ 5/21
1.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.5	630	616	52,368	2031/ 6/21
1.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.75	340	272	23,152	2051/ 6/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	650	671	57,029	2022/11/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	210	224	19,106	2028/ 5/21
2.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.5	740	798	67,805	2030/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	360	387	32,962	2024/ 4/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	570	629	53,459	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	520	573	48,763	2028/11/21

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	630	693	58,926	2029/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	259	22,037	2035/ 6/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	80	83	7,070	2041/ 5/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	290	309	26,254	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	430	485	41,236	2039/ 6/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	900	997	84,767	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	470	535	45,537	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	320	384	32,640	2037/ 4/21
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	410	480	40,791	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	230	295	25,078	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	630	768	65,252	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	260	287	24,395	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	280	298	25,356	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	898,707	—
(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	
2.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.125	80	84	6,933	2026/ 6/ 1
2.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.375	100	106	8,709	2025/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	120	125	10,316	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	159	13,122	2042/ 4/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	190	220	18,092	2046/ 3/ 1
2.875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.875	410	455	37,340	2029/ 7/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	200	215	17,678	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	110	113	9,341	2022/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	300	353	28,998	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	310	350	28,779	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	179,314	—
(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	307	8,139	2023/ 3/15
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	445	11,789	2027/ 5/31
3.757% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.757	800	825	21,834	2023/ 4/20
3.757% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.757	350	329	8,717	2040/ 5/22
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	360	368	9,761	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	940	941	24,923	2033/ 4/15
3.885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.885	500	524	13,875	2029/ 8/15
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	300	317	8,408	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	250	266	7,043	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	633	16,756	2025/ 9/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	590	622	16,473	2024/ 7/15
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	440	480	12,712	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	530	552	14,624	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	320	345	9,135	2037/ 4/ 7
4.893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.893	180	193	5,133	2038/ 6/ 8
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	194	5,135	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	194,464	—
(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	659	22,059	2022/ 7/31
1.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.25	700	716	23,969	2022/11/30
1.500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5	300	311	10,431	2023/11/30
1.500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5	200	189	6,335	2037/ 5/31
1.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.75	350	372	12,473	2025/ 8/31
2.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.25	700	769	25,742	2028/ 9/28
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	600	662	22,169	2024/ 3/31
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	650	818	27,397	2047/ 3/31
5.500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	5.5	130	205	6,864	2042/ 1/31
6.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.25	700	931	31,184	2026/10/30
小計	—	—	—	—	188,627	—
合計	—	—	—	—	40,400,142	—

(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
		期 中 騰落率			
17期(2017年3月31日)	円 20,758	% △4.7	% 98.9	% —	百万円 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
21期(2021年3月31日)	24,227	4.0	99.0	—	41,689

(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
		騰落率		騰落率		
(期 首) 2020年 3月31日	円 23,297	% —	24,370	% —	% 99.0	% —
4月末	22,853	△1.9	23,941	△1.8	98.4	—
5月末	23,173	△0.5	24,285	△0.3	98.7	—
6月末	23,546	1.1	24,684	1.3	99.0	—
7月末	23,781	2.1	24,932	2.3	98.9	—
8月末	23,755	2.0	24,901	2.2	99.1	—
9月末	23,863	2.4	25,022	2.7	99.0	—
10月末	23,507	0.9	24,646	1.1	98.3	—
11月末	23,752	2.0	24,895	2.2	99.0	—
12月末	23,948	2.8	25,108	3.0	99.0	—
2021年 1月末	23,917	2.7	25,077	2.9	99.0	—
2月末	23,698	1.7	24,847	2.0	99.0	—
(期 末) 2021年 3月31日	24,227	4.0	25,400	4.2	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
	(2020.4.1～2021.3.31)
	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(2020年4月1日から2021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 45,424	千米ドル 62,177
	カナダ	国債証券	千カナダドル 3,120	千カナダドル 3,004
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 7,754	千メキシコペソ 10,676
	ユ ー ロ	ドイツ	千ユーロ 8,583	千ユーロ 4,630
		イタリア	6,714	6,949
		フランス	7,639	6,390
		オランダ	1,534	1,481
		スペイン	4,870	4,270
		ベルギー	1,352	1,254
		オーストリア	1,086	777
		フィンランド	505	331
		アイルランド	582	195
	イギリス	国債証券	千英ポンド 3,487	千英ポンド 2,935
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 1,394	千スウェーデンクローナ —
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,605	千ノルウェークローネ 2,698
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 2,004	千デンマーククローネ 2,322
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 2,124	千ポーランドズロチ 1,482
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 5,022	千オーストラリアドル 3,869
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 444	千シンガポールドル 404
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 1,871	千マレーシアリンギット 2,039
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 5,922	千イスラエルシェケル —
	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 26,915

(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(2020年4月1日から2021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
0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	253,676	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	208,448
0.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	233,962	2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	207,316
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	202,827	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	188,088
0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	184,630	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	169,852
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	179,413	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,617
1.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	170,700	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	144,693
0.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	166,580	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	141,818
0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,002	3.250% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	137,545
0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	157,080	1.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	137,236
0.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	156,807	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,890

(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(2020年4月1日から2021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(2021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 157,640	千米ドル 163,716	千円 18,125,024	% 43.5	% —	% 18.7	% 17.8	% 7.0
カナダ	千カナダドル 8,560	千カナダドル 9,427	827,516	2.0	—	1.0	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 57,590	千メキシコペソ 61,368	330,162	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	20,410	24,222	3,144,023	7.5	—	4.5	2.3	0.7
イタリア	25,770	30,838	4,002,877	9.6	—	5.8	2.6	1.2
フランス	27,790	33,468	4,344,196	10.4	—	7.1	2.5	0.8
オランダ	4,940	6,066	787,434	1.9	—	1.4	0.4	0.1
スペイン	15,410	19,053	2,473,191	5.9	—	4.2	1.4	0.3
ベルギー	6,510	7,969	1,034,457	2.5	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	3,970	4,860	630,938	1.5	—	0.9	0.4	0.2
フィンランド	1,830	2,029	263,483	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	2,420	2,767	359,182	0.9	—	0.6	0.1	0.1
イギリス	千英ポンド 14,280	千英ポンド 18,129	2,759,877	6.6	—	4.9	1.1	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 9,150	千スウェーデンクローナ 10,194	129,366	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,520	千ノルウェークローネ 7,694	99,714	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 9,460	千デンマーククローネ 11,664	203,539	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,570	千ポーランドズロチ 9,220	256,881	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 10,320	千オーストラリアドル 11,189	943,975	2.3	—	1.7	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,010	千シンガポールドル 2,198	180,876	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,070	千マレーシアリンギット 7,298	194,497	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 4,980	千イスラエルシェケル 5,689	188,821	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	41,280,039	99.0	—	55.1	31.5	12.5

(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	
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	2,220	2,215	245,315	2023/ 7/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,090	1,087	120,400	2023/ 8/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	300	299	33,109	2023/10/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,550	1,543	170,876	2023/12/15
0.125% US TREASURY N/B	国債証券	0.125	1,120	1,114	123,404	2024/ 1/15
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,200	1,199	132,810	2023/11/15
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,200	1,176	130,267	2025/ 6/30
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	550	538	59,606	2025/ 7/31
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	1,500	1,466	162,341	2025/ 8/31
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	400	389	43,156	2025/10/31
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	1,140	1,115	123,547	2025/11/30
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	1,500	1,463	162,056	2026/ 1/31
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	820	772	85,498	2027/ 9/30
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,500	1,435	158,890	2027/ 5/31
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	856	94,789	2027/ 8/31
0.500% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	853	94,454	2027/10/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,200	1,143	126,593	2027/12/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,400	1,274	141,153	2030/ 5/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,550	1,405	155,647	2030/ 8/15
0.750% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	850	815	90,302	2028/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,430	2,249	249,016	2030/11/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	300	305	33,864	2025/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	100	94	10,468	2031/ 2/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	980	800	88,678	2040/ 5/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,510	1,229	136,127	2040/ 8/15
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,095	121,328	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	713	78,980	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	640	657	72,742	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	900	925	102,417	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,049	116,135	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	800	823	91,204	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	560	61,998	2026/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,120	954	105,638	2040/11/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,410	1,103	122,124	2050/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	750	765	84,699	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	921	102,052	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	615	68,133	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	680	698	77,288	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,380	1,428	158,103	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,855	205,379	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	480	489	54,228	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,550	1,531	169,602	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	765	84,758	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,567	173,488	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	679	75,260	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	720	742	82,177	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	710	735	81,392	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,130	1,169	129,500	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,550	2,634	291,639	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,134	125,605	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,426	157,895	2029/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	640	534	59,196	2050/11/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	874	96,780	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	671	74,370	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	672	74,432	2022/ 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	
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	764	84,621	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	704	77,959	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,480	163,940	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	624	69,184	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	957	105,968	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,800	1,859	205,863	2023/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,036	114,714	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	840	854	94,645	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	917	101,546	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	765	84,751	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	720	736	81,585	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,188	131,614	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,385	153,381	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	513	56,881	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	995	110,211	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,171	129,662	2026/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	676	74,912	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,039	115,110	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,381	152,952	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	972	107,644	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	577	63,930	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,565	173,283	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,387	153,615	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,928	213,536	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,919	212,479	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,520	1,596	176,732	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,040	953	105,594	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	635	70,372	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,479	163,782	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,060	1,112	123,174	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	820	90,860	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,453	160,884	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	918	101,697	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	528	58,494	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,427	158,075	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,210	1,281	141,923	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	830	848	93,949	2022/ 4/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	916	101,494	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	949	105,111	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	796	88,170	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,518	168,061	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	850	94,151	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,750	1,865	206,487	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,286	142,404	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,110	1,177	130,357	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	990	1,048	116,119	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	760	84,147	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	1,677	185,707	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	811	89,875	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,831	202,783	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,480	1,583	175,281	2027/ 5/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,329	147,177	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	858	95,023	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,200	1,265	140,086	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,630	1,737	192,412	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	654	72,471	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	780	840	93,039	2026/ 2/28

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	
(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	830	849	94,078	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	848	93,956	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	787	87,178	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	863	95,549	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	830	898	99,513	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,020	1,104	122,249	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	670	705	78,133	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	738	81,789	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,198	132,715	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,289	142,708	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,620	1,733	191,904	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,040	1,135	125,698	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	537	59,454	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	857	94,940	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,062	117,643	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	960	1,046	115,805	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,286	142,425	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,360	1,496	165,680	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,490	1,640	181,634	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	790	865	95,769	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	833	92,244	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,153	127,742	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	260	290	32,202	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	610	681	75,499	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	800	894	99,016	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	330	369	40,909	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,043	115,556	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	850	954	105,653	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,380	1,552	171,853	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,465	162,239	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	308	34,116	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	627	69,424	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	1,038	114,984	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	1,864	206,378	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	480	569	63,067	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	276	30,567	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	824	91,230	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	1,059	117,324	2044/ 2/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	315	34,962	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	450	596	66,014	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	388	42,996	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	340	456	50,539	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	337	37,340	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	397	44,002	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	40	4,463	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	312	34,546	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	320	441	48,928	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	50	70	7,804	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	56	6,223	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	1,260	1,607	178,019	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	153	17,028	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	100	133	14,824	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	154	17,098	2028/ 8/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	120	157	17,390	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	228	25,312	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	251	27,844	2030/ 5/15
小 計	—	—	—	—	18,125,024	—

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	
0.500% CANADA GOV' T	国債証券	0.5	150	150	13,208	2022/ 3/ 1
0.500% CANADA GOV' T	国債証券	0.5	350	317	27,838	2030/12/ 1
1.000% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	710	718	63,046	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	290	287	25,264	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	550	564	49,570	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	500	515	45,262	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	330	338	29,704	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	460	473	41,536	2023/ 3/ 1
2.000% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	680	707	62,081	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	390	409	35,987	2028/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	740	785	68,918	2025/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	350	374	32,835	2029/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	280	297	26,127	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	670	690	60,589	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	330	385	33,840	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	180	220	19,381	2064/12/ 1
3.500% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	370	482	42,341	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	300	407	35,751	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	260	378	33,190	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	420	561	49,295	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	250	361	31,743	2033/ 6/ 1
小 計	—	—	—	—	827,516	—
(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	6,514	35,049	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	1,840	2,296	12,354	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	3,119	16,784	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,200	8,361	44,985	2022/ 6/ 9
6.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.75	3,000	3,102	16,691	2023/ 3/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	6,880	7,314	39,353	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,459	13,234	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	2,927	15,752	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,680	3,728	20,057	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,424	23,805	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	4,869	26,200	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,900	4,001	21,528	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,348	23,393	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,897	20,971	2038/11/18
小 計	—	—	—	—	330,162	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	600	604	78,401	2022/ 4/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	414	53,771	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	540	547	71,108	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	509	66,100	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	450	461	59,870	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	330	339	44,024	2025/ 4/11
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	610	630	81,838	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	390	403	52,393	2027/11/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	510	527	68,422	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	710	731	94,941	2030/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	240	221	28,728	2050/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	730	753	97,795	2030/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	608	79,025	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	430	453	58,867	2028/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	440	464	60,264	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	596	77,463	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	760	803	104,241	2026/ 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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	610	651	84,577	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	460	59,782	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	710	751	97,558	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	670	719	93,427	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	390	494	64,168	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	453	58,905	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	468	60,839	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	780	816	106,022	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	820	877	113,897	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	401	52,176	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	470	503	65,404	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	436	56,687	2023/ 8/15
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	730	1,126	146,243	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	866	112,482	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	370	617	80,131	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	760	1,247	161,871	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	330	585	76,000	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	280	389	50,579	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	460	763	99,067	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	410	782	101,561	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	537	69,781	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	360	513	66,629	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	351	45,581	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	334	43,386	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	—	70	70	9,150	2024/ 1/15
0.300% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.3	500	507	65,847	2023/ 8/15
0.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.5	270	276	35,852	2026/ 2/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	540	553	71,788	2023/10/15
0.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.85	420	436	56,663	2027/ 1/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	569	73,930	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	510	522	67,879	2023/ 3/15
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	210	219	28,457	2027/ 9/15
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	450	463	60,226	2030/ 8/ 1
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	520	552	71,727	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	710	723	93,853	2022/ 4/15
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	430	459	59,620	2030/ 4/ 1
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	472	61,296	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	410	433	56,315	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	740	788	102,391	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	410	53,225	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	450	492	63,883	2030/12/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	403	52,396	2032/ 3/ 1
1.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.75	370	393	51,080	2024/ 7/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	400	425	55,279	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	430	470	61,060	2025/12/ 1
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	545	70,839	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	365	47,387	2026/ 7/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	430	482	62,628	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	430	499	64,800	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	377	48,954	2033/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	310	366	47,509	2050/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	460	59,804	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	400	493	64,105	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	590	696	90,389	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	330	408	53,045	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	390	493	64,097	2038/ 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	
3.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.1	260	336	43,653	2040/ 3/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	430	580	75,348	2046/ 9/ 1
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	400	520	67,527	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	560	72,791	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	715	92,867	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	380	431	55,967	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	887	115,235	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	517	67,204	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	450	512	66,499	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	573	74,433	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	638	82,842	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	540	711	92,388	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	410	671	87,181	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	367	47,692	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	1,060	1,272	165,201	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	370	555	72,125	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	430	691	89,726	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	560	908	117,929	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	853	110,746	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	574	74,524	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	480	62,411	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	682	88,540	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	910	118,198	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	530	744	96,676	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	181	23,569	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	124	16,104	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	—	570	574	74,548	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	990	1,003	130,198	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	50	50	6,610	2024/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	880	899	116,782	2025/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	350	358	46,488	2026/ 2/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	710	717	93,190	2029/11/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	580	581	75,524	2030/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	700	726	94,349	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	820	856	111,151	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	787	102,246	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	791	102,791	2029/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	50	49	6,465	2040/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	190	153	19,882	2072/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	840	902	117,154	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	760	817	106,135	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	740	792	102,890	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	730	792	102,864	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	220	249	32,402	2034/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	610	693	90,001	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	1,000	1,153	149,672	2031/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	440	522	67,780	2050/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	1,050	1,104	143,404	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	956	124,104	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	690	848	110,125	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	340	442	57,380	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV' T	国債証券	2.0	600	787	102,248	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	800	836	108,627	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	890	971	126,057	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	950	1,177	152,842	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	1,010	1,218	158,209	2027/10/25

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	
3.000% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	290	301	39,113	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	610	966	125,457	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	930	1,120	145,436	2026/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	984	127,745	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	410	794	103,152	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	628	81,630	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	1,040	1,172	152,162	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	680	1,201	155,953	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	710	1,157	150,245	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	760	1,115	144,746	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	760	1,261	163,706	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	570	742	96,433	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	202	26,278	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	—	240	244	31,745	2024/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	—	270	275	35,764	2030/ 7/15
0.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	—	80	71	9,312	2052/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	340	352	45,782	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	260	271	35,297	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.5	290	306	39,753	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.75	440	473	61,521	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.75	240	260	33,750	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.75	340	359	46,621	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	260	283	36,741	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.25	310	321	41,754	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.5	270	352	45,752	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	340	552	71,776	2047/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	50	54	7,011	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	310	534	69,442	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	500	808	104,988	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	320	450	58,495	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	91	11,923	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	600	611	79,390	2023/ 7/30
0.450% SPANISH GOV' T	国債証券	0.45	370	375	48,780	2022/10/31
0.600% SPANISH GOV' T	国債証券	0.6	510	528	68,614	2029/10/31
0.800% SPANISH GOV' T	国債証券	0.8	140	147	19,196	2027/ 7/30
1.000% SPANISH GOV' T	国債証券	1.0	180	167	21,754	2050/10/31
1.250% SPANISH GOV' T	国債証券	1.25	300	327	42,467	2030/10/31
1.300% SPANISH GOV' T	国債証券	1.3	460	499	64,783	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	430	472	61,373	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	520	572	74,326	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	630	693	89,951	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	340	376	48,867	2029/ 4/30
1.450% SPANISH GOV' T	国債証券	1.45	120	110	14,280	2071/10/31
1.500% SPANISH GOV' T	国債証券	1.5	470	517	67,155	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	453	58,909	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	380	422	54,897	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	650	751	97,573	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	440	490	63,628	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV' T	国債証券	2.35	480	583	75,767	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV' T	国債証券	2.7	220	296	38,453	2048/10/31
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	620	690	89,634	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	330	456	59,265	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	310	492	63,922	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	620	701	91,082	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	490	743	96,458	2037/ 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	
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	420	473	61,455	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	650	791	102,754	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	430	725	94,124	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	300	345	44,792	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	550	938	121,791	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	780	1,080	140,263	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	280	516	67,014	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	570	632	82,080	2023/ 1/31
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	680	1,081	140,392	2032/ 7/30
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	500	664	86,226	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	220	321	41,760	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	224	29,184	2023/10/22
0.650% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.65	90	77	10,014	2071/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	455	59,067	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	268	34,899	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	464	60,329	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	440	480	62,326	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	390	420	54,595	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	290	320	41,583	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	180	204	26,592	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	163	21,217	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	290	348	45,226	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	220	274	35,592	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	150	215	27,966	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	362	47,022	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	120	171	22,228	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	464	60,261	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	246	31,966	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	200	337	43,815	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	240	251	32,594	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	150	215	28,034	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	120	128	16,731	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	300	511	66,443	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	250	32,548	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	629	81,769	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	481	62,442	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% REP OF AUSTRIA	国債証券	—	70	65	8,443	2040/10/20
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	450	477	61,943	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	320	342	44,401	2026/10/20
0.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.85	60	57	7,474	2120/ 6/30
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	260	281	36,481	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	174	22,653	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	40	54	7,036	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	290	313	40,713	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	413	53,735	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	130	223	28,957	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	170	221	28,705	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	160	257	33,484	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	400	426	55,393	2022/11/22
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	190	198	25,774	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	70	149	19,369	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	405	52,627	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	228	29,704	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	400	570	74,037	2027/ 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…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	120	118	15,345	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	84	10,926	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	170	180	23,387	2027/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	230	243	31,660	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	195	25,352	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	95	12,435	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	150	184	23,998	2047/ 4/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	104	13,556	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	240	248	32,201	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	140	151	19,649	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	90	131	17,131	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	159	20,733	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	110	131	17,105	2025/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% IRISH GOV' T	国債証券	0.2	90	91	11,919	2030/10/18
0.800% IRISH GOV' T	国債証券	0.8	140	141	18,413	2022/ 3/15
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	379	49,232	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	290	311	40,457	2026/ 5/15
1.300% IRISH GOV' T	国債証券	1.3	220	250	32,459	2033/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	80	95	12,337	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	220	265	34,512	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	170	222	28,827	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	306	39,816	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	167	21,775	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	230	250	32,516	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	230	284	36,914	2025/ 3/13
小 計	—	—	—	—	17,039,785	—
(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	57,893	2023/ 1/31
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	150	148	22,567	2026/ 1/30
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	60	58	8,834	2028/ 1/31
0.375% UK TREASURY	国債証券	0.375	580	553	84,258	2030/10/22
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	490	497	75,733	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	440	446	68,012	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	180	181	27,620	2029/10/22
1.000% UK TREASURY	国債証券	1.0	230	236	35,930	2024/ 4/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	390	407	62,041	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	455	69,275	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	350	360	54,820	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	190	203	31,000	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	250	291	44,329	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	717	109,214	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	520	559	85,215	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	350	394	60,127	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	350	376	57,361	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	650	684	104,164	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	525	80,004	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	304	46,396	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	420	576	87,765	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	675	102,764	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	632	96,267	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	564	86,000	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	360	373	56,846	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	310	567	86,411	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	370	460	70,057	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	471	71,795	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	512	78,083	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	270	403	61,431	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	370	560	85,377	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	616	93,921	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	489	74,537	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	450	817	124,477	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	270	385	58,640	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	380	607	92,440	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	260	354	53,967	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	515	78,508	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	370	439	66,852	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	230	321	48,930	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,759,877	—
(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	488	6,199	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	1,100	1,140	14,472	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,243	15,784	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,914	24,290	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,142	14,492	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	2,160	2,256	28,635	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	2,008	25,490	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	129,366	—
(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	
1.250% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.25	500	485	6,294	2031/ 9/17
1.375% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.375	1,000	989	12,829	2030/ 8/19
1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.5	880	898	11,638	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	866	11,223	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	990	12,833	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,178	15,276	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,401	18,163	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	883	11,454	2024/ 3/14
小計	—	—	—	—	99,714	—
(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	
0.250% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.25	650	656	11,453	2022/11/15
0.250% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.25	560	525	9,171	2052/11/15
0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,740	1,832	31,981	2027/11/15
0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,710	1,802	31,459	2029/11/15
1.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,198	20,905	2023/11/15
1.750% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,250	1,376	24,022	2025/11/15
4.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,410	4,271	74,545	2039/11/15
小計	—	—	—	—	203,539	—
(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	
0.750% POLAND GOV' T	国債証券	0.75	220	220	6,153	2025/ 4/25
1.250% POLAND GOV' T	国債証券	1.25	220	213	5,941	2030/10/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	830	849	23,678	2022/ 4/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	600	636	17,730	2024/10/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	814	22,691	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	745	20,778	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	824	22,962	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	590	647	18,053	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	1,230	1,357	37,828	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,141	31,789	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,052	29,334	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	715	19,939	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	256,881	—
(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	
0.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	0.25	200	196	16,544	2025/11/21
1.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.25	350	327	27,635	2032/ 5/21

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	
1. 500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1. 5	630	613	51, 760	2031/ 6/21
1. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1. 75	340	271	22, 898	2051/ 6/21
2. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 25	650	673	56, 775	2022/11/21
2. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 25	590	628	53, 062	2028/ 5/21
2. 500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 5	740	793	66, 952	2030/ 5/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	360	389	32, 817	2024/ 4/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	570	628	53, 025	2027/11/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	520	572	48, 315	2028/11/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	630	691	58, 344	2029/11/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	240	257	21, 726	2035/ 6/21
2. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2. 75	80	82	6, 951	2041/ 5/21
3. 000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3. 0	290	306	25, 858	2047/ 3/21
3. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3. 25	290	325	27, 471	2039/ 6/21
3. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3. 25	900	999	84, 359	2025/ 4/21
3. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3. 25	710	808	68, 197	2029/ 4/21
3. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3. 75	320	382	32, 267	2037/ 4/21
4. 250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4. 25	410	481	40, 610	2026/ 4/21
4. 500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4. 5	230	294	24, 805	2033/ 4/21
4. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4. 75	630	768	64, 817	2027/ 4/21
5. 500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5. 5	260	288	24, 377	2023/ 4/21
5. 750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5. 75	380	407	34, 403	2022/ 7/15
小 計	—	—	—	—	943, 975	—
(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	162	13, 331	2022/ 4/ 1
2. 125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 125	80	83	6, 910	2026/ 6/ 1
2. 375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 375	100	106	8, 721	2025/ 6/ 1
2. 750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 75	120	125	10, 335	2023/ 7/ 1
2. 750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 75	140	155	12, 798	2042/ 4/ 1
2. 750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 75	190	212	17, 469	2046/ 3/ 1
2. 875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2. 875	300	329	27, 082	2029/ 7/ 1
3. 000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3. 0	200	214	17, 681	2024/ 9/ 1
3. 125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3. 125	110	114	9, 384	2022/ 9/ 1
3. 375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3. 375	300	346	28, 467	2033/ 9/ 1
3. 500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3. 5	310	348	28, 694	2027/ 3/ 1
小 計	—	—	—	—	180, 876	—
(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	307	8, 200	2023/ 3/15
3. 502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 502	430	441	11, 773	2027/ 5/31
3. 757% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 757	800	826	22, 019	2023/ 4/20
3. 757% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 757	350	325	8, 684	2040/ 5/22
3. 795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 795	360	369	9, 847	2022/ 9/30
3. 844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 844	940	926	24, 679	2033/ 4/15
3. 885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 885	500	521	13, 891	2029/ 8/15
3. 899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 899	300	314	8, 378	2027/11/16
3. 900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 9	250	264	7, 049	2026/11/30
3. 955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3. 955	600	631	16, 838	2025/ 9/15
4. 181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 181	590	622	16, 587	2024/ 7/15
4. 498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 498	440	474	12, 657	2030/ 4/15
4. 736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 736	530	551	14, 703	2046/ 3/15
4. 762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 762	320	337	8, 997	2037/ 4/ 7
4. 893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 893	180	191	5, 105	2038/ 6/ 8
4. 935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4. 935	180	190	5, 082	2043/ 9/30
小 計	—	—	—	—	194, 497	—
(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	659	21, 875	2022/ 7/31
1. 250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1. 25	700	715	23, 762	2022/11/30
1. 500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1. 5	300	311	10, 347	2023/11/30

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	
1.500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5	200	194	6,444	2037/ 5/31
1.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.75	350	373	12,400	2025/ 8/31
2.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.25	700	776	25,786	2028/ 9/28
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	600	663	22,004	2024/ 3/31
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	650	848	28,164	2047/ 3/31
5.500% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	5.5	130	210	6,996	2042/ 1/31
6.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.25	700	935	31,039	2026/10/30
小 計	—	—	—	—	188,821	—
合 計	—	—	—	—	41,280,039	—

(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。

■投資信託財産の構成(2021年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	41,280,039	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	518,007	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	41,798,046	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(41,561,659千円)の投資信託財産総額(41,798,046千円)に対する比率は99.4%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、2021年3月31日における邦貨換算レートは1米ドル＝110.71円、1カナダドル＝87.78円、1メキシコペソ＝5.38円、1ユーロ＝129.80円、1英ポンド＝152.23円、1スウェーデンクローナ＝12.69円、1ノルウェークローネ＝12.96円、1デンマーククローネ＝17.45円、1ポーランドズロチ＝27.86円、1オーストラリアドル＝84.36円、1シンガポールドル＝82.27円、1マレーシアリンギット＝26.65円、1イスラエルシェケル＝33.19円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2021年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,891,337,460円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	230,255,194
公 社 債(評価額)	41,280,039,544
未 収 入 金	93,867,397
未 収 利 息	281,340,814
前 払 費 用	5,834,511
(B) 負 債	202,322,651
未 払 金	187,022,262
未 払 解 約 金	15,300,000
未 払 利 息	389
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	41,689,014,809
元 本	17,207,757,897
次 期 繰 越 損 益 金	24,481,256,912
(D) 受 益 権 総 口 数	17,207,757,897口
1万口当たり基準価額(C／D)	24,227円

(注1) 当ファンドの期首元本額は17,947,491,892円、期中追加設定元本額は1,053,850,326円、期中一部解約元本額は1,793,584,321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)	7,842,592,576円
日立外国債券インデックスファンド	6,901,950,875円
日立バランスファンド(株式70)	1,098,076,970円
日立バランスファンド(株式50)	992,276,419円
日立バランスファンド(株式30)	372,861,057円

(注3) 1口当たり純資産額は2,4227円です。

■損益の状況

当期(自2020年4月1日 至2021年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	891,878,023円
受 取 利 息	891,929,326
そ の 他 収 益 金	10,773
支 払 利 息	△62,076
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	698,987,197
売 買 益	2,854,872,868
売 買 損	△2,155,885,671
(C) 信 託 報 酬 等	△6,231,298
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	1,584,633,922
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,865,484,508
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,435,423,730
(G) 解 約 差 損 益 金	△2,404,285,248
(H) 計 (D＋E＋F＋G)	24,481,256,912
次 期 繰 越 損 益 金(H)	24,481,256,912

(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。