◇MUZ-252737-0000-20230206◇

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	2027年２月５日まで（2017年３月27日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱ＵＦＪ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
主要運用対象	投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

海外債券セレクション（ラップ向け）

第６期（決算日：2023年２月６日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「海外債券セレクション（ラップ向け）」は、去る２月６日に第６期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番１号
ホームページ　https://www.am.mufg.jp/

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
・－印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			（参考指数）FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2019年2月5日)	10,410	0	△2.6	113,019.80	△1.7	62.8	－	34.7	5,700
3期(2020年2月5日)	11,178	0	7.4	120,270.89	6.4	64.3	－	32.8	6,384
4期(2021年2月5日)	11,579	0	3.6	124,867.08	3.8	63.4	－	33.2	8,265
5期(2022年2月7日)	11,855	0	2.4	127,308.73	2.0	63.0	－	32.8	14,001
6期(2023年2月6日)	11,861	0	0.1	127,806.02	0.4	64.2	－	32.5	20,928

（注）基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
（注）ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。
（注）外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		（参考指数）FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2022年2月7日	11,855	－	127,308.73	－	63.0	－	32.8
2月末	11,625	△1.9	125,907.80	△1.1	63.7	－	32.9
3月末	12,023	1.4	129,775.21	1.9	63.1	－	33.2
4月末	12,022	1.4	129,955.37	2.1	63.1	－	32.8
5月末	11,948	0.8	129,451.47	1.7	63.7	－	33.1
6月末	12,201	2.9	132,579.22	4.1	63.2	－	32.9
7月末	12,335	4.0	133,117.57	4.6	64.1	－	33.2
8月末	12,238	3.2	131,430.25	3.2	63.7	－	32.9
9月末	12,069	1.8	130,076.63	2.2	63.8	－	32.6
10月末	12,365	4.3	134,355.57	5.5	63.3	－	32.5
11月末	12,110	2.2	130,450.40	2.5	63.2	－	33.0
12月末	11,602	△2.1	123,946.23	△2.6	62.9	－	33.2
2023年1月末	11,739	△1.0	125,559.33	△1.4	63.9	－	32.9
（期末）							
2023年2月6日	11,861	0.1	127,806.02	0.4	64.2	－	32.5

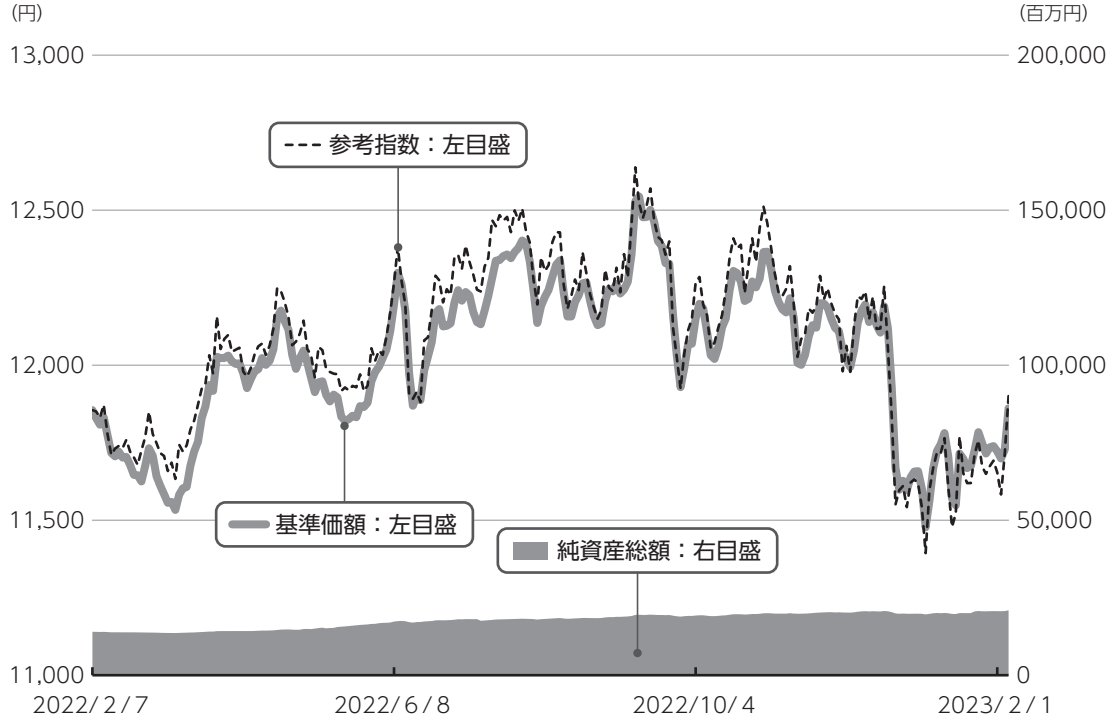
（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第６期：2022年２月８日～2023年２月６日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第６期首	11,855円
第６期末	11,861円
既払分配金	0円
騰落率	0.1％

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.1％の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

組み入れを行った投資信託証券のうち、主に、「グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）」が円安・米ドル高等を背景に上昇したこと等が基準価額のプラス要因となりました。

第６期：2022年２月８日～2023年２月６日

投資環境について

▶ 海外債券市況

海外債券市況は下落しました。

米国と欧州主要国の長期金利は、インフレ率の高止まり等を受けて米国や欧州の中央銀行が積極的な利上げ姿勢を示したこと等から上昇し、海外債券市況は下落しました。

▶ 為替市況

米ドルとユーロは円に対して上昇しました。

米ドルとユーロは、米国や欧州の中央銀行が積極的な利上げ姿勢を示したこと等が上昇要因となり、期間を通じてみると対円で上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行いました。
投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱ＵＦＪ信託銀行の投資助言に基づき決定し、期間の初めから「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）」に投資を行いました。

（ご参考）

■投資信託証券別組入比率表

（%）

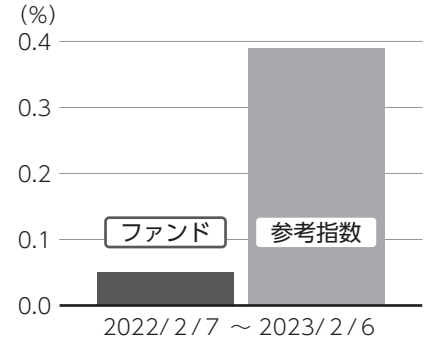
投資信託証券	期首	期末
外国債券インデックスマザーファンド	61.0	61.4
新興国債券インデックスマザーファンド	3.8	3.7
グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）（※）	32.8	32.5

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する各投資信託証券の評価額の割合です。
（※）グローバル社債マザーファンドへの投資を行います。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
参考指数はＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第６期 2022年２月８日～2023年２月６日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,861

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

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

海外債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用方針を継続します。
引き続き、投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱ＵＦＪ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

2022年２月８日～2023年２月６日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信　託　報　酬	50	0.417	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（期中の日数÷年間日数）
（投　信　会　社）	(40)	(0.329)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販　売　会　社）	(5)	(0.044)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受　託　会　社）	(5)	(0.044)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)そ　の　他　費　用	2	0.014	(b)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）	(1)	(0.010)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監　査　費　用）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（そ　の　他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合　計	52	0.431	

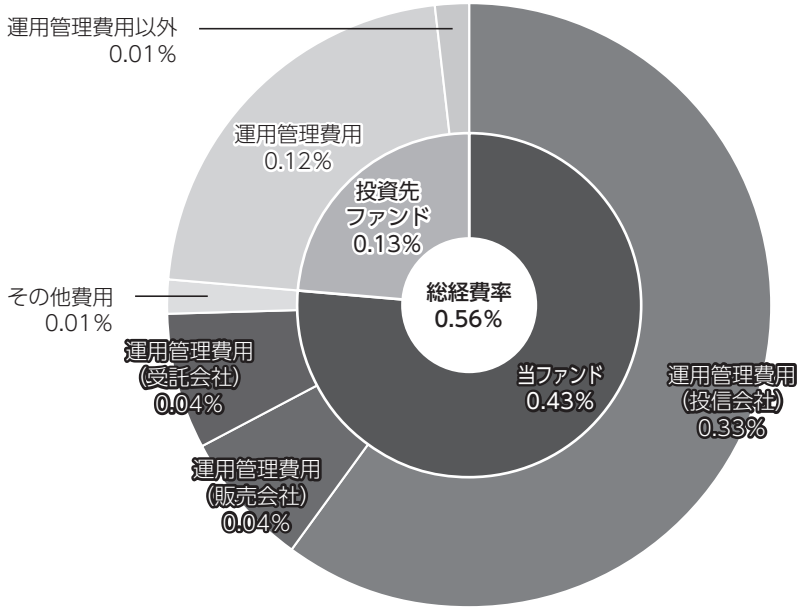
期中の平均基準価額は、12,024円です。

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）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を含みます。
（注）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
（注）当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「１万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

（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0.56%**です。



総経費率（①+②+③）	（%）	0.56
①当ファンドの費用の比率	（%）	0.43
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	（%）	0.12
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	（%）	0.01

（注）①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）投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
（注）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
（注）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
（注）前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

（2022年２月８日～2023年２月６日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）	1,890,705	2,451,330	194,295	251,260

（注）金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
新興国債券インデックスマザーファンド	221,879	313,780	71,938	102,980
外国債券インデックスマザーファンド	2,109,985	4,910,900	220,355	514,990

○利害関係人との取引状況等

（2022年２月８日～2023年２月６日）

利害関係人との取引状況

＜海外債券セレクション（ラップ向け）＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	2,451	2,451	100.0	251	251	100.0

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	740	200	27.0	740	281	38.0
為替直物取引	22,577	8,504	37.7	12,289	4,747	38.6

平均保有割合　1.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	17,697	11,089	62.7	21,902	13,180	60.2
為替直物取引	188,939	146,255	77.4	69,098	53,932	78.1

平均保有割合　3.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪ信託銀行、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2023年２月６日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末		
	口　数	口　数	評　価　額	比　率
	千口	千口	千円	%
グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）	3,599,887	5,296,296	6,806,800	32.5
合　計	3,599,887	5,296,296	6,806,800	32.5

（注）比率は海外債券セレクション（ラップ向け）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末	
	口　数	口　数	評　価　額
	千口	千口	千円
新興国債券インデックスマザーファンド	370,303	520,244	780,002
外国債券インデックスマザーファンド	3,742,747	5,632,377	12,841,820

○投資信託財産の構成

（2023年２月６日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	6,806,800	32.4
新興国債券インデックスマザーファンド	780,002	3.7
外国債券インデックスマザーファンド	12,841,820	61.2
コール・ローン等、その他	561,311	2.7
投資信託財産総額	20,989,933	100.0

（注）新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（66,378,945千円）の投資信託財産総額（67,111,173千円）に対する比率は98.9%です。

（注）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（405,610,546千円）の投資信託財産総額（409,191,752千円）に対する比率は99.1%です。

（注）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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル＝132.40円	1カナダドル＝98.78円	1アルゼンチンペソ＝0.704円	1メキシコペソ＝6.955円
1ブラジルレアル＝25.7826円	100チリペソ＝16.6305円	100コロンビアペソ＝2.8175円	1ペルーヌエボソル＝34.4769円
1ウルグアイペソ＝3.3929円	1ユーロ＝142.75円	1ドミニカペソ＝2.3346円	1イギリスポンド＝159.29円
1スウェーデンクローネ＝12.54円	1ノルウェークローネ＝12.93円	1セルビアディナール＝1.2172円	1トルコリラ＝7.0341円
1デンマーククローネ＝19.18円	1チェココルナ＝6.0082円	100ハンガリーフォリント＝36.801円	1ポーランドズロチ＝30.2525円
1ルーマニアレイ＝29.1626円	1ニュージーランドドル＝83.58円	1オーストラリアドル＝91.45円	1シンガポールドル＝99.80円
1マレーシアリンギット＝31.0779円	1タイバーツ＝3.95円	1フィリピンペソ＝2.4661円	1中国元＝19.4688円
100インドネシアルピア＝0.89円	1イスラエルシェケル＝38.5644円	1エジプトポンド＝4.3698円	1南アフリカランド＝7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年２月６日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,989,933,520
コール・ローン等	561,310,246
投資信託受益証券(評価額)	6,806,800,802
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	780,002,030
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	12,841,820,442
(B) 負債	61,492,966
未払解約金	19,913,370
未払信託報酬	41,189,129
未払利息	316
その他未払費用	390,151
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	20,928,440,554
元本	17,644,232,536
次期繰越損益金	3,284,208,018
(D) 受益権総口数	17,644,232,536口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,861円

＜注記事項＞
①期首元本額　　11,810,435,273円
　期中追加設定元本額　　8,626,815,259円
　期中一部解約元本額　　2,793,017,996円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.1861円です。

○損益の状況 (2022年２月８日～2023年２月６日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 163,032
受取利息	2,549
支払利息	△ 165,581
(B) 有価証券売買損益	△ 58,478,766
売買益	86,022,578
売買損	△ 144,501,344
(C) 信託報酬等	△ 74,344,979
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 132,986,777
(E) 前期繰越損益金	472,128,450
(F) 追加信託差損益金	2,945,066,345
(配当等相当額)	(2,027,891,008)
(売買損益相当額)	(917,175,337)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	3,284,208,018
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	3,284,208,018
追加信託差損益金	2,945,066,345
(配当等相当額)	(2,032,636,330)
(売買損益相当額)	(912,430,015)
分配準備積立金	658,221,599
繰越損益金	△ 319,079,926

(注) (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) (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) (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。

②分配金の計算過程

項　　目	2022年２月８日～ 2023年２月６日
費用控除後の配当等収益額	186,093,149円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	2,625,986,419円
分配準備積立金額	472,128,450円
当ファンドの分配対象収益額	3,284,208,018円
１万口当たり収益分配対象額	1,861円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

＊三菱ＵＦＪ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（https://www.am.mufg.jp/）をご覧ください。

外国債券インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年５月12日

［計算期間：2021年５月13日～2022年５月12日］

「外国債券インデックスマザーファンド」は、５月12日に第21期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○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、円換算ベース）		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			
	円	%		%	%	%	百万円
17期(2018年５月14日)	20,178	1.4	112,563.85	1.4	98.9	－	120,314
18期(2019年５月13日)	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	－	137,361
19期(2020年５月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	－	149,310
20期(2021年５月12日)	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	－	197,147
21期(2022年５月12日)	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	－	302,225

（注）ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。
（注）外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○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、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2021年５月12日	22,636	－	126,522.01	－	97.7	－
５月末	22,974	1.5	128,227.80	1.3	97.1	－
６月末	22,935	1.3	128,117.08	1.3	97.6	－
７月末	23,095	2.0	128,989.36	2.0	97.8	－
８月末	23,089	2.0	128,937.19	1.9	97.5	－
９月末	22,929	1.3	128,115.00	1.3	97.4	－
10月末	23,422	3.5	130,788.36	3.4	97.6	－
11月末	23,162	2.3	129,217.14	2.1	97.5	－
12月末	23,305	3.0	130,157.13	2.9	98.0	－
2022年１月末	22,902	1.2	128,015.91	1.2	97.3	－
２月末	22,489	△0.6	125,907.80	△0.5	98.0	－
３月末	23,230	2.6	129,775.21	2.6	97.9	－
４月末	23,282	2.9	129,955.37	2.7	97.7	－
（期　末）						
2022年５月12日	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

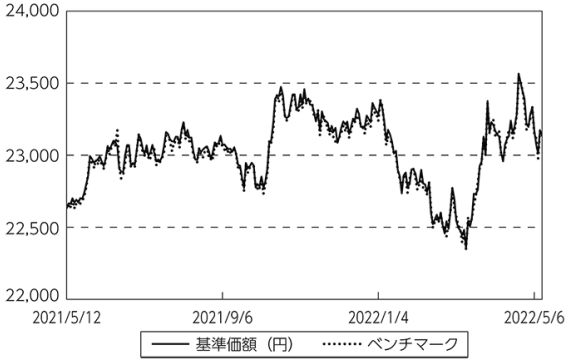
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.3%）を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因
（上昇要因）
　ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について
◎債券市況
　先進国の債券市況は下落しました。
・先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期首との比較では下落しました。

◎為替市況
・期首に比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは2.3%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・ありません。

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

○今後の運用方針
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2021年５月13日～2022年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	3	0.012	(a)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)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.012	
期中の平均基準価額は、23,030円です。			

（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2021年５月13日～2022年５月12日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 1,080,503	千アメリカドル 603,453
	カナダ	国債証券	千カナダドル 41,240	千カナダドル 18,848
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 168,111	千メキシコペソ 62,575
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	102,270	52,175
	イタリア	国債証券	104,166	41,376
	フランス	国債証券	117,831	48,235
	オランダ	国債証券	22,417	6,360
	スペイン	国債証券	170,793	114,710
	ベルギー	国債証券	23,802	6,642
	オーストリア	国債証券	18,798	6,534
	フィンランド	国債証券	6,257	1,742
	アイルランド	国債証券	8,466	3,398
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 57,910	千イギリスポンド 30,408
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 22,604	千スウェーデンクローネ 9,206
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 22,379	千ノルウェークローネ －
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 33,021	千デンマーククローネ 15,143
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 17,657	千ポーランドズロチ 7,509
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 36,009	千オーストラリアドル 29,412
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 12,607	千シンガポールドル 7,649
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 25,246	千マレーシアリンギット 7,760
	中国	国債証券	千中国元 274,306	千中国元 21,270
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 13,565	千イスラエルシェケル 5,062

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	24,323	13,310	54.7	23,471	13,202	56.2
為替直物取引	144,540	91,369	63.2	44,380	39,543	89.1

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪ信託銀行、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

(2022年５月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	1,229,120	1,153,690	149,714,391	49.5	－	21.9	18.2	9.5
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	64,130	60,134	6,009,246	2.0	－	1.0	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	362,770	344,969	2,207,147	0.7	－	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	130,360	139,363	19,034,225	6.3	－	4.1	2.0	0.2
イタリア	178,150	182,021	24,860,526	8.2	－	4.8	2.5	0.9
フランス	184,260	191,262	26,122,645	8.6	－	5.8	2.7	0.2
オランダ	36,440	38,314	5,232,948	1.7	－	1.2	0.5	0.1
スペイン	134,130	139,218	19,014,468	6.3	－	3.3	1.7	1.3
ベルギー	42,280	44,624	6,094,786	2.0	－	1.5	0.5	－
オーストリア	26,780	28,083	3,835,582	1.3	－	0.8	0.5	－
フィンランド	12,330	11,928	1,629,137	0.5	－	0.3	0.2	0.0
アイルランド	14,960	14,853	2,028,732	0.7	－	0.5	0.1	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	90,640	98,303	15,623,414	5.2	－	4.1	0.9	0.2
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	59,530	58,748	757,265	0.3	－	0.1	0.1	0.0
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	56,670	54,119	721,417	0.2	－	0.1	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	59,280	62,754	1,152,167	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	49,630	41,436	1,210,444	0.4	－	0.2	0.2	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	53,730	49,752	4,480,744	1.5	－	1.0	0.4	－
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	13,830	13,428	1,254,396	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	50,650	48,949	1,449,034	0.5	－	0.3	0.1	0.0
	千中国元	千中国元						
中国	248,000	253,388	4,891,287	1.6	－	0.8	0.7	0.2
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	28,510	29,965	1,127,330	0.4	－	0.2	0.1	0.1
合計	－	－	298,451,346	98.8	－	52.9	32.5	13.3

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 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)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	0.125 T-NOTE 230630	0.125	10,000	9,766	1,267,335	2023/6/30
		0.125 T-NOTE 230715	0.125	5,300	5,169	670,908	2023/7/15
		0.125 T-NOTE 230731	0.125	7,200	7,013	910,182	2023/7/31
		0.125 T-NOTE 230815	0.125	4,500	4,379	568,362	2023/8/15
		0.125 T-NOTE 230831	0.125	7,500	7,287	945,673	2023/8/31
		0.125 T-NOTE 230915	0.125	6,350	6,164	800,026	2023/9/15
		0.125 T-NOTE 231015	0.125	9,200	8,908	1,156,015	2023/10/15
		0.125 T-NOTE 231215	0.125	8,500	8,187	1,062,542	2023/12/15
		0.125 T-NOTE 240115	0.125	9,100	8,745	1,134,962	2024/1/15
		0.125 T-NOTE 240215	0.125	6,800	6,516	845,690	2024/2/15
		0.25 T-NOTE 230615	0.25	1,300	1,273	165,313	2023/6/15
		0.25 T-NOTE 231115	0.25	4,700	4,546	590,048	2023/11/15
		0.25 T-NOTE 250630	0.25	6,650	6,139	796,697	2025/6/30
		0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,800	5,342	693,334	2025/7/31
		0.375 T-NOTE 240415	0.375	5,300	5,077	658,926	2024/4/15
		0.375 T-NOTE 240715	0.375	7,700	7,326	950,750	2024/7/15
		0.375 T-NOTE 240815	0.375	7,200	6,832	886,677	2024/8/15
		0.375 T-NOTE 240915	0.375	10,000	9,467	1,228,556	2024/9/15
		0.375 T-NOTE 250430	0.375	2,670	2,485	322,583	2025/4/30
		0.375 T-NOTE 251130	0.375	10,150	9,303	1,207,315	2025/11/30
		0.375 T-NOTE 260131	0.375	7,700	7,025	911,679	2026/1/31
		0.375 T-NOTE 270930	0.375	8,300	7,251	941,024	2027/9/30
		0.5 T-NOTE 250331	0.5	2,000	1,872	242,999	2025/3/31
		0.5 T-NOTE 270430	0.5	7,780	6,924	898,632	2027/4/30
		0.5 T-NOTE 270531	0.5	4,280	3,799	493,104	2027/5/31
		0.5 T-NOTE 270630	0.5	3,000	2,657	344,889	2027/6/30
		0.5 T-NOTE 270831	0.5	4,950	4,364	566,432	2027/8/31
		0.625 T-NOTE 241015	0.625	7,400	7,032	912,658	2024/10/15
		0.625 T-NOTE 260731	0.625	7,930	7,219	936,901	2026/7/31
		0.625 T-NOTE 270331	0.625	1,000	897	116,488	2027/3/31
		0.625 T-NOTE 271231	0.625	9,630	8,488	1,101,577	2027/12/31
		0.625 T-NOTE 300515	0.625	10,140	8,490	1,101,833	2030/5/15
		0.625 T-NOTE 300815	0.625	12,260	10,211	1,325,112	2030/8/15
		0.75 T-NOTE 241115	0.75	4,700	4,471	580,280	2024/11/15
		0.75 T-NOTE 260331	0.75	15,950	14,710	1,909,015	2026/3/31
		0.75 T-NOTE 260430	0.75	1,400	1,289	167,278	2026/4/30
		0.75 T-NOTE 260531	0.75	8,200	7,533	977,654	2026/5/31
		0.75 T-NOTE 260831	0.75	5,500	5,026	652,258	2026/8/31
		0.75 T-NOTE 280131	0.75	9,650	8,535	1,107,681	2028/1/31
		0.875 T-NOTE 260630	0.875	8,300	7,652	993,069	2026/6/30
		0.875 T-NOTE 260930	0.875	10,000	9,173	1,190,487	2026/9/30
		0.875 T-NOTE 301115	0.875	12,980	11,005	1,428,133	2030/11/15
		1 T-NOTE 241215	1.0	8,000	7,649	992,659	2024/12/15
		1 T-NOTE 280731	1.0	2,450	2,179	282,814	2028/7/31
		1.125 T-BOND 400515	1.125	770	548	71,187	2040/5/15
		1.125 T-BOND 400815	1.125	6,170	4,361	566,043	2040/8/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.125 T-NOTE 250115	1.125	6,000	5,744	745,467	2025/1/15
		1.125 T-NOTE 250228	1.125	4,150	3,966	514,731	2025/2/28
		1.125 T-NOTE 261031	1.125	5,900	5,465	709,206	2026/10/31
		1.125 T-NOTE 270228	1.125	2,950	2,719	352,853	2027/2/28
		1.125 T-NOTE 280229	1.125	6,200	5,603	727,133	2028/2/29
		1.125 T-NOTE 280831	1.125	5,400	4,834	627,342	2028/8/31
		1.125 T-NOTE 310215	1.125	11,420	9,860	1,279,591	2031/2/15
		1.25 T-BOND 500515	1.25	6,800	4,437	575,892	2050/5/15
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	5,830	5,761	747,634	2023/7/31
		1.25 T-NOTE 261130	1.25	7,300	6,795	881,822	2026/11/30
		1.25 T-NOTE 261231	1.25	8,200	7,620	988,877	2026/12/31
		1.25 T-NOTE 280331	1.25	9,950	9,042	1,173,489	2028/3/31
		1.25 T-NOTE 280430	1.25	2,500	2,269	294,466	2028/4/30
		1.25 T-NOTE 280630	1.25	8,480	7,674	995,906	2028/6/30
		1.25 T-NOTE 280930	1.25	8,000	7,207	935,317	2028/9/30
		1.25 T-NOTE 310815	1.25	14,630	12,669	1,644,086	2031/8/15
		1.375 T-BOND 401115	1.375	6,700	4,953	642,788	2040/11/15
		1.375 T-BOND 500815	1.375	7,500	5,068	657,720	2050/8/15
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,900	2,871	372,628	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	6,550	6,470	839,700	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	6,450	6,362	825,638	2023/9/30
		1.375 T-NOTE 250131	1.375	5,320	5,124	664,972	2025/1/31
		1.375 T-NOTE 281031	1.375	5,400	4,900	635,883	2028/10/31
		1.375 T-NOTE 281231	1.375	8,500	7,703	999,720	2028/12/31
		1.375 T-NOTE 311115	1.375	11,800	10,296	1,336,226	2031/11/15
		1.5 T-NOTE 240930	1.5	6,000	5,824	755,869	2024/9/30
		1.5 T-NOTE 241031	1.5	4,100	3,977	516,136	2024/10/31
		1.5 T-NOTE 241130	1.5	3,930	3,807	494,058	2024/11/30
		1.5 T-NOTE 250215	1.5	4,500	4,345	563,936	2025/2/15
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,040	7,589	984,906	2026/8/15
		1.5 T-NOTE 270131	1.5	6,940	6,517	845,793	2027/1/31
		1.5 T-NOTE 281130	1.5	7,650	6,990	907,116	2028/11/30
		1.5 T-NOTE 300215	1.5	6,940	6,268	813,428	2030/2/15
		1.625 T-BOND 501115	1.625	8,170	5,907	766,589	2050/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,050	1,045	135,651	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	9,650	9,595	1,245,187	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	5,470	5,407	701,745	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	7,260	6,939	900,507	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	6,970	6,638	861,497	2026/5/15
		1.625 T-NOTE 261031	1.625	2,450	2,319	301,046	2026/10/31
		1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,219	417,778	2026/11/30
		1.625 T-NOTE 290815	1.625	9,550	8,754	1,136,092	2029/8/15
		1.625 T-NOTE 310515	1.625	13,750	12,358	1,603,812	2031/5/15
		1.75 T-BOND 410815	1.75	8,530	6,670	865,660	2041/8/15
		1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,150	5,046	654,844	2024/7/31
		1.75 T-NOTE 241231	1.75	3,350	3,262	423,419	2024/12/31
		1.75 T-NOTE 250315	1.75	7,200	6,994	907,700	2025/3/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.75 T-NOTE 261231	1.75	4,300	4,088	530,502	2026/12/31
		1.75 T-NOTE 290131	1.75	6,000	5,566	722,352	2029/1/31
		1.875 T-BOND 410215	1.875	8,100	6,525	846,822	2041/2/15
		1.875 T-BOND 510215	1.875	9,010	6,944	901,127	2051/2/15
		1.875 T-BOND 511115	1.875	8,010	6,184	802,575	2051/11/15
		1.875 T-NOTE 270228	1.875	7,700	7,356	954,614	2027/2/28
		1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,800	5,424	703,919	2029/2/28
		1.875 T-NOTE 320215	1.875	11,300	10,305	1,337,288	2032/2/15
		2 T-BOND 411115	2.0	7,320	5,974	775,295	2041/11/15
		2 T-BOND 500215	2.0	6,440	5,103	662,307	2050/2/15
		2 T-BOND 510815	2.0	8,850	7,036	913,119	2051/8/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	3,600	3,557	461,624	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	11,730	11,577	1,502,461	2024/5/31
		2 T-NOTE 240630	2.0	7,000	6,901	895,615	2024/6/30
		2 T-NOTE 250215	2.0	8,110	7,940	1,030,481	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	3,790	3,690	478,956	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	4,100	3,944	511,917	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	3,300	3,283	426,066	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	7,550	7,490	972,032	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	10,160	10,073	1,307,235	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 240731	2.125	3,450	3,407	442,145	2024/7/31
		2.125 T-NOTE 240930	2.125	3,300	3,254	422,285	2024/9/30
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	1,870	242,710	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	7,770	7,615	988,304	2025/5/15
		2.125 T-NOTE 260531	2.125	5,000	4,855	630,119	2026/5/31
		2.25 T-BOND 410515	2.25	7,290	6,236	809,367	2041/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	3,930	3,259	423,017	2046/8/15
		2.25 T-BOND 490815	2.25	4,750	3,992	518,119	2049/8/15
		2.25 T-BOND 520215	2.25	6,990	5,914	767,485	2052/2/15
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,190	4,171	541,272	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	8,750	8,704	1,129,543	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 240430	2.25	7,600	7,546	979,317	2024/4/30
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	4,800	4,742	615,450	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	3,550	3,504	454,816	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	7,390	7,244	940,119	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	7,890	7,664	994,568	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,690	4,539	589,126	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	8,090	7,820	1,014,817	2027/11/15
		2.375 T-BOND 420215	2.375	4,420	3,853	500,093	2042/2/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	4,650	4,024	522,250	2049/11/15
		2.375 T-BOND 510515	2.375	8,510	7,368	956,205	2051/5/15
		2.375 T-NOTE 240229	2.375	3,750	3,737	484,964	2024/2/29
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	6,390	6,342	823,011	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	3,410	3,326	431,712	2027/5/15
		2.375 T-NOTE 290331	2.375	3,800	3,666	475,847	2029/3/31
		2.375 T-NOTE 290515	2.375	5,000	4,824	626,089	2029/5/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	3,450	3,009	390,518	2046/2/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,930	3,424	444,373	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	7,900	7,925	1,028,546	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,393	829,619	2024/1/31
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,076	1,177,862	2024/5/15
		2.5 T-NOTE 250131	2.5	3,350	3,325	431,536	2025/1/31
		2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,404	441,865	2026/2/28
		2.5 T-NOTE 270331	2.5	5,500	5,405	701,523	2027/3/31
		2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,600	2,612	339,009	2023/6/30
		2.625 T-NOTE 250331	2.625	5,460	5,434	705,278	2025/3/31
		2.625 T-NOTE 250415	2.625	4,000	3,980	516,504	2025/4/15
		2.625 T-NOTE 251231	2.625	6,500	6,449	837,013	2025/12/31
		2.625 T-NOTE 260131	2.625	4,800	4,762	618,078	2026/1/31
		2.625 T-NOTE 290215	2.625	6,910	6,774	879,126	2029/2/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,320	1,214	157,619	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	2,200	2,021	262,342	2042/11/15
		2.75 T-BOND 470815	2.75	3,210	2,948	382,618	2047/8/15
		2.75 T-BOND 471115	2.75	3,710	3,411	442,705	2047/11/15
		2.75 T-NOTE 230731	2.75	700	704	91,364	2023/7/31
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	13,040	13,100	1,700,000	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	8,260	8,283	1,074,914	2024/2/15
		2.75 T-NOTE 250228	2.75	3,440	3,436	445,955	2025/2/28
		2.75 T-NOTE 250630	2.75	5,170	5,159	669,548	2025/6/30
		2.75 T-NOTE 250831	2.75	8,250	8,223	1,067,173	2025/8/31
		2.75 T-NOTE 280215	2.75	10,640	10,540	1,367,808	2028/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	3,430	3,209	416,561	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	2,800	2,613	339,141	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	1,820	1,704	221,161	2046/11/15
		2.875 T-BOND 490515	2.875	5,750	5,482	711,433	2049/5/15
		2.875 T-NOTE 230930	2.875	4,150	4,180	542,458	2023/9/30
		2.875 T-NOTE 231031	2.875	3,700	3,723	483,187	2023/10/31
		2.875 T-NOTE 250430	2.875	6,000	6,013	780,323	2025/4/30
		2.875 T-NOTE 250531	2.875	4,230	4,238	549,999	2025/5/31
		2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	3,803	493,549	2025/11/30
		2.875 T-NOTE 280515	2.875	12,490	12,449	1,615,508	2028/5/15
		2.875 T-NOTE 280815	2.875	11,510	11,459	1,487,117	2028/8/15
		3 T-BOND 420515	3.0	2,570	2,472	320,819	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	3,370	3,204	415,834	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,990	2,846	369,399	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	800	764	99,176	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	4,490	4,300	558,131	2047/2/15
		3 T-BOND 470515	3.0	2,790	2,676	347,377	2047/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	4,680	4,525	587,253	2048/2/15
		3 T-BOND 480815	3.0	5,360	5,194	674,102	2048/8/15
		3 T-BOND 490215	3.0	5,790	5,647	732,936	2049/2/15
		3 T-NOTE 250930	3.0	4,600	4,621	599,786	2025/9/30
		3 T-NOTE 251031	3.0	8,300	8,344	1,082,897	2025/10/31
		3.125 T-BOND 411115	3.125	1,990	1,953	253,480	2041/11/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,600	1,570	203,787	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,310	1,277	165,788	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	4,430	4,307	558,937	2044/8/15
		3.125 T-BOND 480515	3.125	4,410	4,376	567,904	2048/5/15
		3.125 T-NOTE 281115	3.125	9,940	10,038	1,302,712	2028/11/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,760	2,793	362,474	2044/5/15
		3.375 T-BOND 481115	3.375	5,430	5,659	734,433	2048/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	460	486	63,079	2039/2/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	3,100	3,262	423,312	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	3,090	3,249	421,633	2044/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	2,010	2,155	279,748	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,630	2,820	365,985	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	2,560	2,808	364,446	2040/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	570	659	85,578	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	2,200	2,522	327,336	2040/11/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,930	2,262	293,601	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,630	1,908	247,666	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,510	1,756	227,994	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,000	1,187	154,112	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	730	869	112,797	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,630	1,941	252,012	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,670	2,016	261,701	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	1,955	253,700	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	1,570	1,957	254,084	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	1,530	1,739	225,755	2028/11/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	1,010	1,202	156,072	2031/2/15
		6 T-BOND 260215	6.0	1,900	2,114	274,397	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	3,860	4,483	581,879	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	4,530	4,757	617,342	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	1,150	1,424	184,795	2030/5/15
小計						149,714,391	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 240401	0.25	3,850	3,678	367,583	2024/4/1
		0.25 CAN GOVT 260301	0.25	2,200	2,000	199,913	2026/3/1
		0.5 CAN GOVT 250901	0.5	800	743	74,253	2025/9/1
		0.5 CAN GOVT 301201	0.5	5,400	4,394	439,093	2030/12/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,930	1,767	176,624	2027/6/1
		1.25 CAN GOVT 250301	1.25	2,100	2,015	201,386	2025/3/1
		1.25 CAN GOVT 270301	1.25	2,500	2,324	232,278	2027/3/1
		1.25 CAN GOVT 300601	1.25	3,510	3,084	308,243	2030/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,110	3,076	307,404	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	1,945	194,438	2024/9/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,200	3,046	304,404	2026/6/1
		1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,900	2,560	255,869	2031/6/1
		1.5 CAN GOVT 311201	1.5	2,350	2,061	206,007	2031/12/1
		1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,100	1,586	158,528	2053/12/1
		2 CAN GOVT 230901	2.0	3,000	2,977	297,540	2023/9/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2 CAN GOVT 320601	2.0	800	730	72,982	2032/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	4,660	3,792	378,977	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	2,150	2,134	213,282	2024/3/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	3,100	3,054	305,268	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,210	2,120	211,933	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,700	2,688	268,624	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,580	1,515	151,471	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	753	75,258	2064/12/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,110	1,199	119,851	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	800	907	90,680	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	770	947	94,728	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,450	1,712	171,154	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,050	1,315	131,461	2033/6/1
小計						6,009,246	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	47,950	49,189	314,717	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	11,150	12,078	77,278	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	57,900	52,230	334,174	2026/3/5
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	40,250	38,166	244,190	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	39,350	36,558	233,905	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	11,200	10,177	65,114	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	23,890	20,908	133,776	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	28,430	28,103	179,810	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	12,000	11,791	75,442	2024/9/5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	29,900	26,652	170,525	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	35,050	34,480	220,612	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,700	24,632	157,600	2038/11/18
小計						2,207,147	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	5,680	5,542	757,041	2026/8/15
		0 BUND 271115	—	2,500	2,404	328,392	2027/11/15
		0 BUND 290815	—	990	931	127,243	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	2,120	1,982	270,719	2030/2/15
		0 BUND 300815	—	4,960	4,609	629,584	2030/8/15
		0 BUND 310815	—	5,200	4,758	649,885	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	1,950	1,768	241,519	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	4,580	3,958	540,667	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	670	571	78,016	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	3,750	2,730	372,904	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	440	322	44,008	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	1,550	1,095	149,613	2052/8/15
		0 OBL 241018	—	4,400	4,368	596,630	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	1,100	1,087	148,566	2025/4/11
		0 OBL 261009	—	2,900	2,822	385,497	2026/10/9
		0.25 BUND 270215	0.25	4,390	4,313	589,120	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	3,540	3,427	468,073	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	4,600	4,433	605,483	2029/2/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 250215	0.5	6,860	6,889	940,956	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	5,820	5,815	794,320	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	3,820	3,782	516,595	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,230	3,186	435,228	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	3,600	3,659	499,859	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	5,940	6,047	825,971	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	3,600	3,715	507,492	2048/8/15
		1.5 BUND 240515	1.5	4,460	4,576	625,121	2024/5/15
		2 BUND 230815	2.0	3,500	3,594	490,926	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	3,500	4,469	610,467	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,570	4,652	635,452	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,230	3,090	422,071	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	3,480	4,842	661,398	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	2,150	3,197	436,729	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,790	2,221	303,372	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	3,050	4,346	593,694	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,450	3,903	533,106	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	4,400	6,082	830,772	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,790	2,277	311,113	2028/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	3,550	4,971	678,953	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	2,250	2,911	397,652	2027/7/4
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240815	—	2,500	2,437	332,894	2024/8/15
		0 ITALY GOVT 260401	—	3,300	3,080	420,740	2026/4/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,700	1,518	207,408	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	3,060	2,980	407,074	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,700	1,491	203,669	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,450	2,346	320,468	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	2,000	1,797	245,457	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	3,100	2,543	347,450	2031/8/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	4,720	4,731	646,242	2023/10/15
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	2,310	2,200	300,562	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,830	2,409	329,134	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	900	757	103,456	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,100	1,746	238,576	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,660	1,251	170,914	2037/3/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,680	2,608	356,279	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	3,610	3,293	449,774	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,400	2,408	328,937	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	2,300	2,296	313,716	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,940	1,605	219,223	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,500	2,504	341,997	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	650	478	65,321	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	3,820	3,797	518,631	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	3,470	3,186	435,219	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	3,750	3,379	461,592	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	2,060	1,493	204,022	2051/9/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,990	1,613	220,319	2041/3/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,370	2,411	329,308	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,680	2,714	370,707	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	3,580	3,554	485,464	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,050	3,049	416,477	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	2,350	2,379	324,975	2026/7/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,500	2,525	344,925	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,840	1,680	229,476	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 231001	2.45	1,950	2,003	273,684	2023/10/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,470	2,362	322,606	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,990	1,713	233,985	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,830	3,950	539,550	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,330	2,399	327,677	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,260	2,104	287,425	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	2,880	2,968	405,380	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	2,380	2,127	290,558	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,780	1,754	239,566	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,800	2,900	396,156	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,640	1,638	223,785	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,149	293,543	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,830	1,899	259,487	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,740	1,829	249,853	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,750	4,017	548,766	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	3,230	3,424	467,734	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,640	1,833	250,357	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,460	3,862	527,526	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	3,950	4,117	562,300	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	5,920	6,311	862,091	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	3,440	3,807	520,050	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,090	3,539	483,439	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,520	3,174	433,541	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	4,050	4,460	609,175	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,700	3,284	448,632	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,550	3,200	437,100	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,690	3,401	464,617	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	3,610	4,317	589,688	2029/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,660	3,366	459,779	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,440	4,354	594,707	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,950	4,869	665,008	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,300	2,841	388,148	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,350	3,764	514,177	2023/11/1
フランス	国債証券	0 0.A.T 240225	—	2,000	1,994	272,405	2024/2/25
		0 0.A.T 240325	—	2,000	1,991	272,041	2024/3/25
		0 0.A.T 250225	—	3,200	3,150	430,325	2025/2/25
		0 0.A.T 250325	—	6,580	6,479	884,907	2025/3/25
		0 0.A.T 260225	—	4,600	4,474	611,136	2026/2/25
		0 0.A.T 270225	—	4,200	4,021	549,255	2027/2/25
		0 0.A.T 291125	—	4,730	4,313	589,113	2029/11/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	フランス	国債証券	0 O.A.T 301125	—	6,190	5,519	753,794	2030/11/25
			0 O.A.T 311125	—	5,500	4,790	654,221	2031/11/25
			0 O.A.T 320525	—	1,500	1,289	176,064	2032/5/25
			0.25 O.A.T 261125	0.25	4,750	4,621	631,187	2026/11/25
			0.5 O.A.T 250525	0.5	5,840	5,827	795,912	2025/5/25
			0.5 O.A.T 260525	0.5	5,300	5,241	715,863	2026/5/25
			0.5 O.A.T 290525	0.5	5,900	5,640	770,437	2029/5/25
			0.5 O.A.T 400525	0.5	2,630	2,089	285,325	2040/5/25
			0.5 O.A.T 440625	0.5	1,730	1,304	178,230	2044/6/25
			0.5 O.A.T 720525	0.5	1,100	591	80,734	2072/5/25
			0.75 O.A.T 280525	0.75	6,000	5,901	806,014	2028/5/25
			0.75 O.A.T 281125	0.75	5,960	5,835	796,990	2028/11/25
			0.75 O.A.T 520525	0.75	3,690	2,694	367,957	2052/5/25
			0.75 O.A.T 530525	0.75	1,740	1,246	170,251	2053/5/25
			1 O.A.T 251125	1.0	4,480	4,530	618,752	2025/11/25
			1 O.A.T 270525	1.0	4,550	4,568	623,999	2027/5/25
			1.25 O.A.T 340525	1.25	3,970	3,793	518,176	2034/5/25
			1.25 O.A.T 360525	1.25	5,000	4,698	641,751	2036/5/25
			1.5 O.A.T 310525	1.5	6,400	6,478	884,835	2031/5/25
			1.5 O.A.T 500525	1.5	3,890	3,545	484,277	2050/5/25
			1.75 O.A.T 241125	1.75	4,020	4,152	567,156	2024/11/25
			1.75 O.A.T 390625	1.75	3,750	3,761	513,683	2039/6/25
			1.75 O.A.T 660525	1.75	1,750	1,651	225,612	2066/5/25
			2 O.A.T 480525	2.0	3,430	3,505	478,848	2048/5/25
			2.25 O.A.T 240525	2.25	6,190	6,436	879,076	2024/5/25
			2.5 O.A.T 300525	2.5	6,850	7,512	1,026,095	2030/5/25
			2.75 O.A.T 271025	2.75	6,690	7,329	1,001,071	2027/10/25
			3.25 O.A.T 450525	3.25	3,610	4,536	619,571	2045/5/25
			3.5 O.A.T 260425	3.5	5,590	6,190	845,467	2026/4/25
			4 O.A.T 381025	4.0	3,190	4,215	575,773	2038/10/25
			4 O.A.T 550425	4.0	2,500	3,743	511,278	2055/4/25
			4 O.A.T 600425	4.0	1,840	2,849	389,125	2060/4/25
			4.5 O.A.T 410425	4.5	4,640	6,593	900,553	2041/4/25
			4.75 O.A.T 350425	4.75	3,970	5,404	738,144	2035/4/25
			5.5 O.A.T 290425	5.5	4,560	5,899	805,764	2029/4/25
			5.75 O.A.T 321025	5.75	4,760	6,717	917,533	2032/10/25
			6 O.A.T 251025	6.0	3,490	4,128	563,924	2025/10/25
	オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 240115	—	1,540	1,537	210,020	2024/1/15
			0 NETH GOVT 270115	—	1,350	1,302	177,936	2027/1/15
			0 NETH GOVT 290115	—	500	466	63,774	2029/1/15
			0 NETH GOVT 300715	—	2,650	2,420	330,587	2030/7/15
			0 NETH GOVT 380115	—	1,140	909	124,159	2038/1/15
			0 NETH GOVT 520115	—	1,300	884	120,788	2052/1/15
			0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,930	1,913	261,377	2025/7/15
			0.25 NETH GOVT 290715	0.25	2,300	2,175	297,151	2029/7/15
			0.5 NETH GOVT 260715	0.5	3,850	3,824	522,395	2026/7/15
			0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,170	1,002	136,879	2040/1/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,670	2,660	363,318	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,150	2,127	290,573	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	3,300	3,423	467,525	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	2,010	2,249	307,182	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,490	3,253	444,301	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,210	3,090	422,144	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	2,400	3,213	438,926	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,480	1,859	253,905	2028/1/15
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	10,600	10,487	1,432,380	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	2,930	2,870	392,033	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,800	2,722	371,787	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	4,300	4,133	564,560	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	2,800	2,637	360,162	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,800	2,584	352,963	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,660	2,270	310,101	2031/4/30
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	9,720	9,756	1,332,585	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	2,230	2,033	277,760	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	3,900	3,410	465,817	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	1,300	1,207	164,933	2029/10/31
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,500	2,435	332,575	2027/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	250	201	27,531	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	2,380	1,655	226,115	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,330	1,906	260,359	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,230	3,096	422,966	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,250	1,259	172,002	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,540	2,537	346,603	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	3,000	2,991	408,583	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,330	2,342	319,960	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	2,960	2,939	401,499	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	620	400	54,658	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,000	3,032	414,198	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	510	521	71,250	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	2,500	2,385	325,819	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	800	678	92,623	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	4,570	4,723	645,130	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,590	2,633	359,695	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,180	3,313	452,605	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,610	2,677	365,706	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,920	2,003	273,698	2048/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,310	2,508	342,625	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,800	2,082	284,452	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	6,210	6,612	903,076	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,950	3,679	502,522	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,300	3,503	478,543	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,310	2,583	352,908	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,620	3,574	488,253	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	7,790	8,392	1,146,271	2024/1/31

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,810	3,896	532,123	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	3,200	3,923	535,847	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,230	3,299	450,641	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	3,790	5,118	699,113	2032/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,700	2,192	299,416	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 311022	—	1,700	1,478	201,941	2031/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,500	1,362	186,114	2030/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	800	611	83,562	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,740	1,745	238,345	2024/10/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	740	417	57,080	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,170	2,186	298,623	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,930	1,919	262,133	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,750	1,726	235,845	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,280	2,238	305,710	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	2,240	2,264	309,303	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,800	1,738	237,386	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,580	1,539	210,291	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	570	483	66,012	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	720	680	92,946	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,370	1,261	172,270	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,300	1,212	165,548	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,110	1,114	152,242	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	810	831	113,532	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	780	821	112,265	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,980	3,127	427,182	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	930	1,064	145,337	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,050	1,390	189,855	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,140	1,402	191,502	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,200	2,981	407,268	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,790	2,055	280,772	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,540	3,484	475,977	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,760	3,483	475,732	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,450	1,310	179,042	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,350	1,195	163,341	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	550	400	54,701	2040/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,400	1,375	187,828	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,310	1,252	171,058	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,940	1,929	263,566	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,510	1,488	203,236	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	780	619	84,553	2051/3/20
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	620	586	80,054	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,710	1,737	237,273	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	990	968	132,233	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	460	395	54,039	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	4,030	4,158	567,938	2024/10/21
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	1,040	1,084	148,065	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,760	1,929	263,534	2034/5/23

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	840	1,086	148,430	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	560	889	121,485	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,870	2,505	342,147	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,370	1,591	217,343	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,240	1,579	215,708	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	850	843	115,189	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	750	672	91,883	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	270	239	32,724	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	510	416	56,850	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	360	235	32,135	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	500	389	53,173	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	1,670	1,655	226,040	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	700	684	93,503	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	580	559	76,350	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	720	685	93,635	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	330	262	35,839	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	820	780	106,548	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	630	635	86,805	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	630	600	82,069	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	540	522	71,336	2047/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	420	434	59,383	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	680	794	108,580	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	730	806	110,123	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	640	709	96,962	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	350	301	41,222	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	620	559	76,387	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	400	350	47,848	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	700	588	80,381	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	150	117	16,081	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,860	1,836	250,818	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,040	1,050	143,428	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,400	1,388	189,576	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	604	82,532	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,070	1,063	145,260	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	780	697	95,274	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,180	1,162	158,744	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,220	1,240	169,378	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,640	1,776	242,581	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	820	867	118,542	2024/3/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,249	170,672	2025/3/13
小計						107,853,054	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	2,500	2,447	388,997	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,100	1,049	166,740	2026/1/30
		0.25 GILT 250131	0.25	3,600	3,486	554,129	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	2,660	2,305	366,442	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	800	760	120,913	2026/10/22

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	0.375 GILT 301022	0.375	1,690	1,512	240,348	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	1,250	1,156	183,856	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	1,020	614	97,695	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	1,380	1,350	214,595	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	2,440	2,032	322,984	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,240	857	136,293	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	2,060	1,946	309,430	2029/10/22
		0.875 GILT 460131	0.875	970	744	118,314	2046/1/31
		1 GILT 240422	1.0	1,700	1,690	268,604	2024/4/22
		1 GILT 320131	1.0	500	461	73,306	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	1,610	1,383	219,958	2039/1/31
		1.125 GILT 731022	1.125	450	343	54,628	2073/10/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,770	1,750	278,143	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	2,630	2,259	359,049	2041/10/22
		1.25 GILT 510731	1.25	1,260	1,029	163,571	2051/7/31
		1.5 GILT 260722	1.5	3,490	3,499	556,246	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,840	1,615	256,824	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	1,540	1,547	245,939	2028/10/22
		1.625 GILT 541022	1.625	1,530	1,378	219,027	2054/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,530	1,407	223,639	2071/10/22
		1.75 GILT 370907	1.75	2,210	2,103	334,260	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,180	1,093	173,841	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	2,130	1,987	315,819	2057/7/22
		2 GILT 250907	2.0	1,760	1,795	285,294	2025/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	2,060	2,397	381,013	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,900	1,960	311,536	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,810	2,155	342,650	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,700	3,354	533,144	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,700	2,507	398,516	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	1,930	2,649	421,147	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	1,700	2,603	413,809	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	2,320	2,654	421,897	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,750	3,353	532,956	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,750	2,207	350,773	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,450	1,898	301,728	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,590	2,104	334,396	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	2,350	3,294	523,578	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,510	2,181	346,719	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,730	2,656	422,186	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,630	2,073	329,526	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,250	3,134	498,193	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	2,330	2,894	460,016	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,730	2,374	377,375	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,070	2,273	361,331	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,540	1,963	312,016	2028/12/7
小計						15,623,414	

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
スウェーデン			%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	7,850	6,727	86,719	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	6,900	6,488	83,634	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,300	5,814	74,954	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	10,460	10,129	130,571	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	9,940	9,975	128,589	2023/11/13
		2.25 SWD GOVT 320601	2.25	4,350	4,499	58,000	2032/6/1
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,260	8,473	109,227	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,470	6,638	85,568	2039/3/30
小計						757,265	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,500	3,032	40,421	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	7,570	6,742	89,881	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,860	4,656	62,065	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	8,950	8,744	116,560	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,170	3,986	53,144	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	4,200	3,895	51,931	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,920	5,930	79,056	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	6,200	5,932	79,084	2028/4/26
		2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	3,000	2,797	37,286	2032/5/18
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	8,300	8,400	111,984	2024/3/14
小計						721,417	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	2,300	2,270	41,683	2024/11/15
		0 DMK GOVT 311115	—	7,500	6,601	121,195	2031/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,400	3,849	70,685	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	9,050	8,790	161,396	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,550	10,028	184,125	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,250	3,319	60,950	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,490	7,745	142,214	2025/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	13,740	20,147	369,916	2039/11/15
小計						1,152,167	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	3,000	2,234	65,266	2026/10/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	4,090	2,664	77,845	2030/10/25
		1.75 POLAND 320425	1.75	1,000	637	18,618	2032/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,590	104,870	2024/10/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,405	70,281	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	6,540	5,460	159,504	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	5,190	4,164	121,659	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	4,760	3,777	110,349	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	3,400	2,587	75,582	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	7,300	6,521	190,493	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	4,300	4,154	121,365	2023/10/25
		5.75 POLAND 290425	5.75	3,450	3,238	94,608	2029/4/25
小計						1,210,444	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	900	843	75,962	2024/11/21

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					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	
	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	3,450	3,129	281,868	2025/11/21
		1 AUST GOVT 301221	1.0	1,110	908	81,805	2030/12/21
		1 AUST GOVT 311121	1.0	3,610	2,886	259,973	2031/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,500	2,027	182,578	2032/5/21
		1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,590	2,193	197,510	2031/6/21
		1.75 AUST GOVT 321121	1.75	2,780	2,349	211,595	2032/11/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,990	1,264	113,912	2051/6/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,250	1,180	106,282	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,940	3,688	332,186	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,090	2,039	183,676	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,630	1,576	141,945	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,210	2,117	190,691	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	960	871	78,517	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,020	872	78,546	2041/5/21
		3 AUST GOVT 331121	3.0	1,900	1,801	162,215	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,360	1,173	105,681	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	5,260	5,304	477,736	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,260	2,246	202,334	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	2,040	1,905	171,574	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,300	1,307	117,723	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,320	3,463	311,910	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,210	2,404	216,581	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,050	2,197	197,935	2027/4/21
小計						4,480,744	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	1.25	700	660	61,692	2026/11/1
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	450	407	38,091	2031/7/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	700	577	53,944	2050/3/1
		1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	950	782	73,077	2051/10/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,530	1,505	140,630	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	830	764	71,453	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	600	599	55,984	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	380	349	32,691	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	800	798	74,541	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,000	1,008	94,185	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	790	769	71,838	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	920	927	86,667	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	1,140	1,146	107,126	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	1,500	1,522	142,174	2024/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	780	819	76,502	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	760	789	73,792	2027/3/1
小計						1,254,396	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,800	1,536	45,498	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	1,400	1,357	40,183	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,100	2,029	60,075	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	1,880	1,602	47,425	2040/5/22

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	
	国債証券	3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	1,950	1,971	58,370	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	2,300	2,076	61,472	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,400	1,290	38,201	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,002	29,674	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,000	1,917	56,755	2029/8/15
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	1,500	1,480	43,830	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,080	31,980	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	2,500	2,477	73,350	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,400	1,390	41,152	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,920	3,922	116,115	2025/9/15
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	600	503	14,892	2050/6/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	4,100	4,134	122,381	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	3,050	2,953	87,418	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	2,150	2,011	59,557	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	906	26,820	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	2,240	2,225	65,878	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,182	35,005	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,650	1,557	46,111	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,340	3,305	97,849	2037/4/7
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	950	937	27,749	2038/6/8
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	2,020	1,934	57,271	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	2,200	2,162	64,012	2043/9/30
小計						1,449,034	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	20,000	19,742	381,107	2025/4/9
		2.36 CHINA GOVT 230702	2.36	11,000	11,022	212,770	2023/7/2
		2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	11,000	10,903	210,472	2027/1/20
		2.56 CHINA GOVT 231021	2.56	9,000	9,045	174,604	2023/10/21
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	6,000	5,913	114,151	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	1,000	1,004	19,394	2026/8/12
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	3,000	2,981	57,552	2032/2/17
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	6,000	5,992	115,681	2029/3/24
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	6,000	6,056	116,904	2027/6/4
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	5,017	96,857	2031/11/18
		2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	6,000	6,072	117,212	2026/5/5
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	6,000	6,040	116,599	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	6,000	6,085	117,462	2024/10/17
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	6,000	6,088	117,534	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	12,000	12,197	235,462	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	5,000	5,056	97,604	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	8,000	8,140	157,138	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	10,000	10,223	197,356	2026/12/5
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	7,000	7,141	137,855	2029/11/21
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	8,000	8,246	159,176	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	13,000	13,432	259,299	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	7,000	7,223	139,431	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	4,000	4,139	79,913	2029/5/23

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
中国			%	千中国元	千中国元	千円	
	国債証券	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	4,000	3,999	77,213	2050/3/16
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	3,000	3,108	59,999	2051/10/18
		3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,208	81,234	2028/8/16
		3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	10,000	10,279	198,436	2024/6/22
		3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	10,000	10,371	200,214	2025/6/7
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	4,000	4,258	82,199	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	11,000	11,452	221,065	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	8,000	8,643	166,840	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	5,000	5,438	104,973	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 230822	4.08	8,000	8,231	158,890	2023/8/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	5,000	5,629	108,674	2048/10/22
小計						4,891,287	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	4,000	3,846	144,712	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	2,800	2,515	94,635	2030/3/31
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	2,400	2,008	75,545	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	4,180	4,251	159,944	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	6,250	6,525	245,487	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	2,800	3,049	114,708	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	2,580	3,529	132,775	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,240	159,521	2026/10/30
小計						1,127,330	
合計						298,451,346	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2022年５月12日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	298,451,346	98.3
コール・ローン等、その他	5,095,613	1.7
投資信託財産総額	303,546,959	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（301,284,927千円）の投資信託財産総額（303,546,959千円）に対する比率は99.3%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル＝129.77円	1カナダドル＝99.93円	1メキシコペソ＝6.3981円	1ユーロ＝136.58円
1イギリスポンド＝158.93円	1スウェーデンクローネ＝12.89円	1ノルウェークローネ＝13.33円	1デンマーククローネ＝18.36円
1ポーランドズロチ＝29.2119円	1オーストラリアドル＝90.06円	1シンガポールドル＝93.41円	1マレーシアリンギット＝29.6027円
1中国元＝19.3035円	1イスラエルシェケル＝37.6208円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	305,505,041,966
コール・ローン等	3,005,298,531
公社債(評価額)	298,451,346,094
未収入金	1,958,317,583
未収利息	1,806,370,005
前払費用	283,709,753
(B) 負債	3,279,311,511
未払金	2,881,020,926
未払解約金	398,290,399
未払利息	186
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	302,225,730,455
元本	130,645,783,749
次期繰越損益金	171,579,946,706
(D) 受益権総口数	130,645,783,749口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	23,133円

＜注記事項＞

①期首元本額　87,094,050,705円
　期中追加設定元本額　62,049,820,231円
　期中一部解約元本額　18,498,087,187円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3133円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	5,434,823,246
受取利息	5,445,029,486
その他収益金	106,450
支払利息	△ 10,312,690
(B) 有価証券売買損益	△ 490,790,063
売買益	32,917,498,261
売買損	△ 33,408,288,324
(C) 保管費用等	△ 29,768,214
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	4,914,264,969
(E) 前期繰越損益金	110,053,119,636
(F) 追加信託差損益金	80,630,436,092
(G) 解約差損益金	△ 24,017,873,991
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	171,579,946,706
次期繰越損益金(Ｈ)	171,579,946,706

(注) (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) (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) (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。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	27,954,564,399円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	19,777,119,306円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	12,350,285,889円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	7,771,715,295円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	5,455,901,996円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	4,491,532,555円
海外債券セレクション（ラップ向け）	4,028,989,668円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	3,760,553,557円
ＭＵＡＭ 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	3,602,811,119円
つみたて８資産均等バランス	3,530,516,423円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,874,004,026円
ＭＵＫＡＭ 外国債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,725,615,669円
ラップ向けインデックスｆ 先進国債券	2,582,125,247円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,138,276,166円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,080,670,356円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,929,426,106円
外国債券インデックスファンドｉ（適格機関投資家限定）	1,874,028,558円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	1,867,689,160円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	1,762,069,735円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,667,434,944円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,495,305,690円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,345,337,739円
ワールド・インカムオープン	1,136,974,765円
つみたて４資産均等バランス	1,081,421,163円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	968,492,808円

三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	774,860,477円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式65）	613,884,567円
ファンド・マネジャー（海外債券）	601,253,761円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	575,998,695円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	556,737,085円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	549,854,318円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	549,408,221円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式40）	545,792,953円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	538,904,214円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	524,363,536円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	434,344,879円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	433,656,887円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	426,323,708円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式15）	383,757,287円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	322,378,121円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	271,791,147円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	229,513,465円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	201,912,456円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	199,118,592円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	183,572,650円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	163,349,284円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	131,120,449円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	114,385,679円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	114,207,191円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	112,162,220円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）	109,591,461円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	105,468,579円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	98,736,927円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	93,113,760円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	70,758,398円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	59,517,350円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	49,872,436円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	40,289,876円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	26,443,302円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	25,537,290円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	24,547,591円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,004,297円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	19,346,496円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	15,550,213円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	15,373,571円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ２（適格機関投資家限定）	14,845,502円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	11,048,572円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	8,181,139円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	7,195,846円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	6,313,305円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	3,875,165円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,464,137円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	2,026,397円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,698,181円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	1,467,097円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	1,280,305円
コアバランス	1,278,760円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）	966,234円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	883,282円

三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	839,583円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	646,145円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	99,608円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,763円
合計	130,645,783,749円

［お知らせ］

①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2021年９月30日）

②「ＦＴＳＥ世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

新興国債券インデックスマザーファンド

《第13期》決算日2023年１月26日

［計算期間：2022年１月27日～2023年１月26日］

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、１月26日に第13期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率	(円換算ベース)	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
９期(2019年１月28日)	13,254	△8.4	31,268.09	△8.1	96.7	－	20,421
10期(2020年１月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	－	30,520
11期(2021年１月26日)	13,819	△4.2	32,923.96	△3.7	97.6	－	37,779
12期(2022年１月26日)	14,025	1.5	33,419.11	1.5	97.5	－	51,888
13期(2023年１月26日)	14,770	5.3	35,262.54	5.5	97.1	－	64,755

(注) ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2022年１月26日	14,025	－	33,419.11	－	97.5	－
１月末	14,115	0.6	33,673.33	0.8	96.8	－
２月末	13,987	△0.3	33,817.05	1.2	97.2	－
３月末	14,101	0.5	33,782.76	1.1	96.6	－
４月末	14,028	0.0	33,306.37	△0.3	96.2	－
５月末	14,165	1.0	33,884.38	1.4	96.1	－
６月末	14,427	2.9	34,445.36	3.1	95.2	－
７月末	14,128	0.7	33,692.82	0.8	96.8	－
８月末	14,635	4.3	34,986.65	4.7	96.9	－
９月末	14,480	3.2	34,492.18	3.2	96.5	－
10月末	14,802	5.5	35,377.33	5.9	96.4	－
11月末	14,764	5.3	35,263.58	5.5	97.0	－
12月末	14,394	2.6	34,477.89	3.2	95.4	－
(期末)						
2023年１月26日	14,770	5.3	35,262.54	5.5	97.1	－

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

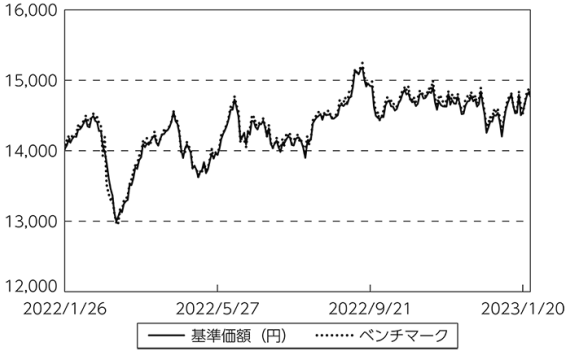
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ5.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(5.5%)を0.2%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因
(上昇要因)
　ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について
◎債券市況
　新興国の現地通貨建て債券市況は下落しました。
　新興国の現地通貨建て債券市況は、期間の初めにロシアのウクライナ侵攻及び各国の経済制裁によるロシア国債の値下がりなどを受けて下落した後、もみ合いで推移しました。その後、欧米中央銀行による利上げペースの減速期待などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことで上昇しましたが、期間の初めとの比較では下落しました。

◎為替市況
　期間の初めに比べてエジプトポンドやトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは5.5%の上昇になったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
(主なプラス要因)
・ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)
・取引要因によるものです。

〇今後の運用方針
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2022年１月27日～2023年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	14	0.096	(a)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）	(11)	(0.080)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(2)	(0.017)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	14	0.096	
期中の平均基準価額は、14,347円です。			

（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2022年１月27日～2023年１月26日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 228,198	千メキシコペソ 144,172
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 141,219	千ブラジルレアル 114,510
	チリ	国債証券	千チリペソ 2,200,954	千チリペソ 946,341
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 25,657,121	千コロンビアペソ 1,598,100
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 7,523	千ペルーヌエボソル －
	ドミニカ	国債証券	千ドミニカペソ －	千ドミニカペソ 7,925
	セルビア	国債証券	千セルビアディナール 38,435	千セルビアディナール －
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 16,408	千トルコリラ 31,417
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 296,999	千チェココルナ 143,781
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 1,547,732	千ハンガリーフォリント 275,367
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 45,879	千ポーランドズロチ 18,605
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 73,525	千ロシアルーブル 65,322
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニアレイ 24,382	千ルーマニアレイ 8,579
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 62,750	千マレーシアリンギット 14,127
	タイ	国債証券	千タイバーツ 489,420	千タイバーツ 164,317
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 208,695,980	千インドネシアルピア 96,890,425
	中国	国債証券	千中国元 96,232	千中国元 55,855
	エジプト	国債証券	千エジプトポンド 148,874	千エジプトポンド －
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 381,491	千南アフリカランド 176,063

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2022年１月27日～2023年１月26日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	774	187	24.2	755	328	43.4
為替直物取引	22,409	8,104	36.2	12,777	4,606	36.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱ＵＦＪ銀行、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2023年１月26日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	956,300	909,660	6,255,462	9.7	－	4.8	2.9	2.0
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	292,270	248,628	6,326,402	9.8	9.8	1.4	3.5	4.8
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	9,125,000	9,041,994	1,455,571	2.2	－	1.4	0.8	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	109,090,000	85,159,228	2,425,930	3.7	－	2.3	1.1	0.3
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	45,200	40,854	1,356,483	2.1	－	1.7	0.3	0.1
	千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ						
ウルグアイ	24,000	21,907	72,436	0.1	－	0.1	－	－
	千ドミニカペソ	千ドミニカペソ						
ドミニカ	16,000	15,496	35,330	0.1	0.1	－	0.1	－
	千セルビアディナール	千セルビアディナール						
セルビア	170,000	156,622	188,196	0.3	0.3	0.2	0.1	－
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	71,900	79,248	544,651	0.8	0.8	0.2	0.5	0.1
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	669,700	590,150	3,502,186	5.4	－	2.6	1.8	1.0
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	7,175,000	5,568,772	2,033,331	3.1	－	1.4	1.3	0.5
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	174,450	151,273	4,526,255	7.0	－	2.2	3.3	1.5
	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ						
ルーマニア	78,560	70,950	2,044,639	3.2	－	1.2	1.2	0.8
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	209,130	210,101	6,379,048	9.9	－	5.4	2.9	1.5
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	1,655,200	1,666,426	6,582,385	10.2	－	5.9	2.3	2.0
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	20,000	18,445	43,625	0.1	－	0.1	－	－
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	707,480,000	738,503,700	6,424,982	9.9	－	6.8	2.3	0.9
	千中国元	千中国元						
中国	321,200	325,313	6,185,552	9.6	－	4.5	3.7	1.3

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
	千エジプトポンド	千エジプトポンド	千円	%	%	%	%	%
エジプト	146,000	122,133	527,799	0.8	0.8	0.1	0.5	0.2
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	921,500	791,422	5,975,239	9.2	9.2	8.0	1.2	－
合計	－	－	62,885,512	97.1	21.0	50.4	29.8	16.9

（注）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）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）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)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	73,700	74,082	509,441	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	20,200	22,495	154,694	2036/11/20
		5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	49,000	44,555	306,392	2025/3/6
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	39,700	35,060	241,101	2027/3/4
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	118,200	107,496	739,220	2026/3/5
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	93,200	88,955	611,721	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	119,800	113,963	783,691	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	22,400	21,014	144,510	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	72,600	65,996	453,836	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	11,300	11,046	75,963	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	103,000	99,627	685,108	2024/9/5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	69,400	64,315	442,280	2047/11/7
		8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	22,400	20,785	142,934	2053/7/31
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	79,000	78,654	540,885	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	62,400	61,610	423,677	2038/11/18
小計						6,255,462	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	36,270	33,676	856,900	2027/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	29,100	28,047	713,684	2025/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	10.0	12,100	10,526	267,847	2031/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 330101	10.0	4,600	3,890	98,984	2033/1/1
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	24,700	22,115	562,720	2029/1/1
		BRAZIL-LTN 240101	—	71,400	63,557	1,617,223	2024/1/1
		BRAZIL-LTN 240701	—	37,200	31,241	794,946	2024/7/1
		BRAZIL-LTN 250701	—	30,500	22,900	582,700	2025/7/1
		BRAZIL-LTN 260101	—	46,400	32,674	831,396	2026/1/1
小計						6,326,402	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	2.3 BONOS TESORER 281001	2.3	480,000	413,160	66,510	2028/10/1
		2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,940,000	1,812,445	291,765	2025/3/1
		4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,420,000	1,397,635	224,989	2026/3/1
		4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,520,000	1,489,676	239,806	2030/9/1
		5 BONOS TESORERIA 281001	5.0	660,000	660,113	106,264	2028/10/1
		5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,440,000	1,430,740	230,319	2035/3/1
		6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	1,315,000	1,432,758	230,643	2043/1/1
		7 BONOS TESORERIA 340501	7.0	350,000	405,465	65,271	2034/5/1
小計						1,455,571	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	7,700,000	7,523,936	214,334	2024/7/24
		5.75 TITULOS DE T 271103	5.75	5,900,000	4,624,304	131,732	2027/11/3
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	11,980,000	9,301,441	264,970	2028/4/28
		6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	7,690,000	6,693,596	190,680	2025/11/26
		6.25 TITULOS DE T 360709	6.25	5,500,000	3,419,517	97,411	2036/7/9
		7 TITULOS DE TESO 310326	7.0	9,900,000	7,396,611	210,707	2031/3/26

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
	国債証券	7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	11,700,000	8,475,600	241,444	2032/6/30
		7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	10,000,000	6,962,632	198,344	2034/10/18
		7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	6,800,000	4,167,924	118,731	2050/10/26
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	13,770,000	12,058,653	343,514	2026/8/26
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	9,460,000	7,498,829	213,619	2030/9/18
		9.25 TITULOS DE T 420528	9.25	7,400,000	5,859,996	166,933	2042/5/28
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,176,183	33,505	2027/6/28
小計						2,425,930	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.35 PERU 400812	5.35	3,250	2,404	79,839	2040/8/12
		5.4 PERU 340812	5.4	4,400	3,518	116,819	2034/8/12
		5.7 PERU 240812	5.7	2,050	2,007	66,646	2024/8/12
		5.94 PERU 290212	5.94	6,600	6,012	199,640	2029/2/12
		6.15 PERU 320812	6.15	7,400	6,477	215,083	2032/8/12
		6.35 PERU 280812	6.35	5,800	5,453	181,059	2028/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	5,400	4,824	160,184	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	5,300	4,974	165,153	2031/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	5,000	5,181	172,056	2026/8/12
小計						1,356,483	
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
	国債証券	8.25 URUGUAY 310521	8.25	17,000	15,327	50,680	2031/5/21
		8.5 URUGUAY(GL) 280315	8.5	7,000	6,580	21,756	2028/3/15
小計						72,436	
ドミニカ				千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
	国債証券	9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	15,496	35,330	2026/6/5
小計						35,330	
セルビア				千セルビアディナール	千セルビアディナール		
	国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	4.5	61,000	58,420	70,197	2026/1/11
		4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	59,000	49,215	59,136	2032/8/20
		5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	50,000	48,987	58,862	2028/2/8
小計						188,196	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	7,400	7,692	52,866	2027/8/11
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	10,008	68,781	2026/2/11
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	4,824	33,153	2027/2/24
		11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	14,100	18,012	123,796	2030/11/13
		12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	4,100	4,969	34,151	2028/3/8
		12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	16,600	18,272	125,581	2025/10/1
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	7,300	7,219	49,618	2025/3/12
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	8,300	8,250	56,701	2024/7/24
小計						544,651	
チェコ				千チェココルナ	千チェココルナ		
	国債証券	0.05 CZECH REPUBL 291129	0.05	58,000	43,015	255,268	2029/11/29
		0.25 CZECH REPUBL 270210	0.25	143,500	120,186	713,232	2027/2/10
		0.45 CZECH REPUBL 231025	0.45	34,500	33,002	195,850	2023/10/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
チェコ			%	千チェココルナ	千チェココルナ	千円	
	国債証券	1.5 CZECH REPUBLI 400424	1.5	15,500	9,993	59,306	2040/4/24
		1.75 CZECH REPUBL 320623	1.75	121,200	97,081	576,118	2032/6/23
		3.5 CZECH REPUBLI 350530	3.5	83,500	76,861	456,128	2035/5/30
		5 CZECH REPUBLIC 300930	5.0	19,000	19,674	116,756	2030/9/30
		5.5 CZECH REPUBLI 281212	5.5	37,000	38,794	230,222	2028/12/12
		6 CZECH REPUBLIC 260226	6.0	71,500	73,672	437,200	2026/2/26
		CZECH REPUBLIC 241212	－	86,000	77,868	462,104	2024/12/12
小計						3,502,186	
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
	国債証券	1 HUNGARY 251126	1.0	327,000	257,705	94,096	2025/11/26
		1.5 HUNGARY 260422	1.5	760,000	597,778	218,267	2026/4/22
		1.5 HUNGARY 260826	1.5	360,000	276,480	100,951	2026/8/26
		2 HUNGARY 290523	2.0	430,000	311,707	113,813	2029/5/23
		2.25 HUNGARY 330420	2.25	540,000	348,975	127,421	2033/4/20
		2.25 HUNGARY 340622	2.25	150,000	92,775	33,875	2034/6/22
		2.5 HUNGARY 241024	2.5	390,000	334,893	122,279	2024/10/24
		2.75 HUNGARY 261222	2.75	373,000	296,612	108,302	2026/12/22
		3 HUNGARY 240626	3.0	359,000	319,163	116,536	2024/6/26
		3 HUNGARY 271027	3.0	521,000	410,600	149,922	2027/10/27
		3 HUNGARY 300821	3.0	498,000	375,994	137,287	2030/8/21
		3 HUNGARY 381027	3.0	292,000	177,054	64,647	2038/10/27
		3 HUNGARY 410425	3.0	240,000	140,172	51,181	2041/4/25
		3.25 HUNGARY 311022	3.25	618,000	456,207	166,575	2031/10/22
		4.5 HUNGARY 280323	4.5	250,000	211,975	77,398	2028/3/23
		4.75 HUNGARY 321124	4.75	150,000	122,562	44,751	2032/11/24
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	492,000	437,691	159,814	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	243,000	229,114	83,656	2023/11/24
		6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	171,310	62,550	2028/10/22
小計						2,033,331	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	14,200	11,565	346,051	2026/10/25
		0.75 POLAND 250425	0.75	12,500	11,205	335,284	2025/4/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	13,900	9,998	299,163	2030/10/25
		1.75 POLAND 320425	1.75	13,600	9,667	289,264	2032/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	13,500	12,693	379,814	2024/10/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	10,100	9,693	290,027	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	15,500	13,852	414,475	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	9,500	284,279	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	13,250	11,421	341,756	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	19,200	16,010	479,048	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	14,500	13,609	407,199	2025/7/25
		3.75 POLAND 270525	3.75	13,800	12,678	379,353	2027/5/25
		4 POLAND 231025	4.0	9,500	9,375	280,535	2023/10/25
小計						4,526,255	

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ルーマニア			%	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ	千円	
	国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 271025	2.5	3,000	2,441	70,371	2027/10/25
		3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,223	121,710	2024/4/29
		3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	2,829	81,540	2026/6/24
		3.65 ROMANIA GOVE 250728	3.65	4,000	3,709	106,893	2025/7/28
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	5,500	4,271	123,083	2031/9/24
		3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	4,600	4,367	125,861	2024/11/25
		4.15 ROMANIA GOVE 280126	4.15	5,200	4,534	130,687	2028/1/26
		4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	5,000	4,096	118,047	2030/10/24
		4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	9,200	8,939	257,615	2024/6/17
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,611	190,516	2025/2/24
		4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	4,200	3,358	96,770	2034/10/11
		4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,570	131,714	2026/4/22
		4.85 ROMANIA GOVE 290725	4.85	3,700	3,220	92,804	2029/7/25
		5 ROMANIA GOVERNM 290212	5.0	3,960	3,513	101,242	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	6,800	6,422	185,078	2027/7/26
		6.7 ROMANIA GOVER 320225	6.7	4,000	3,841	110,698	2032/2/25
小計						2,044,639	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	13,800	12,744	386,956	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	14,600	14,612	443,661	2027/5/31
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	8,700	8,591	260,840	2032/7/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	8,850	8,920	270,829	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	13,700	13,055	396,384	2040/5/22
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	4,700	4,722	143,383	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	11,570	11,479	348,525	2034/7/5
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,200	1,213	36,850	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	14,450	14,609	443,560	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,500	11,705	355,410	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	12,720	12,915	392,130	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,200	1,220	37,057	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	20,500	20,799	631,516	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	14,400	14,604	443,421	2024/9/30
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	9,100	8,736	265,245	2050/6/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	12,450	12,636	383,650	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	9,550	9,852	299,123	2035/5/31
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	12,800	13,247	402,222	2028/10/31
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	4,340	4,653	141,292	2042/10/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	9,000	9,781	296,983	2037/4/7
小計						6,379,048	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	0.75 THAILAND 240617	0.75	88,800	87,861	347,053	2024/6/17
		0.75 THAILAND 240917	0.75	91,300	90,095	355,877	2024/9/17
		0.95 THAILAND 250617	0.95	91,400	89,888	355,060	2025/6/17
		1 THAILAND 270617	1.0	108,700	104,582	413,102	2027/6/17
		1.45 THAILAND 241217	1.45	87,600	87,286	344,780	2024/12/17

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
タイ			%	千タイバーツ	千タイバーツ	千円	
	国債証券	1.585 THAILAND 351217	1.585	80,900	71,135	280,984	2035/12/17
		1.6 THAILAND 291217	1.6	74,500	71,803	283,624	2029/12/17
		1.6 THAILAND 350617	1.6	38,200	33,967	134,173	2035/6/17
		2 THAILAND 311217	2.0	127,100	123,481	487,751	2031/12/17
		2 THAILAND 420617	2.0	53,500	45,713	180,567	2042/6/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	87,300	88,256	348,614	2026/12/17
		2.35 THAILAND 260617	2.35	5,000	5,093	20,118	2026/6/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	58,900	59,546	235,207	2023/12/17
		2.65 THAILAND 280617	2.65	30,700	31,748	125,406	2028/6/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	84,400	88,276	348,692	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	64,200	61,017	241,019	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	96,000	100,724	397,863	2038/6/17
		3.39 THAILAND 370617	3.39	2,000	2,138	8,447	2037/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	68,000	72,603	286,784	2036/6/17
		3.65 THAILAND 310620	3.65	70,100	77,081	304,472	2031/6/20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	88,600	98,620	389,551	2032/6/25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	81,700	86,523	341,768	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	76,300	88,977	351,461	2029/6/22
小計						6,582,385	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	20,000	18,445	43,625	2036/1/14
小計						43,625	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	8,635,560	75,129	2030/8/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	5,250,000	5,853,619	50,926	2025/9/15
		5.125 INDONESIA 270415	5.125	28,800,000	27,755,712	241,474	2027/4/15
		5.5 INDONESIA 260415	5.5	29,900,000	29,373,760	255,551	2026/4/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	29,000,000	28,499,750	247,947	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 360615	6.25	6,000,000	5,685,000	49,459	2036/6/15
		6.375 INDONESIA 280815	6.375	5,000,000	5,011,300	43,598	2028/8/15
		6.375 INDONESIA 320415	6.375	37,600,000	37,035,248	322,206	2032/4/15
		6.375 INDONESIA 370715	6.375	4,000,000	3,858,780	33,571	2037/7/15
		6.5 INDONESIA 250615	6.5	41,900,000	42,302,240	368,029	2025/6/15
		6.5 INDONESIA 310215	6.5	35,900,000	35,505,100	308,894	2031/2/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	20,400,000	20,285,760	176,486	2033/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	23,450,000	24,098,861	209,660	2027/5/15
		7 INDONESIA 300915	7.0	46,700,000	47,563,950	413,806	2030/9/15
		7 INDONESIA 330215	7.0	8,600,000	8,844,928	76,950	2033/2/15
		7.125 INDONESIA 420615	7.125	24,600,000	25,060,020	218,022	2042/6/15
		7.125 INDONESIA 430615	7.125	4,000,000	4,120,240	35,846	2043/6/15
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	5,400,000	5,700,780	49,596	2032/8/15
		7.5 INDONESIA 350615	7.5	32,300,000	34,233,155	297,828	2035/6/15
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	23,200,000	24,360,000	211,932	2038/5/15
		7.5 INDONESIA 400415	7.5	11,300,000	11,903,420	103,559	2040/4/15
		8.125 INDONESIA 240515	8.125	27,600,000	28,383,840	246,939	2024/5/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア			%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
	国債証券	8.25 INDONESIA 290515	8.25	24,500,000	26,558,000	231,054	2029/5/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	19,000,000	20,930,563	182,095	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	29,200,000	32,704,000	284,524	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	35,600,000	36,632,400	318,701	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	35,930,000	38,427,135	334,316	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	35,700,000	39,998,280	347,985	2034/3/15
		8.375 INDONESIA 390415	8.375	23,200,000	26,403,920	229,714	2039/4/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,400,000	17,428,180	151,625	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	18,800,000	21,116,160	183,710	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	12,200,000	14,234,037	123,836	2031/7/15
小計						6,424,982	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	14,000	13,868	263,704	2025/4/9
		2.18 CHINA GOVT 250825	2.18	3,000	2,978	56,630	2025/8/25
		2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	3,000	2,986	56,781	2025/5/25
		2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	3,000	2,988	56,816	2025/2/24
		2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	5,000	4,939	93,929	2027/1/20
		2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	2,000	1,974	37,535	2027/10/15
		2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	3,000	3,002	57,099	2024/9/2
		2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	5,000	4,952	94,166	2027/4/15
		2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	7,000	6,930	131,770	2027/7/25
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	5,000	4,868	92,567	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	2,000	1,968	37,429	2029/9/25
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	18,000	17,766	337,811	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	10,000	10,017	190,467	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	8,000	7,835	148,989	2032/8/15
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	3,000	2,982	56,704	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	4,000	3,935	74,830	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	5,000	4,928	93,706	2032/5/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	2,000	1,997	37,979	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	4,000	3,963	75,354	2032/11/15
		2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	2,000	2,015	38,319	2024/4/8
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	12,000	12,066	229,426	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	7,000	7,044	133,941	2023/11/5
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	3,000	2,998	57,017	2031/11/18
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	2,000	2,014	38,296	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	16,000	16,171	307,484	2024/10/17
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	12,000	12,158	231,184	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	15,000	15,219	289,388	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	7,000	7,082	134,674	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	5,000	5,075	96,503	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	7,000	7,133	135,633	2026/12/5
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	18,000	18,419	350,224	2029/11/21
		3.19 CHINA GOVT 240411	3.19	17,000	17,211	327,263	2024/4/11
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,193	174,797	2025/12/6

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
中国			%	千中国元	千中国元	千円	
	国債証券	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	15,200	15,543	295,547	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,291	195,679	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	8,000	8,291	157,648	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,330	215,445	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	15,000	15,530	295,291	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	4,000	4,034	76,716	2052/4/15
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	3,000	3,123	59,394	2051/10/18
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	5,000	5,377	102,241	2051/4/12
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	12,000	13,103	249,156	2050/9/14
小計						6,185,552	
エジプト				千エジプトポンド	千エジプトポンド		
	国債証券	13.536 EGYPT GOVE 250114	13.536	7,000	6,052	26,157	2025/1/14
		14.06 EGYPT GOVER 260112	14.06	27,000	22,423	96,903	2026/1/12
		14.292 EGYPT GOVE 280105	14.292	10,000	8,040	34,748	2028/1/5
		14.369 EGYPT GOVE 251020	14.369	17,000	14,347	62,004	2025/10/20
		14.4 EGYPT GOVERN 290910	14.4	9,000	7,117	30,759	2029/9/10
		14.483 EGYPT GOVE 260406	14.483	23,000	19,139	82,711	2026/4/6
		14.531 EGYPT GOVE 240914	14.531	20,000	18,052	78,014	2024/9/14
		14.556 EGYPT GOVE 271013	14.556	15,000	12,183	52,650	2027/10/13
		14.563 EGYPT GOVE 260706	14.563	6,500	5,423	23,436	2026/7/6
		14.664 EGYPT GOVE 301006	14.664	7,000	5,520	23,854	2030/10/6
		16.1 EGYPT GOVERN 290507	16.1	4,500	3,831	16,557	2029/5/7
小計						527,799	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	97,500	105,042	793,067	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	36,800	25,128	189,723	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	37,300	24,097	181,937	2041/2/28
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	60,000	49,971	377,281	2031/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	132,000	121,143	914,629	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	99,400	87,640	661,689	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	90,000	73,975	558,515	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	79,600	63,819	481,835	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	127,900	102,486	773,771	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	96,000	83,764	632,424	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	65,000	54,353	410,365	2040/1/31
小計						5,975,239	
合計						62,885,512	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

（2023年１月26日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	62,885,512	97.0
コール・ローン等、その他	1,917,175	3.0
投資信託財産総額	64,802,687	100.0

（注）期末における外貨建純資産（64,699,655千円）の投資信託財産総額（64,802,687千円）に対する比率は99.8%です。

（注）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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝129.27円	１アルゼンチンペソ＝0.6981円	１メキシコペソ＝6.8767円	１ブラジルレアル＝25.4452円
100チリペソ＝16.0979円	100コロンビアペソ＝2.8487円	１ペルーヌエボソル＝33.2031円	１ウルグアイペソ＝3.3064円
１ドミニカペソ＝2.28円	１ユーロ＝141.09円	１セルビアディナール＝1.201594円	１トルコリラ＝6.8727円
１チェココルナ＝5.9344円	100ハンガリーフォリント＝36.5131円	１ポーランドズロチ＝29.9211円	１ルーマニアレイ＝28.818円
１マレーシアリンギット＝30.3617円	１タイバーツ＝3.95円	１フィリピンペソ＝2.3651円	100インドネシアルピア＝0.87円
１中国元＝19.0141円	１エジプトポンド＝4.3215円	１南アフリカランド＝7.55円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	64,938,678,511
コール・ローン等	903,875,359
公社債(評価額)	62,885,512,860
未収入金	177,958,378
未収利息	889,586,096
前払費用	81,745,818
(B) 負債	183,188,863
前受収益	145,620
未払金	160,005,767
未払解約金	23,037,441
未払利息	35
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	64,755,489,648
元本	43,842,059,667
次期繰越損益金	20,913,429,981
(D) 受益権総口数	43,842,059,667口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,770円

＜注記事項＞

①期首元本額　36,997,686,845円
　期中追加設定元本額　8,676,925,462円
　期中一部解約元本額　1,832,552,640円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4770円です。

○損益の状況 (2022年１月27日～2023年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	3,164,195,640
受取利息	3,164,146,209
その他収益金	158,821
支払利息	△ 109,390
(B) 有価証券売買損益	58,283,895
売買益	6,682,790,333
売買損	△ 6,624,506,438
(C) 保管費用等	△ 57,256,869
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	3,165,222,666
(E) 前期繰越損益金	14,890,902,354
(F) 追加信託差損益金	3,645,742,024
(G) 解約差損益金	△ 788,437,063
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	20,913,429,981
次期繰越損益金(Ｈ)	20,913,429,981

(注) (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) (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) (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。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	14,726,003,007円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国債券インデックスファンド	10,546,062,588円
つみたて８資産均等バランス	6,826,516,752円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	3,563,187,092円
ｅＭＡＸＩＳ 新興国債券インデックス	3,120,871,292円
ラップ向けインデックスｆ 新興国債券	1,960,403,585円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,126,420,368円
海外債券セレクション（ラップ向け）	520,244,134円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	475,504,903円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	365,022,368円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	356,969,818円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	111,616,987円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	83,597,555円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	34,226,558円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	10,364,781円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,863,232円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	3,622,812円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,612,745円
コアバランス	1,149,064円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	800,026円
合計	43,842,059,667円

グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）

損益の状況、組入資産の明細は「グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）」の第６期（2021年９月７日～2022年９月５日）の決算資料から抜粋したものです。

■損益及び剰余金計算書

項目	第５期 自　2020年９月８日 至　2021年９月６日	第６期 自　2021年９月７日 至　2022年９月５日
	金額（円）	金額（円）
Ⅰ　営業収益		
有価証券売買等損益	2,356,772,720	1,174,442,634
営業収益合計	2,356,772,720	1,174,442,634
Ⅱ　営業費用		
受託者報酬	13,813,432	14,290,746
委託者報酬	97,128,956	100,200,885
その他費用	992,086	936,436
営業費用合計	111,934,474	115,428,067
営業利益金額または損失金額（△）	2,244,838,246	1,059,014,567
経常利益金額または損失金額（△）	2,244,838,246	1,059,014,567
当期純利益金額または純損失金額（△）	2,244,838,246	1,059,014,567
Ⅲ　一部解約に伴う当期純利益金額または純損失金額（△）分配額	64,691,123	28,578,303
Ⅳ　期首剰余金または欠損金（△）	4,996,291,234	7,413,002,736
Ⅴ　剰余金増加額	625,979,393	621,995,275
（当期追加信託に伴う剰余金増加額）	(625,979,393)	(621,995,275)
Ⅵ　剰余金減少額	389,415,014	799,090,022
（当期一部解約に伴う剰余金減少額）	(389,415,014)	(799,090,022)
Ⅶ　期末剰余金または欠損金（△）	7,413,002,736	8,266,344,253

■組入資産の明細

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	グローバル社債マザーファンド	25,099,772,923	33,867,123,605	
合計		25,099,772,923	33,867,123,605	

下記は、グローバル社債マザーファンドの内容です。

有価証券明細表（債券）

（2022年９月５日現在）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	米ドル	MDC-GMTN B.V.	500,000.00	516,250.00	
	計	銘柄数： 1	500,000.00	516,250.00	
				(72,455,687)	
		組入時価比率： 0.2%		0.2%	
	ユーロ	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	750,000.00	742,150.50	
		PETROLEOS MEXICANOS	1,200,000.00	1,073,772.00	
	計	銘柄数： 2	1,950,000.00	1,815,922.50	
				(252,649,297)	
		組入時価比率： 0.7%		0.8%	
	小計			325,104,984	
				(325,104,984)	
社債券	米ドル	ABBVIE INC	250,000.00	218,406.89	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	600,000.00	598,988.26	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	334,000.00	319,184.12	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	1,066,000.00	988,633.91	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	450,000.00	382,474.49	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	550,000.00	460,368.74	
		ALIBABA GROUP HOLDING	1,375,000.00	1,361,523.65	
		ALIBABA GROUP HOLDING	900,000.00	746,221.82	
		ALTRIA GROUP INC	775,000.00	586,584.82	
		AMAZON.COM INC	400,000.00	276,256.09	
		AMAZON.COM INC	250,000.00	165,889.84	
		AMERICAN EXPRESS CO	925,000.00	916,365.86	
		AMGEN INC	525,000.00	450,486.39	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	425,000.00	391,497.39	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	250,000.00	225,720.70	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	1,550,000.00	1,396,193.96	
		ANTHEM INC	875,000.00	744,398.06	
		AON CORP/AON GLOBAL HOLD	275,000.00	228,991.69	
		APPLE INC	625,000.00	470,036.62	
		APPLE INC	575,000.00	415,230.39	
		APPLE INC	675,000.00	518,184.71	
		AT&T INC	2,000,000.00	1,458,201.58	
		AUST & NZ BANKING GROUP	1,075,000.00	845,641.99	
		AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	675,000.00	619,879.81	
		BAIDU INC	675,000.00	611,026.79	
		BANC CREDITO INVERSIONES	300,000.00	250,024.50	
		BANCO DE CREDITO DEL PER	620,000.00	589,226.30	
		BANCO SANTANDER CHILE	875,000.00	834,549.71	
		BANCO SANTANDER SA	200,000.00	198,882.99	
		BANK HAPOALIM	1,300,000.00	1,134,049.80	
		BANK OF AMERICA CORP	525,000.00	517,121.46	
		BANK OF AMERICA CORP	4,975,000.00	4,128,090.97	
		BANK OF AMERICA CORP	1,000,000.00	771,766.67	
		BANK OF AMERICA CORP	1,700,000.00	1,456,783.98	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	BANK OF IRELAND GROUP	1,675,000.00	1,439,104.49	
		BARCLAYS PLC	700,000.00	655,432.01	
		BARCLAYS PLC	200,000.00	193,500.00	
		BAT CAPITAL CORP	2,300,000.00	2,113,988.02	
		BAT CAPITAL CORP	75,000.00	52,058.67	
		BELROSE FUNDING TRUST	350,000.00	278,857.48	
		BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	1,000,000.00	700,269.76	
		BMW US CAPITAL LLC	400,000.00	341,866.88	
		BNP PARIBAS	1,925,000.00	1,829,459.15	
		BOEING CO	550,000.00	469,814.35	
		BOEING CO	875,000.00	676,717.85	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	625,000.00	566,938.28	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	625,000.00	590,625.00	
		BPCE SA	2,225,000.00	2,213,784.37	
		BPCE SA	575,000.00	446,882.32	
		BPCE SA	1,000,000.00	799,990.60	
		BRASKEM NETHERLANDS	620,000.00	540,795.00	
		BROADCOM INC	175,000.00	143,763.94	
		BROADCOM INC	250,000.00	186,026.30	
		BROOKFIELD FINANCE INC	525,000.00	439,911.18	
		BROOKFIELD FINANCE LLC	75,000.00	52,770.61	
		BROWN & BROWN INC	750,000.00	595,415.57	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	200,000.00	190,475.99	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	125,000.00	95,261.01	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	600,000.00	476,598.93	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	700,000.00	683,279.89	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	800,000.00	789,904.68	
		CELANESE US HOLDINGS LLC	1,250,000.00	1,250,936.39	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	325,000.00	263,084.37	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	100,000.00	75,862.23	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	975,000.00	665,692.64	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	250,000.00	202,635.71	
		CHINA CINDA 2020 I MNGMN	900,000.00	753,677.93	
		CITIGROUP INC	2,075,000.00	1,676,606.16	
		CITIGROUP INC	725,000.00	609,247.68	
		CLEVELAND ELECTRIC ILLUM	675,000.00	658,874.52	
		CNO FINANCIAL GROUP INC	490,000.00	473,643.66	
		CNO GLOBAL FUNDING	625,000.00	555,855.93	
		COINBASE GLOBAL INC	310,000.00	199,479.45	
		COMCAST CORP	1,625,000.00	1,086,056.49	
		COMMERZBANK AG	650,000.00	664,362.88	
		CONTINENTAL RESOURCES	525,000.00	462,680.85	
		COREBRIDGE FINANCIAL INC	1,000,000.00	940,442.73	
		COUNTRY GARDEN HLDGS	660,000.00	250,358.88	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	1,375,000.00	1,190,606.10	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	300,000.00	286,205.27	
		CVS HEALTH CORP	825,000.00	662,901.22	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	DAIMLER TRUCKS FINAN NA	300,000.00	288,198.08	
		DAIMLER TRUCKS FINAN NA	750,000.00	668,463.80	
		DELL INT LLC / EMC CORP	950,000.00	608,420.91	
		DEUTSCHE BANK NY	875,000.00	861,747.22	
		DEUTSCHE BANK NY	900,000.00	899,543.34	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	1,150,000.00	1,104,807.23	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	500,000.00	430,997.77	
		DICK'S SPORTING GOODS	800,000.00	535,851.53	
		DP WORLD LTD	850,000.00	827,015.15	
		DTE ELECTRIC CO	700,000.00	518,820.11	
		DUPONT DE NEMOURS INC	375,000.00	369,138.79	
		EATON CORP	650,000.00	627,417.58	
		EDP FINANCE BV	1,425,000.00	1,405,388.09	
		ENBRIDGE INC	1,475,000.00	1,191,584.67	
		ENEL FINANCE INTL NV	675,000.00	611,387.73	
		ENEL FINANCE INTL NV	1,025,000.00	946,618.67	
		ENEL SPA	1,675,000.00	1,714,948.75	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	325,000.00	252,641.23	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	375,000.00	270,323.98	
		EQUITABLE FINANCIAL LIFE	1,325,000.00	1,053,216.49	
		EXPEDIA GROUP INC	445,000.00	399,966.00	
		FELLS POINT FUNDING TR	1,200,000.00	1,114,180.41	
		FERGUSON FINANCE PLC	525,000.00	488,825.52	
		FIVE CORNERS FND TR II	550,000.00	472,061.92	
		FORD MOTOR CREDIT CO LLC	575,000.00	543,346.25	
		FOX CORP	325,000.00	313,166.77	
		GE CAPITAL INTL FUNDING	1,010,000.00	950,432.75	
		GENERAL MOTORS CO	475,000.00	478,098.00	
		GENERAL MOTORS CO	300,000.00	298,519.91	
		GEORGIA-PACIFIC LLC	675,000.00	584,473.52	
		GILEAD SCIENCES INC	400,000.00	273,414.13	
		GLENCORE FUNDING LLC	600,000.00	567,664.62	
		GLENCORE FUNDING LLC	500,000.00	403,240.59	
		GLOBAL ATLANTIC	680,000.00	555,022.80	
		GLOBAL PAYMENTS INC	725,000.00	712,042.73	
		GLP CAPITAL LP / FIN II	700,000.00	614,256.20	
		GLP CAPITAL LP / FIN II	150,000.00	120,187.50	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,225,000.00	1,826,995.27	
		GRUPO AVAL LTD	250,000.00	201,130.51	
		HARBORWALK FUNDING	225,000.00	211,487.91	
		HCA INC	1,125,000.00	994,108.35	
		HSBC HOLDINGS PLC	250,000.00	225,688.69	
		HYATT HOTELS CORP	700,000.00	666,513.36	
		IMPERIAL BRANDS FIN PLC	600,000.00	608,574.36	
		INDIANA MICHIGAN POWER	475,000.00	409,779.90	
		INDOFOOD CBP SUKSES MAKM	300,000.00	251,939.71	
		INTEL CORP	850,000.00	628,461.81	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	INTEL CORP	250,000.00	241,121.77	
		INTERSTATE POWER & LIGHT	375,000.00	292,431.15	
		INTESA SANPAOLO SPA	1,650,000.00	1,652,119.32	
		JBS USA/FOOD/FINANCE	975,000.00	874,253.25	
		JERSEY CENTRAL PWR & LT	650,000.00	547,872.20	
		JETBLUE 2019-1 CLASS AA	957,034.10	817,314.39	
		JPMORGAN CHASE & CO	575,000.00	557,065.19	
		JPMORGAN CHASE & CO	3,925,000.00	3,099,799.79	
		JPMORGAN CHASE & CO	800,000.00	655,387.90	
		KYNDRYL HOLDINGS INC	750,000.00	621,171.45	
		LEASEPLAN CORPORATION NV	1,400,000.00	1,334,515.79	
		LEVEL 3 FINANCING INC	475,000.00	419,061.62	
		LEVEL 3 FINANCING INC	500,000.00	419,522.50	
		LLOYDS BANK PLC	600,000.00	556,337.02	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	700,000.00	674,003.42	
		LOWE'S COS INC	275,000.00	186,322.40	
		LYB INT FINANCE III	275,000.00	218,201.87	
		MACQUARIE GROUP LTD	900,000.00	718,718.58	
		MACY'S RETAIL HLDGS LLC	220,000.00	185,910.36	
		MAGALLANES INC	625,000.00	546,241.83	
		MAGALLANES INC	375,000.00	305,071.59	
		MAGALLANES INC	275,000.00	218,764.31	
		MAGALLANES INC	350,000.00	276,363.57	
		MARRIOTT INTERNATIONAL	350,000.00	290,433.13	
		MARRIOTT INTERNATIONAL	1,075,000.00	917,955.29	
		MCDONALD'S CORP	350,000.00	319,190.56	
		MET LIFE GLOB FUNDING I	575,000.00	512,232.92	
		MICRON TECHNOLOGY INC	1,050,000.00	816,939.02	
		MICROSOFT CORP	650,000.00	468,617.14	
		MIDWEST CONNECTOR CAPIT	1,050,000.00	980,434.57	
		MPLX LP	750,000.00	650,592.06	
		NATIONWIDE BUILDING SOCI	1,425,000.00	1,340,615.70	
		NBN CO LTD	1,350,000.00	1,137,823.86	
		NBN CO LTD	1,200,000.00	989,787.32	
		NEWCASTLE COAL INFRASTRU	1,475,000.00	1,289,992.32	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	575,000.00	413,398.82	
		NISSAN MOTOR CO	975,000.00	959,534.10	
		NOVA CHEMICALS CORP	575,000.00	550,814.95	
		NRG ENERGY INC	320,000.00	253,428.80	
		NTT FINANCE CORP	1,700,000.00	1,470,382.88	
		ONEOK INC	125,000.00	110,342.74	
		ONEOK INC	450,000.00	389,373.88	
		OOREDOO INTL FINANCE	780,000.00	695,650.80	
		ORACLE CORP	450,000.00	303,803.06	
		OVERSEA-CHINESE BANKING	620,000.00	572,260.00	
		PACIFIC GAS & ELECTRIC	300,000.00	209,041.95	
		PELOTON INTERACTIVE INC	615,000.00	436,608.86	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	POWER FINANCE CORP LTD	925,000.00	780,150.12	
		PROMIGAS/GASES PACIFICO	215,000.00	182,389.87	
		PROSUS NV	400,000.00	321,587.77	
		PSA TREASURY PTE LTD	500,000.00	439,489.74	
		PUBLIC SERVICE COLORADO	225,000.00	214,304.38	
		PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	975,000.00	810,440.15	
		QNB FINANCE LTD	350,000.00	329,063.70	
		RAYTHEON TECH CORP	425,000.00	356,078.51	
		RESORTS WORLD/RWLV CAP	700,000.00	563,716.69	
		ROCKIES EXPRESS PIPELINE	375,000.00	345,667.50	
		ROCKIES EXPRESS PIPELINE	375,000.00	334,576.69	
		ROGERS COMMUNICATIONS IN	700,000.00	607,029.82	
		S&P GLOBAL INC	150,000.00	127,451.53	
		S&P GLOBAL INC	150,000.00	127,149.11	
		SABINE PASS LIQUEFACTION	600,000.00	572,953.26	
		SANTOS FINANCE LTD	1,350,000.00	1,252,469.25	
		SEALED AIR CORP	450,000.00	395,328.99	
		SGSP AUSTRALIA ASSETS	900,000.00	850,486.50	
		SHOPIFY INC	494,000.00	422,123.00	
		SIGMA ALIMENTOS SA	650,000.00	622,926.57	
		SMITHFIELD FOODS INC	900,000.00	694,339.30	
		SOCIETE GENERALE	1,250,000.00	1,180,353.15	
		SOCIETE GENERALE	400,000.00	312,555.48	
		SOUTHERN CO	750,000.00	753,348.84	
		SPOTIFY USA INC	505,000.00	413,014.56	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	670,312.50	673,299.24	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	450,000.00	454,471.12	
		SUN COMMUNITIES OPER LP	950,000.00	846,928.17	
		SVB FINANCIAL GROUP	194,000.00	146,380.76	
		SYNCHRONY BANK	1,250,000.00	1,238,501.75	
		SYNGENTA FINANCE NV	700,000.00	695,002.02	
		T-MOBILE USA INC	250,000.00	198,933.68	
		T-MOBILE USA INC	600,000.00	424,175.77	
		T-MOBILE USA INC	300,000.00	214,554.57	
		TAKE-TWO INTERACTIVE SOF	300,000.00	294,357.22	
		TAKE-TWO INTERACTIVE SOF	375,000.00	345,968.65	
		TENCENT HOLDINGS LTD	650,000.00	610,752.38	
		TENCENT HOLDINGS LTD	425,000.00	399,983.74	
		TRANSMANTARO	400,000.00	369,344.00	
		TRANSPRTDRA DE GAS INTL	340,000.00	326,724.70	
		TRANSURBAN FINANCE CO	575,000.00	467,732.86	
		UBS AG	925,000.00	928,243.97	
		UBS GROUP AG	350,000.00	342,950.49	
		UNION ELECTRIC CO	550,000.00	477,846.35	
		UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,425,000.00	1,363,664.67	
		VERIZON COMMUNICATIONS	240,000.00	159,491.58	
		VIATRIS INC	225,000.00	145,265.28	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	VICI PROPERTIES / NOTE	475,000.00	421,040.00	
		VICI PROPERTIES LP	525,000.00	502,938.84	
		VIRGINIA ELEC & POWER CO	225,000.00	163,590.94	
		VIRGINIA ELEC & POWER CO	575,000.00	377,132.35	
		VONTIER CORP	1,075,000.00	824,826.10	
		WALMART INC	600,000.00	473,486.76	
		WALT DISNEY COMPANY	250,000.00	212,990.73	
		WALT DISNEY COMPANY	6,000.00	4,260.09	
		WELLS FARGO & COMPANY	1,850,000.00	1,611,378.78	
		WESTERN DIGITAL CORP	578,000.00	551,841.87	
		WESTPAC BANKING CORP	1,075,000.00	847,624.01	
		WILLIAMS COMPANIES INC	200,000.00	192,914.03	
		XCEL ENERGY INC	600,000.00	524,142.93	
		ZURICH FINANCE IRELAND	1,050,000.00	838,204.50	
	計	銘柄数：　236	171,689,346.60	149,046,464.36	
				(20,918,671,272)	
		組入時価比率：　61.8%		64.5%	
	ユーロ	2I RETE GAS SPA	575,000.00	523,048.75	
		ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	400,000.00	381,924.00	
		AEROPORTS DE PARIS	400,000.00	339,518.40	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	100,000.00	84,497.40	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	400,000.00	330,150.00	
		ALLIANZ SE	1,400,000.00	1,375,472.00	
		ASR NEDERLAND NV	2,000,000.00	2,017,694.40	
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,650,000.00	1,668,740.70	
		ASTM SPA	700,000.00	556,270.40	
		AURIZON NETWORK PTY LTD	500,000.00	493,230.00	
		AUSGRID FINANCE PTY LTD	300,000.00	226,818.30	
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	1,200,000.00	939,022.80	
		AUST & NZ BANKING GROUP	500,000.00	437,486.00	
		AXA SA	1,000,000.00	1,023,046.00	
		AXA SA	1,400,000.00	1,293,789.00	
		AXA SA	525,000.00	518,343.00	
		BANCO SANTANDER SA(REGS	1,800,000.00	1,737,511.20	
		BASF SE	1,400,000.00	1,385,526.60	
		BAYER AG	700,000.00	553,416.50	
		BEL SARL	600,000.00	593,271.60	
		BHP BILLITON FINANCE LTD	1,000,000.00	1,033,931.00	
		BLACKSTONE PP EUR HOLD	800,000.00	677,496.00	
		BNP PARIBAS	1,225,000.00	1,202,839.75	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO	650,000.00	497,487.25	
		CAIXABANK SA	1,800,000.00	1,656,604.00	
		CELLNEX TELECOM SA	400,000.00	321,724.00	
		CK HUTCHISON EUROPE	1,050,000.00	856,200.97	
		COLOPLAST FINANCE BV	425,000.00	414,016.30	
		COMMONWEALTH BANK AUSTRA	1,600,000.00	1,532,763.20	
		CREDIT AGRICOLE	1,000,000.00	949,687.00	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	CREDIT AGRICOLE ASSRNCES	1,500,000.00	1,487,704.50	
		CREDIT AGRICOLE SA	600,000.00	523,599.00	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	525,000.00	424,972.27	
		DANSKE BANK A/S	200,000.00	184,080.79	
		DEUTSCHE BANK AG	400,000.00	374,560.00	
		DUKE ENERGY CORP	650,000.00	637,323.70	
		DUKE ENERGY CORP	575,000.00	548,061.25	
		ELI LILLY & CO	600,000.00	426,499.97	
		ENERGIAS DE PORTUGAL SA	400,000.00	359,037.20	
		EUROCLEAR INVESTMENTS SA	600,000.00	553,770.00	
		FIDELITY NATL INFO SERV	600,000.00	502,640.40	
		FOMENTO ECONOMICO MEX	800,000.00	681,940.69	
		FRESENIUS SE & CO KGAA	450,000.00	426,206.70	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	500,000.00	458,642.50	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,100,000.00	1,588,185.89	
		GRIFOLS SA	550,000.00	457,715.50	
		GSK CONSUMER HEALTHCARE	675,000.00	604,881.00	
		HEATHROW FUNDING LTD	500,000.00	477,239.00	
		HOWOGE WOHNUNGS	400,000.00	344,600.67	
		IBERDROLA INTL BV	800,000.00	610,950.40	
		IE2 HOLDCO	500,000.00	497,659.50	
		IMPERIAL BRANDS FIN PLC	1,750,000.00	1,585,566.50	
		ING GROEP NV	2,300,000.00	2,042,542.60	
		ING GROEP NV	1,000,000.00	860,677.00	
		INTESA SANPAOLO SPA	500,000.00	486,331.00	
		INTRUM AB	100,000.00	95,102.20	
		JAB HOLDINGS BV	500,000.00	502,833.77	
		JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	615,815.20	
		JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	535,875.90	
		LLOYDS BANKING GROUP	550,000.00	523,402.00	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,000,000.00	1,941,154.00	
		LOGICOR FINANCING SARL	400,000.00	362,988.00	
		MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS	250,000.00	175,327.25	
		NOBEL BIDCO BV	380,000.00	268,428.20	
		NORTEGAS ENERGIA DISTRI	114,000.00	105,065.53	
		NORTEGAS ENERGIA DISTRI	400,000.00	304,518.00	
		OPTUS FINANCE PTY LTD	500,000.00	433,968.50	
		PHILIP MORRIS INTL INC	500,000.00	444,117.63	
		PROLOGIS EURO FINANCE	475,000.00	409,780.60	
		PROSEGUR CIA DE SEGURIDA	600,000.00	598,570.80	
		Q-PARK HOLDING BV	450,000.00	408,642.75	
		RWE AG	800,000.00	761,629.60	
		RYANAIR DAC	300,000.00	295,202.73	
		SAMPO OYJ	500,000.00	398,993.00	
		SCENTRE MGMT LTD	550,000.00	465,962.20	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA	500,000.00	433,006.50	
		SOCIETE GENERALE	2,600,000.00	2,279,108.00	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	STANDARD INDUSTRIES INC	475,000.00	397,459.10	
		STATE GRID OVERSEAS INV	750,000.00	681,875.25	
		TECHEM VERWALTUNGSGESELL	275,000.00	248,490.55	
		TELEFONICA EUROPE BV	600,000.00	577,518.00	
		TERNA RETE ELETTRICA	500,000.00	395,027.50	
		THERMO FISHER SC FNCE I	750,000.00	533,046.00	
		THERMO FISHER SCIENTIFIC	1,050,000.00	737,845.50	
		TOTALENERGIES SE	550,000.00	476,425.40	
		UBS GROUP AG	500,000.00	454,171.00	
		UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	325,000.00	324,480.23	
		VERIZON COMMUNICATIONS	1,050,000.00	801,739.05	
		VOLKSWAGEN INTL FIN NV	600,000.00	557,807.40	
		VOLKSWAGEN INTL FIN NV	1,500,000.00	1,465,819.62	
		VONOVIA SE	1,000,000.00	811,757.00	
		VONOVIA SE	800,000.00	629,936.80	
		WESTPAC BANKING CORP	1,900,000.00	1,671,937.30	
		WINTERSHALL DEA FIN 2BV	700,000.00	536,160.80	
		WINTERSHALL DEA FINANCE	1,300,000.00	1,107,017.60	
	計	銘柄数：95	75,469,000.00	67,534,921.01	
				(9,396,133,560)	
		組入時価比率：27.7%		29.0%	
	英ポンド	ANNINGTON FUNDING PLC	275,000.00	206,776.20	
		APT PIPELINES LTD	675,000.00	598,852.94	
		AT&T INC	1,150,000.00	1,070,805.25	
		BANQUE FED CRED MUTUEL	700,000.00	631,136.10	
		BNP PARIBAS	800,000.00	582,297.98	
		CREDIT SUISSE GROUP AG	450,000.00	340,220.37	
		HSBC HOLDINGS PLC	2,300,000.00	2,082,137.10	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,125,000.00	1,065,189.37	
		MCKESSON CORP	475,000.00	427,738.05	
		NATIONAL GRID GAS PLC	550,000.00	374,608.99	
		NGG FINANCE PLC	425,000.00	406,353.12	
		ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,000,000.00	927,193.00	
		SANTANDER UK GROUP HLDGS	1,100,000.00	1,022,940.82	
		SEGRO PLC	705,000.00	616,505.58	
		WELLS FARGO BANK NA	200,000.00	200,805.11	
		WESTERN POWER DIST WEST	600,000.00	637,426.12	
	計	銘柄数：16	12,530,000.00	11,190,986.10	
				(1,803,539,319)	
		組入時価比率：5.3%		5.6%	
	小計			32,118,344,151	
				(32,118,344,151)	
	合計			32,443,449,135	
				(32,443,449,135)	

（注１）通貨種類毎の計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
（注２）種類毎の小計欄および合計金額欄の（ ）は、外貨建有価証券に関わるもので、内書であります。
（注３）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各計欄の合計金額に対する比率であります。

デリバティブ取引等関係

①ヘッジ会計が適用されていないもの

（１）通貨関連

区分	種類	(2022年9月5日現在) 契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,447,486,732	－	1,485,940,833	△38,454,101
	ユーロ	2,412,267,761	－	2,440,492,251	△28,224,490
	英ポンド	462,024,878	－	449,295,061	12,729,817
	買建				
	米ドル	2,594,214,608	－	2,698,660,360	104,445,752
	カナダドル	1,218,017,908	－	1,227,695,020	9,677,112
	スイスフラン	123,872,475	－	124,721,406	848,931
	オーストラリアドル	152,601,052	－	154,609,000	2,007,948
合計		8,410,485,414	－	8,581,413,931	63,030,969

（注）１．時価の算定方法

１）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日（以下、「当該日」とする。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該仲値で評価しております。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

２）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

２．換算において円未満の端数は切り捨てております。

（２）債券関連

区分	種類	(2022年9月5日現在) 契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	6,049,063,294	－	6,014,369,865	34,693,429
	買建	7,271,823,553	－	7,223,249,551	△48,574,002
合計		13,320,886,847	－	13,237,619,416	△13,880,573

（注）１．時価の算定方法

１）債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

主たる取引所の発表清算値段または最終相場で評価しております。

２）債券先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３）契約額等および時価の邦貨換算は対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

２．換算において円未満の端数は切り捨てております。

②ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。