

iシェアーズ 先進国債券 インデックス・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限です。(設定日:2013年9月12日)	
決算日	8月2日(休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託者の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行なう場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券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。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の買付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要運用対象	子投資信託	【iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド】 先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	【先進国債券インデックス・マザーファンド】 日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年1回の毎決算時(原則として8月2日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行ないます。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。</p>	

第7期 運用報告書(全体版) (決算日:2020年8月3日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、当ファンドは上記の通り決算を行ないましたので、
期中の運用状況と収益分配金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。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するご問い合わせ先
電話番号:03-6703-4300
(受付時間 営業日の9:00~17:00)
ホームページアドレス
www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

子投資信託(決算日:2020年8月3日)

「iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2020年8月3日)

「先進国債券インデックス・マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
3期(2016年8月2日)	円 10,766	円 0	% △13.1	243.85	% △12.5	% 98.9	% -	% -	百万円 291
4期(2017年8月2日)	11,578	0	7.5	263.18	7.9	99.0	-	-	321
5期(2018年8月2日)	11,511	0	△0.6	263.09	△0.0	99.0	-	-	332
6期(2019年8月2日)	11,622	0	1.0	266.80	1.4	99.2	-	-	360
7期(2020年8月3日)	12,632	0	8.7	291.47	9.2	99.2	-	-	497

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額			(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2019年8月2日	円 11,622	-	% -	266.80	% -	% 99.2	% -	% -
8月末	11,800	1.5	271.11	1.6	99.2	-	-	
9月末	11,856	2.0	272.39	2.1	98.9	-	-	
10月末	11,965	3.0	275.05	3.1	98.7	-	-	
11月末	11,967	3.0	275.24	3.2	99.2	-	-	
12月末	12,018	3.4	276.47	3.6	99.0	-	-	
2020年1月末	12,114	4.2	278.72	4.5	99.1	-	-	
2月末	12,251	5.4	281.92	5.7	105.3	-	-	
3月末	12,272	5.6	282.05	5.7	98.8	-	-	
4月末	12,028	3.5	277.08	3.9	99.0	-	-	
5月末	12,204	5.0	281.27	5.4	98.9	-	-	
6月末	12,395	6.7	285.88	7.1	99.2	-	-	
7月末	12,516	7.7	288.73	8.2	99.2	-	-	
(期末) 2020年8月3日	12,632	8.7	291.47	9.2	99.2	-	-	

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

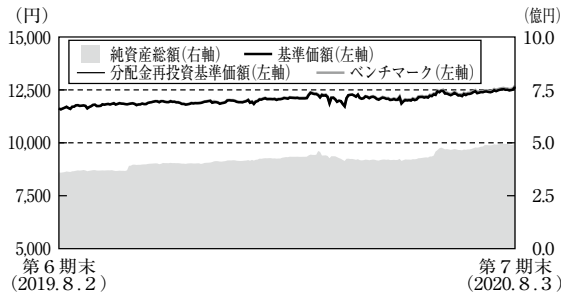
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

■当期中の基準価額等の推移について(第7期:2019年8月3日~2020年8月3日)



第7期首：11,622円

第7期末：12,632円(既払分配金0円)

騰落率：8.7%(分配金再投資ベース)

- * 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。
- * 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

当期(2019年8月3日から2020年8月3日)の先進国(除く日本)債券市場は、2019年末にかけて米中貿易協議や英国ブレグジット交渉等といった地政学リスクに対する懸念が緩和したことが市場で好感され、米国や欧州債券市場を中心に金利上昇基調となりました。2020年1月に入ってから、中国を中心に感染が確認されていた新型コロナウイルスの影響が世界各国に拡大しました。特に3月においては、ウイルスによる实体经济への影響や市場での資金繰り難・信用不全に対する懸念が高まったことから、市場はリスクオフ相場に急転し、金利は大幅に低下しました。その後、世界各国の政府や中央銀行が一連の支援策を打ち出したことから、市場センチメントの悪化に歯止めがかけられ、金利は期末にかけて安定し、レンジ内で推移しました。

ポートフォリオについて

<当ファンド>

先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組み入れた運用を行ないました。

<先進国債券インデックス・マザーファンド>

日本を除く先進国の国債等を主要投資対象として、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指し運用を行ないました。組入比率については概ね98%以上を維持しました。

基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は+8.7%の上昇となりました。為替についてはドル円は通期を通じて概ね横ばいとなった一方で、ユーロ円は上昇しました。先進国金利が低下したことにより基準価額は上昇しました。新型コロナウイルス感染症が予想をはるかに上回るペースで拡大した中、市場のリスクセンチメント及び流動性が悪化し、金利は低下する展開となりました。

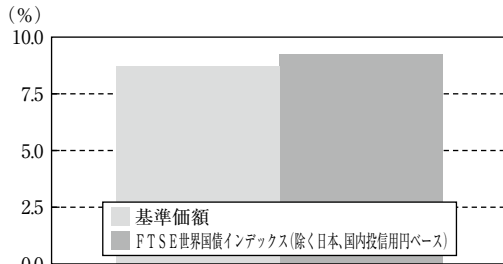
■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
先進国債券インデックス・マザーファンド	9.2%

ベンチマークとの差異について

当期、当ファンドの基準価額は+8.7%の上昇となりました。また、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は+9.2%の上昇となりました。ベンチマークとの差異については、当ファンドにおいて信託報酬等コスト負担が発生することなどがマイナス要因となりました。

【基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)】



第7期
(2019.8.3 ~ 2020.8.3)

【分配金について】

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行いません。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2019年8月3日 ~2020年8月3日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	2,631

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

【今後の運用方針について】

＜当ファンド＞

当ファンドの運用方針に従い、先進国債券インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

＜先進国債券インデックス・マザーファンド＞

日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2019. 8. 3～2020. 8. 3)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 43	% 0.357	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 期中の平均基準価額は12,048円です。
(投信会社)	(20)	(0.165)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(20)	(0.165)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	12	0.102	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)	(0.024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(9)	(0.077)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(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	55	0.459	

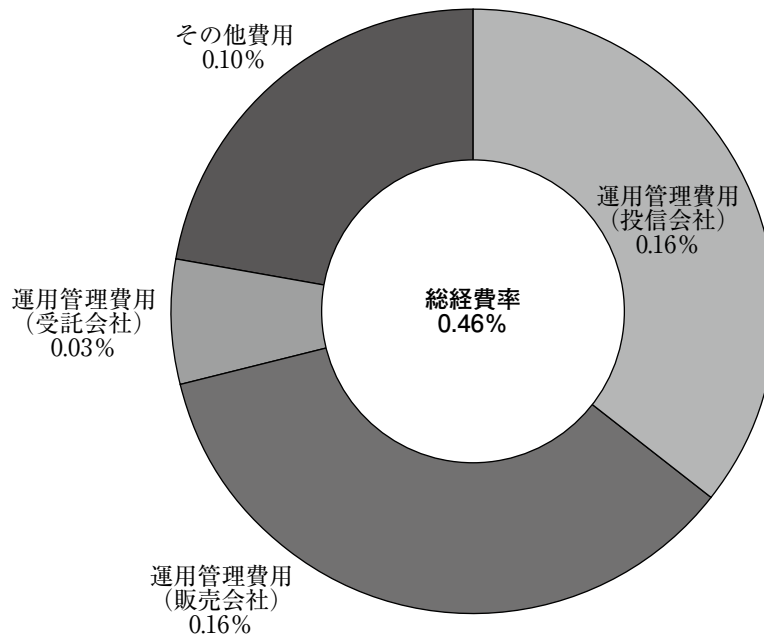
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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0.46%です。

(注1) 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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2019年8月3日から2020年8月3日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
先進国債券インデックス・マザーファンド	千口 165,820	千円 209,001	千口 86,789	千円 109,047

(注) 単位未満は切捨て。

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2019年8月3日から2020年8月3日まで)
当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2019年8月3日から2020年8月3日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
先進国債券インデックス・マザーファンド	千口 298,914	千口 377,945	千円 498,018

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は17,944,845千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2020年8月3日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
先進国債券インデックス・マザーファンド	千円 498,018	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	0	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	498,018	100.0

(注1) 先進国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(23,647,029千円)の投資信託財産総額(23,828,903千円)に対する比率は、99.2%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=106.13円、1カナダ・ドル=79.14円、1オーストラリア・ドル=75.67円、1シンガポール・ドル=77.15円、1英国・ポンド=138.78円、1イスラエル・シェケル=31.18円、1デンマーク・クローネ=16.75円、1ノルウェー・クローネ=11.62円、1スウェーデン・クローナ=12.06円、1メキシコ・ペソ=4.76円、1マレーシア・リンギット=25.03円、1ポーランド・ズロチ=28.20円、1ユーロ=124.73円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年8月3日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	498,018,614円
先進国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	498,018,610
未 収 入 金	4
(B) 負 債	959,107
未 払 解 約 金	4
未 払 信 託 報 酬	792,270
そ の 他 未 払 費 用	166,833
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	497,059,507
元 本	393,498,626
次 期 繰 越 損 益 金	103,560,881
(D) 受 益 権 総 口 数	393,498,626口
1万口当り基準価額(C/D)	12,632円

<注記事項>

期首元本額	309,851,425円
期中追加設定元本額	173,008,803円
期中一部解約元本額	89,361,602円

■損益の状況

自2019年8月3日 至2020年8月3日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	33,934,266円
売 買 益	37,102,496
売 買 損	△ 3,168,230
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,833,495
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	32,100,771
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	2,042,211
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	69,417,899
(配 当 等 相 当 額)	(64,249,096)
(売 買 損 益 相 当 額)	(5,168,803)
(F) 合 計(C+D+E)	103,560,881
次 期 繰 越 損 益 金(F)	103,560,881
追 加 信 託 差 損 益 金	69,417,899
(配 当 等 相 当 額)	(64,671,990)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,745,909)
分 配 準 備 積 立 金	34,142,982

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含まず。

(注2) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第7期計算期末における、費用控除後の配当等収益(10,259,156円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,620,182円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(4,745,909円)、収益調整金(その他収益調整金)(64,671,990円)、分配準備積立金(20,263,644円)により、分配対象収益は103,560,881円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

運用報告書

－第7期－ 決算日 2020年8月3日
 計算期間(2019年8月3日～2020年8月3日)

先進国債券インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	8月2日(原則)
運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ①日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行なう場合があります。 ③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券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。)が100%を超える場合があります。 ④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。 ⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。 ⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主要運用対象	日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	円	騰落率		騰落率				
3期(2016年8月2日)	10,990	△12.5	243.85	△12.5	98.5	-	-	百万円 5,247
4期(2017年8月2日)	11,902	8.3	263.18	7.9	98.6	-	-	7,271
5期(2018年8月2日)	11,903	0.0	263.09	△0.0	98.7	-	-	9,747
6期(2019年8月2日)	12,072	1.4	266.80	1.4	99.0	-	-	16,619
7期(2020年8月3日)	13,177	9.2	291.47	9.2	99.0	-	-	23,646

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	円	騰落率		騰落率			
(期首) 2019年8月2日	12,072	-	266.80	-	99.0	-	-
8月末	12,261	1.6	271.11	1.6	99.1	-	-
9月末	12,324	2.1	272.39	2.1	98.8	-	-
10月末	12,442	3.1	275.05	3.1	98.6	-	-
11月末	12,448	3.1	275.24	3.2	99.0	-	-
12月末	12,506	3.6	276.47	3.6	98.8	-	-
2020年1月末	12,610	4.5	278.72	4.5	98.9	-	-
2月末	12,757	5.7	281.92	5.7	105.2	-	-
3月末	12,784	5.9	282.05	5.7	98.7	-	-
4月末	12,534	3.8	277.08	3.9	98.9	-	-
5月末	12,722	5.4	281.27	5.4	98.8	-	-
6月末	12,925	7.1	285.88	7.1	99.1	-	-
7月末	13,056	8.2	288.73	8.2	99.0	-	-
(期末) 2020年8月3日	13,177	9.2	291.47	9.2	99.0	-	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

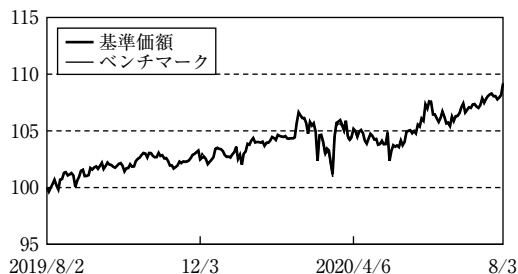
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

■基準価額の推移

(2019年8月2日～2020年8月3日)



(注1) 前期末を100とした指数値を使用しています。

(注2) ベンチマークは、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。

◇ファンド状況

■1万口当りの費用明細

項目	当期
(a) 売買委託手数料	円 -
(b) 有価証券取引税	-
(c) その他費用 (保管費用)	3 (3)
(その他)	(0)
合計	3

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

(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数

(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数

(c) その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2019年8月3日から2020年8月3日まで)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米・ドル 111,274	千米・ドル 92,562
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 6,157	千カナダ・ドル 4,632 (65)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 7,479	千オーストラリア・ドル 4,787 (50)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,508	千シンガポール・ドル 1,145
	イギリス	国債証券	千英国・ポンド 12,012	千英国・ポンド 9,082
国	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 2,883	千イスラエル・シェケル -
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 6,788	千デンマーク・クローネ 4,687
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 3,921	千ノルウェー・クローネ 2,939

			買 付 額	売 付 額
外	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 5,207	千スウェーデン・クローナ 4,240
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 36,823	千メキシコ・ペソ 23,977 (800)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 3,772	千マレーシア・リンギット 2,157
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 9,250	千南アフリカ・ランド 20,419
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 4,875	千ポーランド・ズロチ 3,508
国	ユ ロ	アイルランド	千ユーロ 1,418	千ユーロ 880
		オランダ	4,069	3,008 (40)
		ベルギー	5,099	3,730
		フランス	21,425	15,559 (163)
		ドイツ	15,472	9,591 (570)
		スペイン	12,346	8,800
		イタリア	18,895	13,913
		フィンランド	1,107	738
		オーストリア	3,090	2,003 (65)
		ユーロ通貨計	82,926	58,225 (838)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) ()内は、償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) ユーロの国名は発行国です。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄(2019年8月3日から2020年8月3日まで)

公社債

当			期		
買	付		売	付	
銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% 2026/01/31		228,112	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% 2026/01/31		242,914
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.25% 2046/08/15		227,170	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.25% 2027/11/15		228,439
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.25% 2027/11/15		213,854	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.15% 2028/10/31		173,398
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.125% 2025/05/15		196,338	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 2021/5/15		169,344
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 2021/11/15		195,432	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 2021/11/15		168,025
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 2.5% 2030/05/25		194,796	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.125% 2025/05/15		168,012
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2029/08/15		193,234	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3 2025/09/30		167,228
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% 2029/02/15		183,745	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.75% 2021/08/15		162,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.875% 2021/11/15		178,531	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.25% 2021/07/31		152,679
FRANCE O.A.T. 4.75%		176,689	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 2021/02/28		150,124

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

公社債

(A) 種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千米・ドル 86,641	千米・ドル 98,301	千円 10,432,713	% 44.1	% -	% 19.8	% 15.9	% 8.4	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 4,671	千カナダ・ドル 5,602	443,413	1.9	-	0.9	0.6	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 6,050	千オーストラリア・ドル 7,165	542,183	2.3	-	1.6	0.5	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 1,131	千シンガポール・ドル 1,309	101,060	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
イギリス	千英国・ポンド 7,546	千英国・ポンド 11,226	1,558,008	6.6	-	5.2	1.1	0.2	
イスラエル	千イスラエル・シユケル 2,300	千イスラエル・シユケル 2,906	90,628	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 5,835	千デンマーク・クローネ 7,325	122,705	0.5	-	0.4	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 3,980	千ノルウェー・クローネ 4,343	50,468	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 5,020	千スウェーデン・クローナ 5,689	68,616	0.3	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 32,100	千メキシコ・ペソ 36,486	173,674	0.7	-	0.4	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,275	千マレーシア・リンギット 4,733	118,480	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 4,495	千ポーランド・ズロチ 4,908	138,408	0.6	-	0.2	0.2	0.2	
ユ ロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	1,326	1,546	192,933	0.8	-	0.6	0.2	0.0
	オランダ	2,868	3,616	451,065	1.9	-	1.2	0.5	0.3
	ベルギー	3,638	4,864	606,779	2.6	-	1.8	0.5	0.2
	フランス	15,072	19,526	2,435,502	10.3	-	7.2	2.3	0.7
	ドイツ	11,157	14,213	1,772,845	7.5	-	5.2	1.4	0.9
	スペイン	8,503	11,274	1,406,237	5.9	-	3.9	1.7	0.4
イタリア	13,898	17,619	2,197,663	9.3	-	5.6	2.9	0.8	
ロ	フィンランド	1,020	1,174	146,497	0.6	-	0.3	0.1	0.2
	オーストリア	2,247	2,970	370,455	1.6	-	1.1	0.5	0.0
小 計	59,729	76,805	9,579,978	40.5	-	26.9	10.0	3.6	
合 計	-	-	23,420,342	99.0	-	56.6	29.3	13.2	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 詳細開示(個別銘柄別)
外国(外貨建)公社債

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.2500	2040/11/15	200	321	34,128
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2023/12/31	300	321	34,119
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/12/31	1,070	1,098	116,553
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2021/10/31	110	111	11,836
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2024/02/15	210	229	24,338
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2025/09/30	330	376	39,972
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2044/02/15	300	456	48,421
US TREASURY N/B	6.5000	2026/11/15	700	969	102,904
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/08/31	320	326	34,648
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2021/12/31	870	894	94,933
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2024/01/31	300	324	34,445
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2026/01/31	280	315	33,524
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2026/08/15	200	214	22,718
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2025/11/15	459	506	53,805
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/08/15	210	228	24,253
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/05/15	442	572	60,791
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/05/15	840	903	95,925
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/11/15	600	679	72,107
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2047/11/15	700	957	101,598
UNITED STATES TREASURY	8.0000	2021/11/15	940	1,035	109,855
UNITED STATES TREASURY	6.2500	2023/08/15	400	474	50,318
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.6250	2040/02/15	290	482	51,224
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/11/15	500	542	57,604
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/08/15	450	508	53,926
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2047/08/15	562	767	81,424
US TREASURY N/B	6.1250	2027/11/15	573	810	85,971
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.3750	2031/02/15	60	89	9,537
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2025/05/15	1,040	1,134	120,416
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2045/05/15	710	993	105,401
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2022/11/15	150	155	16,466
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.5000	2028/08/15	440	616	65,392
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/11/15	650	665	70,630
US TREASURY N/B	6.2500	2030/05/15	85	131	13,979
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/07/31	730	786	83,509
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2027/05/31	380	382	40,644
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2022/06/30	1,215	1,261	133,874
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2046/08/15	780	967	102,697
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2021/10/15	130	134	14,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2023/11/30	230	245	26,023
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/10/31	210	228	24,263
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2025/10/31	190	217	23,053
US TREASURY N/B	5.2500	2028/11/15	410	570	60,527
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2023/12/31	300	325	34,526

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2025/12/31	530	597	63,396
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2023/03/15	850	858	91,112
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2021/10/31	500	508	53,956
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/10/31	370	399	42,386
US TREASURY N/B	6.0000	2026/02/15	490	644	68,378
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.2500	2029/02/15	290	406	43,118
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2043/05/15	20	27	2,883
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2023/05/15	200	209	22,190
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2022/12/31	150	157	16,688
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2021/09/15	500	514	54,617
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2041/08/15	75	114	12,119
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/09/30	500	540	57,353
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/05/15	890	1,056	112,096
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2048/05/15	300	439	46,593
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2043/11/15	246	379	40,319
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/06/30	120	124	13,199
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/11/15	190	252	26,840
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.2500	2023/06/15	800	802	85,219
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2021/08/31	550	558	59,233
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2046/11/15	373	517	54,912
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2026/11/15	750	827	87,796
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/02/15	810	1,047	111,207
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/02/15	110	118	12,536
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2023/05/31	300	312	33,192
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/07/31	200	201	21,434
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2040/05/15	210	340	36,175
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2030/05/15	1,160	1,169	124,130
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2050/05/15	855	866	91,935
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2028/02/15	112	131	13,940
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2048/02/15	300	429	45,537
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2024/08/15	852	927	98,419
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2044/08/15	330	468	49,710
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2023/02/15	980	1,026	108,951
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2029/08/15	1,170	1,286	136,565
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2049/08/15	562	708	75,173
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2022/01/31	275	280	29,783
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/01/31	250	256	27,223
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2023/02/28	700	724	76,934
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/01/31	440	472	50,122
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2022/02/15	430	445	47,293
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2029/02/15	865	1,020	108,298
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2049/02/15	165	238	25,263
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/02/15	805	903	95,867
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/10/31	440	450	47,778
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2023/01/15	865	894	94,904

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.5000	2039/08/15	245	400	42,472
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2045/08/15	586	804	85,417
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2047/02/15	200	284	30,145
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/08/15	160	213	22,616
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/10/31	730	758	80,522
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2021/07/31	310	316	33,590
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/10/31	950	990	105,073
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/10/31	700	761	80,785
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2049/11/15	585	757	80,343
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2041/11/15	280	392	41,677
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/11/30	400	417	44,307
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2021/09/30	630	644	68,400
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/05/31	740	763	81,048
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/11/30	450	490	52,099
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/11/30	400	455	48,335
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2048/08/15	300	430	45,728
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/08/15	185	220	23,389
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2021/08/15	940	965	102,458
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/04/30	900	970	102,971
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2026/04/30	350	391	41,550
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2023/01/31	310	322	34,236
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2024/12/31	500	534	56,702
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2023/06/30	460	493	52,368
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/06/30	1,100	1,235	131,171
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2023/02/28	810	862	91,506
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/02/28	900	1,004	106,602
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2023/04/30	850	885	93,931
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/08/31	400	432	45,864
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/08/31	200	225	23,917
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2042/05/15	66	91	9,675
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2023/03/31	140	145	15,404
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/08/31	100	103	11,020
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/08/31	700	707	75,083
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2021/07/31	750	762	80,872
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2022/08/15	710	731	77,659
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/03/31	560	600	63,713
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2025/03/31	900	1,000	106,232
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2023/08/15	100	107	11,375
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2045/11/15	390	547	58,132
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.8750	2040/08/15	570	873	92,756
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/09/30	470	475	50,453
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/09/30	90	93	9,927
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2041/05/15	108	176	18,784
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2021/09/30	500	507	53,908
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/09/30	390	420	44,651

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/07/31	400	431	45,778
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2043/08/15	285	431	45,844
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/07/31	200	226	24,020
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2039/11/15	277	447	47,447
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2024/02/29	720	777	82,484
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2026/02/28	440	494	52,443
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2042/02/15	100	140	14,929
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2026/03/31	200	222	23,567
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.3750	2044/05/15	249	366	38,859
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2024/05/15	830	903	95,871
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/02/28	210	215	22,901
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/02/15	1,050	1,080	114,627
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.6250	2027/03/31	800	813	86,310
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2045/02/15	740	952	101,063
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2043/02/15	624	878	93,242
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/02/15	1,220	1,319	140,013
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2027/05/15	500	566	60,174
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2047/05/15	205	291	30,936
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/04/30	180	192	20,478
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/04/30	200	225	23,896
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/06/30	870	932	98,929
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2023/01/31	640	675	71,735
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2025/01/31	300	330	35,121
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/12/31	660	719	76,374
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/07/31	615	638	67,715
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2021/11/15	780	807	85,681
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2028/11/15	40	48	5,164
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.3750	2048/11/15	100	153	16,270
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2029/05/15	645	749	79,569
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2049/05/15	670	947	100,585
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	0.5000	2027/04/30	800	806	85,597
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2044/11/15	253	352	37,441
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/11/15	1,212	1,318	139,944
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2022/02/28	815	835	88,709
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2026/05/31	825	911	96,774
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/08/31	360	373	39,599
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2022/05/31	910	937	99,449
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/05/31	840	899	95,417
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/04/30	215	221	23,508
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/04/30	470	502	53,318
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/02/15	850	877	93,078
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2030/02/15	480	523	55,596
小 計	-	-	86,641	98,301	10,432,713
(カナダ)			千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
CANADA-GOV'T	8.0000	2027/06/01	251	380	30,078

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				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
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.5000	2045/12/01	155	246	19,515
CANADIAN GOVERNMENT BOND	5.7500	2033/06/01	158	258	20,443
CANADA-GOV'T	5.7500	2029/06/01	329	480	38,050
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.0000	2022/09/01	325	330	26,123
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/03/01	242	251	19,887
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.2500	2025/03/01	500	521	41,285
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2025/09/01	100	100	7,992
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2022/06/01	195	203	16,139
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2025/06/01	100	109	8,651
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.0000	2051/12/01	287	372	29,449
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/06/01	112	115	9,173
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2022/05/01	160	163	12,941
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2024/03/01	160	171	13,550
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2048/12/01	94	137	10,865
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2029/06/01	350	405	32,102
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.2500	2021/06/01	560	574	45,439
CANADIAN GOVERNMENT BOND	5.0000	2037/06/01	115	192	15,266
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/06/01	303	328	26,000
CANADIAN GOVERNMENT BOND	4.0000	2041/06/01	135	216	17,164
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2022/03/01	20	20	1,589
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/06/01	20	21	1,703
小 計	-	-	4,671	5,602	443,413
(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	
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.5000	2033/04/21	520	740	56,024
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.2500	2028/05/21	785	879	66,536
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.0000	2047/03/21	111	143	10,824
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/11/21	430	449	34,017
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2035/06/21	97	118	8,947
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2039/06/21	130	169	12,807
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.5000	2023/04/21	307	350	26,528
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.0000	2021/12/21	35	35	2,712
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2029/04/21	523	633	47,927
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/05/15	244	254	19,268
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2041/05/21	126	153	11,616
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/11/21	570	670	50,724
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.7500	2027/04/21	400	511	38,667
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/11/21	225	261	19,813
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/04/21	410	464	35,180
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2027/11/21	125	144	10,900
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.2500	2026/04/21	244	295	22,394
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/07/15	200	221	16,752
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.7500	2037/04/21	173	237	17,941
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2024/04/21	395	430	32,597
小 計	-	-	6,050	7,165	542,183

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(シンガポール)	%		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.2500	2021/06/01	28	28	2,195
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/02/01	25	26	2,037
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.3750	2033/09/01	105	136	10,522
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2023/07/01	40	42	3,302
SINGAPORE GOV'T	3.1250	2022/09/01	101	106	8,250
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.2500	2021/10/01	50	50	3,901
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.6250	2028/05/01	70	80	6,175
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2046/03/01	92	126	9,748
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.7500	2022/04/01	40	40	3,162
SINGAPORE GOV'T	2.8750	2030/09/01	30	35	2,771
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/09/01	47	51	4,002
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.8750	2029/07/01	270	317	24,530
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.1250	2026/06/01	90	97	7,551
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.3750	2025/06/01	20	21	1,680
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/02/01	50	51	3,996
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2042/04/01	53	70	5,406
SINGAPORE GOV'T	3.5000	2027/03/01	20	23	1,825
小 計	-	-	1,131	1,309	101,060
(イギリス)			千英国・ポンド	千英国・ポンド	
UNITED KINGDOM GILT	6.0000	2028/12/07	191	285	39,670
UNITED KINGDOM GILT	1.6250	2028/10/22	60	68	9,449
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2036/03/07	370	584	81,085
UNITED KINGDOM GILT	2.2500	2023/09/07	205	220	30,534
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2045/01/22	379	627	87,059
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2040/12/07	120	205	28,508
UNITED KINGDOM GILT	5.0000	2025/03/07	360	445	61,784
TREASURY	4.2500	2046/12/07	206	387	53,804
UNITED KINGDOM GILT	0.1250	2023/01/31	600	603	83,710
TREASURY	4.2500	2032/06/07	220	323	44,926
UNITED KINGDOM GILT	8.0000	2021/06/07	290	309	42,946
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2022/09/07	180	186	25,943
UNITED KINGDOM GILT	0.6250	2025/06/07	135	139	19,422
TREASURY	4.7500	2030/12/07	255	377	52,344
UNITED KINGDOM GILT	2.7500	2024/09/07	30	33	4,657
UNITED KINGDOM GILT	1.0000	2024/04/22	201	209	29,091
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2049/01/22	45	58	8,092
UNITED KINGDOM GILT	0.8750	2029/10/22	165	177	24,627
UNITED KINGDOM GILT	1.2500	2027/07/22	108	117	16,354
UNITED KINGDOM GILT	0.7500	2023/07/22	117	120	16,662
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2039/09/07	270	453	62,929
UNITED KINGDOM GILT	0.1250	2028/01/31	200	201	27,982
UNITED KINGDOM GILT	3.7500	2021/09/07	45	46	6,503
UNITED KINGDOM GILT	2.5000	2065/07/22	91	161	22,419
UNITED KINGDOM GILT	3.7500	2052/07/22	212	406	56,386
TREASURY	4.2500	2027/12/07	108	142	19,728

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)	%		千英国・ポンド	千英国・ポンド	千円
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2068/07/22	241	542	75,235
TSY	4.7500	2038/12/07	139	243	33,754
UNITED KINGDOM GILT	0.5000	2022/07/22	31	31	4,351
TREASURY	4.0000	2060/01/22	105	233	32,338
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2049/12/07	365	721	100,155
UNITED KINGDOM GILT	1.5000	2026/07/22	182	199	27,696
UNITED KINGDOM GILT	4.5000	2042/12/07	239	435	60,399
UK TSY I/L GILT	4.5000	2034/09/07	195	307	42,609
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2057/07/22	224	311	43,214
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2055/12/07	447	969	134,600
UNITED KINGDOM GILT	3.2500	2044/01/22	215	338	47,026
小 計	-	-	7,546	11,226	1,558,008
(イスラエル)			千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	1.500	2023/11/30	130	136	4,270
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	4.250	2023/03/31	550	618	19,270
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	1.750	2025/08/31	140	152	4,753
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	5.500	2022/01/31	150	166	5,189
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	5.500	2042/01/31	340	614	19,151
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	6.250	2026/10/30	250	352	10,983
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	3.750	2024/03/31	150	171	5,338
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.750	2022/07/31	90	91	2,842
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	2.000	2027/03/31	130	144	4,500
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	3.750	2047/03/31	130	193	6,018
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	1.250	2022/11/30	90	93	2,905
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	2.250	2028/09/28	150	173	5,406
小 計	-	-	2,300	2,906	90,628
(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	
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.5000	2029/11/15	1,610	1,744	29,220
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.2500	2022/11/15	300	306	5,126
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/11/15	580	621	10,418
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/15	500	535	8,966
DENMARK GOVERNMENT BOND	3.0000	2021/11/15	605	633	10,603
DENMARK - BULLET	4.5000	2039/11/15	1,240	2,360	39,531
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/11/15	1,000	1,124	18,840
小 計	-	-	5,835	7,325	122,705
(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	
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0000	2023/05/24	510	536	6,234
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/03/13	370	395	4,596
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.5000	2026/02/19	340	362	4,210
NORWAY GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/03/14	805	886	10,300
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2027/02/17	500	544	6,329
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.3750	2030/08/19	180	194	2,257
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0000	2028/04/26	980	1,096	12,736
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2029/09/06	295	327	3,803
小 計	-	-	3,980	4,343	50,468

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スウェーデン)	%		千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円
SWEDEN GOVERNMENT BOND	3.5000	2022/06/01	340	363	4,385
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2029/11/12	550	592	7,148
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2028/05/12	210	224	2,712
SWEDEN GOVERNMENT BOND	5.0000	2020/12/01	560	569	6,865
SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	650	1,021	12,318
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/11/12	740	797	9,612
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/13	1,500	1,587	19,150
SWEDEN GOVERNMENT BOND	2.5000	2025/05/12	470	532	6,423
小 計	-	-	5,020	5,689	68,616
(メキシコ)			千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
MEXICAN BONOS	7.7500	2034/11/23	1,000	1,146	5,456
MEXICAN BONOS	7.7500	2042/11/13	1,500	1,671	7,956
MEXICAN BONOS	8.0000	2047/11/07	2,500	2,846	13,548
MEXICAN BONOS	7.7500	2031/05/29	1,300	1,488	7,082
MEXICAN BONOS	10.0000	2036/11/20	1,800	2,456	11,694
MEXICAN BONOS	6.5000	2022/06/09	3,000	3,101	14,763
MEXICAN BONOS	8.0000	2024/09/05	5,800	6,472	30,808
MEXICAN BONOS	7.5000	2027/06/03	3,700	4,139	19,705
MEXICAN BONOS	8.5000	2029/05/31	3,800	4,535	21,588
MEXICAN BONOS	8.0000	2023/12/07	1,500	1,651	7,862
MEXICAN BONOS	8.5000	2038/11/18	600	724	3,447
MEXICAN BONOS	10.0000	2024/12/05	2,800	3,354	15,966
MEXICAN BONOS	7.2500	2021/12/09	2,800	2,897	13,792
小 計	-	-	32,100	36,486	173,674
(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	
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.7360	2046/03/15	370	433	10,838
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.4180	2022/08/15	200	206	5,159
MALAYSIAN GOV'T	5.2480	2028/09/15	90	108	2,717
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.9550	2025/09/15	200	217	5,446
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.9350	2043/09/30	195	232	5,829
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.0590	2024/09/30	200	215	5,402
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.0480	2021/09/30	200	205	5,136
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1600	2021/07/15	20	20	511
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.7620	2037/04/07	160	190	4,756
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1810	2024/07/15	150	162	4,057
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.4980	2030/04/15	350	406	10,165
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2023/08/17	90	94	2,372
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.2540	2035/05/31	70	79	1,979
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.4800	2023/03/15	40	41	1,040
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1270	2032/04/15	530	597	14,943
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8990	2027/11/16	190	210	5,259
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.7570	2023/04/20	650	680	17,036
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8920	2027/03/15	270	297	7,434
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.3920	2026/04/15	300	335	8,392
小 計	-	-	4,275	4,733	118,480

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ポーランド)	%		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円
POLAND GOVT BOND	5.7500	2022/09/23	480	537	15,167
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	485	523	14,750
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	180	201	5,681
POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	365	410	11,586
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	510	579	16,330
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	245	269	7,599
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	400	438	12,352
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/07/25	950	948	26,736
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/04/25	350	363	10,239
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2023/01/25	55	58	1,642
POLAND GOVT BOND	5.7500	2029/04/25	175	242	6,843
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	300	336	9,476
小 計	-	-	4,495	4,908	138,408
(ユーロ・・・アイルランド)			千ユーロ	千ユーロ	
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2027/05/15	105	108	13,583
IRELAND GOVERNMENT BOND	3.9000	2023/03/20	170	190	23,729
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.8000	2022/03/15	30	30	3,826
IRELAND GOVERNMENT BOND	2.4000	2030/05/15	107	134	16,728
IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	89	123	15,419
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	65	70	8,786
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	100	125	15,596
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/10/18	29	29	3,664
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	65	71	8,875
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3500	2031/03/18	355	410	51,188
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.1000	2029/05/15	45	50	6,272
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	28	35	4,467
IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4000	2025/03/13	103	131	16,380
IRELAND GOVERNMENT BOND	5.0000	2020/10/18	35	35	4,413
(ユーロ・・・オランダ)					
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.5000	2040/01/15	145	163	20,353
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.7500	2047/01/15	220	387	48,341
NETHERLANDS GOVT	7.5000	2023/01/15	223	268	33,457
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/07/15	205	219	27,417
NETHERLANDSGOVERNMENTBOND	3.2500	2021/07/15	465	482	60,122
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.5000	2033/01/15	177	240	29,998
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2025/07/15	154	160	20,080
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.5000	2026/07/15	95	101	12,644
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/07/15	155	171	21,406
NETHERLANDS GOVT	5.5000	2028/01/15	180	262	32,746
NETHERLANDS GOVT	3.7500	2042/01/15	160	295	36,919
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/01/15	90	92	11,482
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2027/01/15	200	207	25,859
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/07/15	5	5	659
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.7500	2027/07/15	30	32	4,086
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	4.0000	2037/01/15	214	365	45,557

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・オランダ)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2029/07/15	150	159	19,932
(ユーロ・・・ベルギー)					
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2021/09/28	48	50	6,324
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.7500	2045/06/22	145	259	32,423
BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	420	611	76,302
BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	415	716	89,379
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.2500	2057/06/22	112	175	21,850
BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.6000	2047/06/22	230	296	36,980
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2022/09/28	230	254	31,746
BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	274	295	36,828
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.9000	2029/06/22	113	125	15,610
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.7500	2020/09/28	100	100	12,553
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.0000	2034/06/22	70	99	12,383
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.6000	2024/06/22	80	90	11,237
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.7000	2050/06/22	45	60	7,495
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.5000	2024/10/22	395	413	51,559
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.5000	2026/03/28	220	282	35,296
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.4500	2037/06/22	134	162	20,327
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.0000	2032/03/28	160	237	29,613
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2041/03/28	187	334	41,757
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.2500	2023/06/22	220	238	29,752
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.1500	2066/06/22	30	48	6,075
BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.2000	2023/10/22	10	10	1,280
(ユーロ・・・フランス)					
FRANCE O.A.T.	5.5000	2029/04/25	650	986	123,073
FRANCE O.A.T.	8.5000	2023/04/25	575	719	89,761
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.7500	2066/05/25	195	287	35,831
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	3.5000	2026/04/25	521	643	80,243
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.5000	2050/05/25	280	361	45,135
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2023/03/25	415	422	52,638
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	6.0000	2025/10/25	547	738	92,100
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.5000	2041/04/25	567	1,057	131,934
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2060/04/25	112	250	31,263
FRANCE O.A.T.	5.7500	2032/10/25	493	851	106,239
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2026/02/25	370	380	47,481
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.5000	2030/05/25	962	1,225	152,827
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.2500	2024/05/25	495	549	68,577
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	3.2500	2045/05/25	245	414	51,664
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2055/04/25	290	613	76,467
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.2500	2023/10/25	215	249	31,101
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/11/25	360	393	49,070
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.5000	2031/05/25	465	550	68,722
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	3.2500	2021/10/25	900	942	117,613
FRANCE O.A.T.	4.7500	2035/04/25	625	1,064	132,786
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2026/05/25	240	254	31,749
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/05/25	175	190	23,792
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2022/02/25	220	222	27,713
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.2500	2022/10/25	790	841	104,917

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・フランス)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2025/05/25	250	263	32,831
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	1.7500	2023/05/25	134	143	17,843
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.2500	2026/11/25	350	366	45,733
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.0000	2027/05/25	225	247	30,884
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.5000	2020/10/25	255	256	32,021
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2025/03/25	1,145	1,176	146,699
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.0000	2048/05/25	355	503	62,851
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2024/03/25	40	40	5,100
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2038/10/25	705	1,196	149,298
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.7500	2027/10/25	906	1,118	139,531
(ユーロ・・・ドイツ)					
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	175	189	23,684
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	6.2500	2030/01/04	605	1,008	125,793
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	4.7500	2034/07/04	349	610	76,127
DEUTSCHLAND REP	6.2500	2024/01/04	780	969	120,914
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.2500	2028/08/15	60	64	8,042
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	5.6250	2028/01/04	490	725	90,490
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	165	237	29,651
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	199	277	34,656
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	487	518	64,675
BUNDES OBLIGATION	0.2500	2020/10/16	250	250	31,229
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	5.5000	2031/01/04	100	165	20,581
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.2500	2029/02/15	257	276	34,528
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	440	479	59,843
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	252	431	53,833
DEUTSCHLAND REP	6.5000	2027/07/04	455	687	85,749
DEUTSCHLAND REP	3.2500	2042/07/04	48	86	10,737
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	113	188	23,519
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	177	335	41,802
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2021/04/09	50	50	6,262
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	580	621	77,573
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2027/11/15	500	524	65,458
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2030/02/15	600	633	78,991
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	830	904	112,849
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	570	590	73,649
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	171	179	22,343
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	21	22	2,786
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.2500	2020/09/04	150	150	18,752
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	125	130	16,295
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	454	790	98,549
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	102	110	13,829
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	120	128	16,022
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.0000	2050/08/15	438	453	56,530
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	115	119	14,907
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.2500	2021/09/04	590	608	75,942
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	339	691	86,237
(ユーロ・・・スペイン)					
SPANISH GOV'T	6.0000	2029/01/31	615	917	114,454

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・スペイン)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
SPANISH GOV'T	5.7500	2032/07/30	627	1,018	126,990
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.9000	2046/10/31	207	295	36,822
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.7000	2048/10/31	146	203	25,352
SPANISH GOV'T	4.8000	2024/01/31	325	383	47,829
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.8500	2022/01/31	705	771	96,187
SPANISH GOV'T	4.6500	2025/07/30	301	374	46,667
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.4000	2023/01/31	745	852	106,353
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0000	2025/01/31	565	570	71,148
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.8000	2024/04/30	363	419	52,265
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.7000	2041/07/30	285	493	61,590
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.5000	2027/04/30	170	187	23,405
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.4500	2066/07/30	244	418	52,211
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.4000	2023/10/31	170	196	24,485
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.2000	2037/01/31	205	317	39,632
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.9000	2026/07/30	670	911	113,734
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.7500	2024/10/31	300	338	42,235
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.4500	2029/04/30	600	665	83,035
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.3500	2033/07/30	75	92	11,516
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2028/10/31	452	637	79,494
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.1500	2025/10/31	160	179	22,390
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.9000	2040/07/30	394	689	86,060
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2044/10/31	179	339	42,374
(ユーロ・・・イタリア)					
BUONI POLIENNALI DEL	9.0000	2023/11/01	337	432	53,994
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.8500	2049/09/01	269	382	47,650
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.5000	2025/11/15	215	236	29,554
BUONI POLIENNALI DEL	7.2500	2026/11/01	485	680	84,861
BUONI POLIENNALI DEL	6.0000	2031/05/01	554	826	103,132
BUONI POLIENNALI DEL	5.0000	2034/08/01	742	1,081	134,939
BTPS	5.2500	2029/11/01	824	1,137	141,863
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2026/03/01	890	1,080	134,810
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2044/09/01	201	313	39,130
BUONI POLIENNALI DEL	5.7500	2033/02/01	270	409	51,020
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2040/09/01	380	590	73,642
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.5000	2022/11/01	665	745	93,048
BUONI POLIENNALI DEL	6.5000	2027/11/01	493	689	86,010
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.3500	2022/04/15	120	122	15,322
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2022/03/01	390	421	52,566
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2023/05/01	610	683	85,284
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.1000	2040/03/01	90	110	13,843
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.2500	2046/09/01	150	191	23,897
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2028/09/01	260	338	42,266
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.5000	2030/03/01	150	184	23,015
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.8000	2028/12/01	270	311	38,913
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2021/09/01	300	315	39,398
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.7500	2024/07/01	135	142	17,768
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.3000	2021/10/15	615	633	78,971
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.0500	2027/08/01	20	21	2,715

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・イタリア)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.4500	2048/03/01	275	364	45,479
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.1000	2026/07/15	50	54	6,770
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2039/08/01	863	1,332	166,220
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.5000	2022/09/01	353	393	49,061
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.2000	2022/04/01	30	30	3,818
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.8000	2067/03/01	210	248	30,949
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2023/08/01	727	827	103,183
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2025/03/01	750	905	112,897
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.7500	2024/09/01	700	795	99,202
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2024/03/01	505	580	72,456
(ユーロ・・・フィンランド)					
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/09/15	65	66	8,271
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/04/15	10	10	1,319
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/09/15	40	42	5,343
FINNISH GOV'T	4.0000	2025/07/04	46	56	7,073
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2028/09/15	30	32	4,027
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2026/04/15	20	21	2,647
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.1250	2034/04/15	115	134	16,833
FINLAND GOVERNMENT BOND	2.6250	2042/07/04	127	199	24,916
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.3750	2047/04/15	42	56	7,016
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/04/15	180	181	22,690
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.7500	2031/04/15	60	66	8,326
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.8750	2025/09/15	45	48	6,044
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.3750	2020/09/15	50	50	6,242
FINLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/07/04	45	56	7,057
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.6250	2022/09/15	35	36	4,577
FINLAND GOVERNMENT BOND	3.5000	2021/04/15	110	113	14,108
(ユーロ・・・オーストリア)					
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.6500	2024/10/21	168	184	23,006
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	225	382	47,677
REP OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	245	361	45,091
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.1500	2044/06/20	84	144	18,060
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.5000	2047/02/20	158	212	26,565
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/09/20	310	314	39,198
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.4000	2022/11/22	160	175	21,832
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/07/15	83	84	10,542
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2062/01/26	128	303	37,805
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.1000	2117/09/20	14	29	3,652
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.5000	2029/02/20	335	360	44,983
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/10/20	92	99	12,364
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.6500	2022/04/20	30	32	4,018
REP OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	115	150	18,816
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.4000	2034/05/23	100	135	16,841
小 計	-	-	59,729	76,805	9,579,978
合 計	-	-	-	-	23,420,342

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

(注2) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2020年8月3日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 23,420,342	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	408,560	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	23,828,903	100.0

- (注1) 当期末における外貨建資産(23,647,029千円)の投資信託財産総額(23,828,903千円)に対する比率は、99.2%です。
(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=106.13円、1カナダ・ドル=79.14円、1オーストラリア・ドル=75.67円、1シンガポール・ドル=77.15円、1英国・ポンド=138.78円、1イスラエル・シェケル=31.18円、1デンマーク・クローネ=16.75円、1フルウェー・クローネ=11.62円、1スウェーデン・クローナ=12.06円、1メキシコ・ペソ=4.76円、1マレーシア・リンギット=25.03円、1ポーランド・ズロチ=28.20円、1ユーロ=124.73円です。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年8月3日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	23,902,971,425円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	64,959,496
公 社 債(評価額)	23,420,342,424
未 収 入 金	231,863,514
未 収 利 息	124,863,994
前 払 費 用	60,941,997
(B) 負 債	256,469,182
未 払 金	248,989,098
未 払 解 約 金	7,480,084
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	23,646,502,243
元 本	17,944,845,868
次 期 繰 越 損 益 金	5,701,656,375
(D) 受 益 権 総 口 数	17,944,845,868口
1万口当り基準価額(C/D)	13,177円

<注記事項>

期首元本額	13,767,117,428円
期中追加設定元本額	19,255,993,192円
期中一部解約元本額	15,078,264,752円

期末における元本の内訳

JDFインデックス・ファンド外国債券V A(適格機関投資家専用)	2,428,742,842円
iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド	377,945,367円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(適格機関投資家限定)	8,190,290,740円
ブラックロックLifePathファンド2055	49,626,593円
ブラックロックLifePathファンド2045	125,886,377円
ブラックロックLifePathファンド2035	332,735,476円
ブラックロック・つみたて・グローバルバランスファンド	570,827,128円
ブラックロックLifePathファンド2030	268,593,383円
ブラックロックLifePathファンド2040	198,169,733円
ブラックロックLifePathファンド2050	37,941,471円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型/適格機関投資家限定)	1,855,259,596円
ブラックロックLifePathファンド2025	179,317,941円
マルチ・アセット投資戦略ファンド3(適格機関投資家限定)	3,325,689,029円
ブラックロックLifePathファンド2060	830,351円
ブラックロックLifePathファンド2065	2,989,841円
合計	17,944,845,868円

■損益の状況

自2019年8月3日 至2020年8月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	423,362,841円
受 取 利 息	423,430,497
支 払 利 息	△ 67,656
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,070,227,815
売 買 益	1,523,419,912
売 買 損	△ 453,192,097
(C) そ の 他 費 用	△ 3,957,490
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,489,633,166
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,852,538,803
(F) 解 約 差 損 益 金	△3,630,295,685
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,989,780,091
(H) 合 計(D+E+F+G)	5,701,656,375
次 期 繰 越 損 益 金(H)	5,701,656,375

- (注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。
(注3) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。