

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（2010年4月28日設定）	
運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA外国債券インデックスマザーファンド」に投資します。	
主要投資対象	東京海上セレクション・外国債券インデックス	主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか外国の公社債等に直接投資することがあります。
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	主として外国の公社債に投資します。
投資制限	東京海上セレクション・外国債券インデックス	・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%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。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。 収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

東京海上セレクション・外国債券インデックス

第11期 運用報告書（全体版）

（決算日 2021年4月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「東京海上セレクション・外国債券インデックス」は、このたび、第11期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1－8－2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口
東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016
受付時間：営業日の9時～17時
<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。
また、一印は組み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 (分配落)	価 額			ベ ン チ マ ー ク	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落 中 率				
	円		円	%		%		百万円
7 期(2017年 4 月17日)	12,853		0	△5.0	244.096	△4.7	98.8	619
8 期(2018年 4 月16日)	13,840		0	7.7	263.212	7.8	98.4	1,668
9 期(2019年 4 月15日)	14,137		0	2.1	269.451	2.4	98.2	2,646
10期(2020年 4 月15日)	14,500		0	2.6	277.171	2.9	98.1	3,999
11期(2021年 4 月15日)	15,276		0	5.4	292.944	5.7	99.0	5,462

(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」は実質比率を記載しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		ベ ン チ マ ー ク	債 券 組 入 比 率
		騰 落	率		
(期 首)	円		%		%
2020年 4 月15日	14,500	—	—	277.171	98.1
4 月末	14,495	△0.0	—	277.083	98.2
5 月末	14,705	1.4	—	281.271	97.7
6 月末	14,937	3.0	—	285.877	97.5
7 月末	15,082	4.0	—	288.729	98.7
8 月末	15,062	3.9	—	288.410	98.5
9 月末	15,126	4.3	—	289.800	98.5
10月末	14,898	2.7	—	285.441	98.0
11月末	15,053	3.8	—	288.333	98.0
12月末	15,177	4.7	—	290.769	99.0
2021年 1 月末	15,154	4.5	—	290.443	98.4
2 月末	15,014	3.5	—	287.771	98.6
3 月末	15,342	5.8	—	294.185	98.8
(期 末)					
2021年 4 月15日	15,276	5.4	—	292.944	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

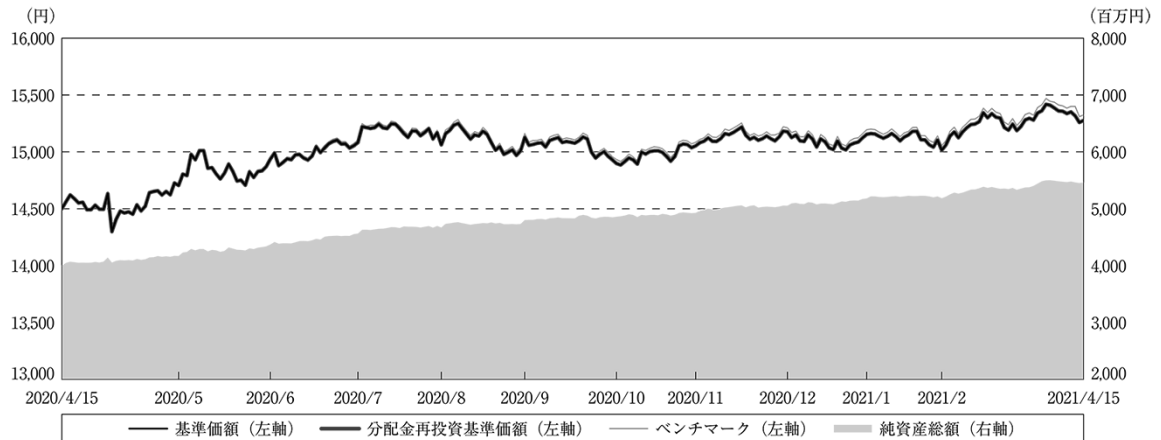
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。
FTSE世界国債インデックスは、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。

○運用経過

(2020年4月16日～2021年4月15日)

■期中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、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。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2020年4月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・債券の利息収入
- ・世界的な景気回復などを背景とした円安の進行

マイナス要因

- ・世界的な景気回復に伴う欧米の国債利回りの上昇（債券価格の下落）

■投資環境

【外国債券市場】

米国債利回りは上昇しました。

期初、新型コロナウイルスの感染拡大が落ち着き、経済活動再開の動きや経済指標が事前予想を上回ったことを受けて米国債利回りは上昇基調で推移しました。期中、新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて米国債利回りは低下する場面もありましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）による緩和的な金融政策が継続したことやバイデン米大統領による大規模な財政支援策の成立、新型コロナウイルスのワクチン普及への期待などを背景にリスク選好の動きが広がり、大幅に上昇しました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。

期初、欧州各国で経済活動が段階的に再開されたことなどを受けてドイツ国債利回りは上昇する場面もありましたが、その後は新型コロナウイルスの感染再拡大や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念からドイツ国債利回りは低下基調で推移しました。期末にかけてはBOE（英イングランド銀行）が景気に対して強気の見通しを示しマイナス金利の導入観測が後退したことや、新型コロナウイルスのワクチン接種進展による景気回復期待が高まったことなどから、ドイツ国債利回りは上昇基調となり、前期末対比上昇して期を終えました。

【外国為替市場動向】

米ドル円相場は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景にFRBが2023年末までゼロ金利政策を維持する方針を表明したことなどを受けて、期初から期央にかけて円高米ドル安が進行しました。期後半は、米国の大規模な財政支援策や新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による景気回復期待などを背景に投資家のリスク選好度が高まるなか円安米ドル高が進行し、前期末対比円安米ドル高の水準で期を終えました。

ユーロ円相場は、欧州復興基金の設立が好感されたことや欧州の経済指標が良好であったことを受けて、円安ユーロ高が進行しました。

■ポートフォリオについて

<東京海上セレクション・外国債券インデックス>

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、5.4%上昇しました。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

以上のような運用の結果、基準価額は5.6%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+5.4%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

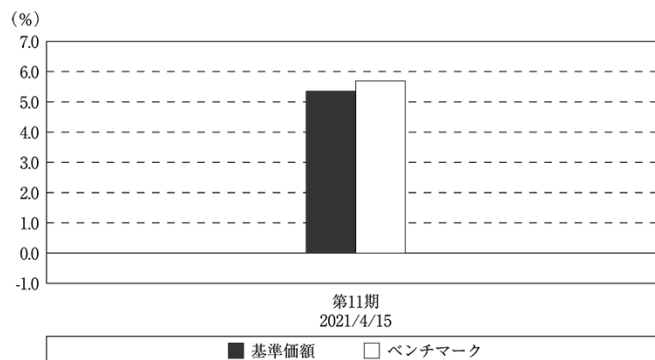
プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・取引および信託報酬などのコスト

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

■分配金

当期においては、当ファンドが確定拠出年金向けに設定されたファンドであるという性格を鑑み、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第11期
	2020年4月16日～ 2021年4月15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	6,288

(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四捨五入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

<東京海上セレクション・外国債券インデックス>

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

ファンドの基本方針に基づき、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 4 月16日～2021年 4 月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 30	% 0.198	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(15)	(0.102)	* 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0.074)	* 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	3	0.023	(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)	(3)	(0.018)	* 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	* 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	* その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	33	0.221	
期中の平均基準価額は、15,003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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

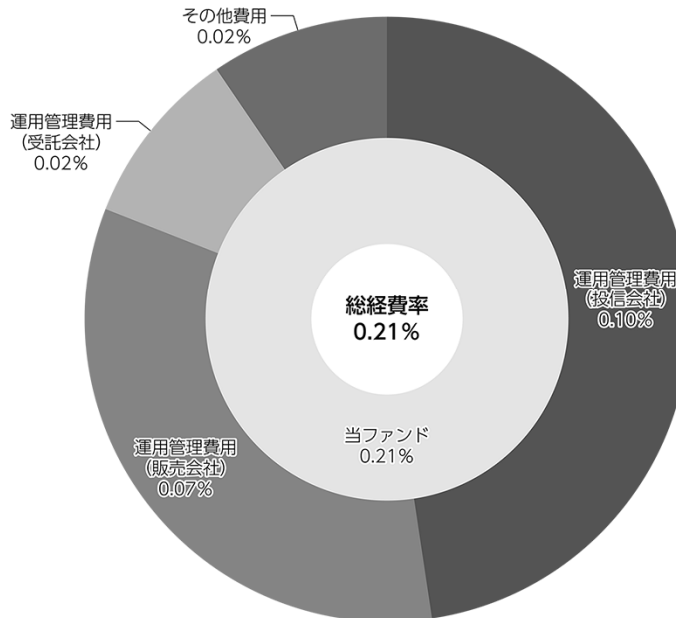
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、売買委託手数料およ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0.21%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2020年4月16日～2021年4月15日)

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
TMA外国債券インデックスマザーファンド	1, 356, 534	2, 263, 203	626, 526	1, 044, 399

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月16日～2021年4月15日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2021年4月15日現在)

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
TMA外国債券インデックスマザーファンド	2, 484, 188	3, 214, 196	5, 462, 205

○投資信託財産の構成

(2021年4月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	5, 462, 205	99. 8
コール・ローン等、その他	11, 662	0. 2
投資信託財産総額	5, 473, 867	100. 0

(注) TMA外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純資産(8,065,165千円)の投資信託財産総額(8,091,843千円)に対する比率は99.7%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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル＝108.91円、1カナダドル＝87.07円、1メキシコペソ＝5.4253円、1ユーロ＝130.56円、1英ポンド＝150.21円、1スウェーデンクローナ＝12.87円、1ノルウェークローネ＝12.97円、1デンマーククローネ＝17.56円、1ポーランドズロチ＝28.6553円、1豪ドル＝84.30円、1シンガポールドル＝81.59円、1マレーシアリングット＝26.4148円、1イスラエルシェケル＝33.1857円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年4月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,473,867,688
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,462,205,314
未収入金	11,662,374
(B) 負債	11,662,374
未払解約金	6,466,772
未払信託報酬	5,055,268
その他未払費用	140,334
(C) 純資産総額(A－B)	5,462,205,314
元本	3,575,728,933
次期繰越損益金	1,886,476,381
(D) 受益権総口数	3,575,728,933口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,276円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,758,054,423円、期中追加設定元本額は1,507,582,676円、期中一部解約元本額は689,908,166円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2020年4月16日～2021年4月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	216,089,495
売買益	257,029,991
売買損	△ 40,940,496
(B) 信託報酬等	△ 9,735,678
(C) 当期損益金(A＋B)	206,353,817
(D) 前期繰越損益金	113,295,524
(E) 追加信託差損益金	1,566,827,040
(配当等相当額)	(1,925,715,429)
(売買損益相当額)	(△ 358,888,389)
(F) 計(C＋D＋E)	1,886,476,381
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	1,886,476,381
追加信託差損益金	1,566,827,040
(配当等相当額)	(1,928,879,254)
(売買損益相当額)	(△ 362,052,214)
分配準備積立金	319,649,341

(注) (A)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) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	84,869,708円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	103,837,219円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,928,879,254円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	130,942,414円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	2,248,528,595円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,288円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2021年4月15日現在)

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、TMA外国債券インデックスマザーファンド全体(4,752,043千円)の内容です。

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80%以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	31,450	32,489	3,538,390	43.8	—	18.9	17.1	7.8
カナダ	千カナダドル 1,700	千カナダドル 1,765	153,734	1.9	—	0.9	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 10,500	千メキシコペソ 11,318	61,406	0.8	—	0.4	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	4,000	4,601	600,824	7.4	—	4.4	1.8	1.2
イタリア	4,900	5,785	755,419	9.4	—	5.8	2.6	1.0
フランス	5,500	6,463	843,930	10.5	—	7.0	2.2	1.2
オランダ	900	1,196	156,269	1.9	—	1.6	0.2	0.2
スペイン	3,100	3,643	475,716	5.9	—	4.2	1.5	0.2
ベルギー	1,200	1,512	197,524	2.4	—	1.9	0.3	0.2
オーストリア	800	971	126,832	1.6	—	1.2	0.2	0.2
フィンランド	400	447	58,468	0.7	—	0.5	0.2	—
アイルランド	500	559	73,043	0.9	—	0.7	0.2	—
イギリス	千英ポンド 2,740	千英ポンド 3,497	525,313	6.5	—	5.0	1.0	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,800	千スウェーデンクローナ 1,973	25,400	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,300	千ノルウェークローネ 1,343	17,430	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,800	千デンマーククローネ 2,171	38,123	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,700	千ポーランドズロチ 1,796	51,485	0.6	—	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千豪ドル 2,100	千豪ドル 2,220	187,193	2.3	—	1.6	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 400	千シンガポールドル 436	35,578	0.4	—	0.4	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 1,400	千マレーシアリンギット 1,460	38,587	0.5	—	0.4	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 800	千イスラエルシェケル 935	31,044	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	7,991,718	99.0	—	56.3	29.4	13.2

(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で邦貨換算したものです。

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

(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	利率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
		% 千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	96	10,483	2027/4/30
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	192	20,937	2027/5/31
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	95	10,443	2027/6/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	200	191	20,817	2027/8/31
T 0 1/2 10/31/27	0.5	100	95	10,374	2027/10/31
T 0 1/4 04/15/23	0.25	100	100	10,905	2023/4/15
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	196	21,405	2025/5/31
T 0 1/4 06/15/23	0.25	300	300	32,707	2023/6/15
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	294	32,073	2025/6/30
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	98	10,677	2025/7/31
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	293	31,982	2025/8/31
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	195	21,302	2025/9/30
T 0 1/4 10/31/25	0.25	200	195	21,268	2025/10/31
T 0 1/8 02/15/24	0.125	100	99	10,831	2024/2/15
T 0 1/8 04/30/22	0.125	100	100	10,893	2022/4/30
T 0 1/8 05/15/23	0.125	200	199	21,755	2023/5/15
T 0 1/8 05/31/22	0.125	100	100	10,893	2022/5/31
T 0 1/8 06/30/22	0.125	200	199	21,777	2022/6/30
T 0 1/8 07/15/23	0.125	200	199	21,739	2023/7/15
T 0 1/8 07/31/22	0.125	300	299	32,666	2022/7/31
T 0 1/8 08/15/23	0.125	100	99	10,865	2023/8/15
T 0 1/8 09/15/23	0.125	100	99	10,861	2023/9/15
T 0 1/8 09/30/22	0.125	400	399	43,548	2022/9/30
T 0 1/8 10/15/23	0.125	600	598	65,134	2023/10/15
T 0 1/8 12/15/23	0.125	600	597	65,067	2023/12/15
T 0 1/8 12/31/22	0.125	100	99	10,883	2022/12/31
T 0 3/8 01/31/26	0.375	500	489	53,257	2026/1/31
T 0 3/8 03/31/22	0.375	300	300	32,761	2022/3/31
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	98	10,772	2025/4/30
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	189	20,690	2027/7/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	400	378	41,229	2027/9/30
T 0 3/8 12/31/25	0.375	100	97	10,666	2025/12/31
T 0 5/8 05/15/30	0.625	400	367	40,024	2030/5/15
T 0 5/8 08/15/30	0.625	200	183	19,933	2030/8/15
T 0 5/8 11/30/27	0.625	300	287	31,335	2027/11/30
T 0 7/8 11/15/30	0.875	200	186	20,348	2030/11/15
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	204	22,311	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	500	498	54,240	2030/2/15
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	102	11,163	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	102	11,173	2023/3/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	400	407	44,399	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	103	11,269	2024/9/30
T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	310	33,806	2024/10/31
T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	206	22,534	2024/11/30
T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	154	16,781	2050/5/15
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	102	11,148	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	300	307	33,529	2024/8/31
T 1 1/8 02/15/31	1.125	200	190	20,770	2031/2/15

銘柄	利率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
		% 千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 1 1/8 02/28/22	1.125	100	100	10,988	2022/2/28
T 1 1/8 02/28/25	1.125	300	305	33,323	2025/2/28
T 1 1/8 02/29/28	1.125	300	296	32,293	2028/2/29
T 1 1/8 05/15/40	1.125	200	165	18,069	2040/5/15
T 1 1/8 08/15/40	1.125	100	82	8,999	2040/8/15
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	308	33,598	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	507	55,242	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	407	44,346	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	516	56,205	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	312	34,070	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	204	22,289	2022/9/30
T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	306	33,329	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/24	1.75	500	521	56,843	2024/12/31
T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	311	33,958	2026/12/31
T 1 3/8 01/31/25	1.375	200	205	22,430	2025/1/31
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	204	22,267	2023/2/15
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	159	17,338	2050/8/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	101	11,090	2022/10/15
T 1 3/8 11/15/40	1.375	100	86	9,410	2040/11/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	622	67,770	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	207	22,563	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	510	55,553	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	202	22,031	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	206	22,506	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/22	1.625	100	102	11,144	2022/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	300	309	33,725	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	102	11,159	2022/12/15
T 1 7/8 02/15/41	1.875	200	188	20,570	2041/2/15
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	203	22,121	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	104	11,411	2026/7/31
T 2 02/15/22	2.0	200	203	22,132	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	310	33,774	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	210	22,962	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	500	466	50,772	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	105	11,437	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	844	91,947	2025/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	212	23,101	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	103	11,304	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	532	58,009	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	103	11,304	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	315	34,403	2023/8/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	106	11,601	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	197	21,533	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	100	98	10,737	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	848	92,440	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	425	46,346	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	318	34,635	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	105	11,471	2026/11/15

銘柄	利率	当 期 末			
		額面金額	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 2 11/30/22	2.0	400	411	44,859	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	658	71,673	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	105	11,521	2023/7/31
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	638	69,522	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	217	23,715	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	107	11,692	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	106	11,652	2029/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	212	23,163	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	100	101	11,031	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	108	11,810	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	108	11,861	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	107	11,745	2025/3/31
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	110	12,038	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	111	12,090	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	218	23,747	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	109	11,891	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	110	12,047	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	111	12,100	2045/8/15
T 3 02/15/47	3.0	300	341	37,205	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	300	342	37,282	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	457	49,819	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	113	12,406	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	114	12,432	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	115	12,575	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	116	12,707	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	347	37,792	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	225	24,507	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	115	12,571	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	340	37,108	2045/11/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	100	122	13,307	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	124	13,595	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	124	13,566	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	255	27,814	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	133	14,585	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	142	15,512	2041/2/15
T 4 3/8 02/15/38	4.375	100	133	14,577	2038/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	135	14,773	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	200	270	29,466	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	70	7,731	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	134	14,665	2031/2/15
US TREASURY N/B	0.75	300	289	31,515	2028/1/31
US TREASURY N/B	1.875	200	180	19,683	2051/2/15
小 計				3,538,390	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0 1/2 09/01/25	0.5	100	98	8,581	2025/9/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	100	90	7,917	2030/12/1
CAN 0 1/4 05/01/23	0.25	100	99	8,701	2023/5/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	99	8,653	2027/6/1

銘柄	利率	当 期 末			
		額面金額	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	償還年月日
(カナダ)	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券					
CAN 1 09/01/22	1.0	200	202	17,605	2022/9/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	102	8,934	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	102	8,935	2026/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	102	8,893	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	98	8,541	2030/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	103	9,047	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	106	9,248	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	106	9,311	2029/6/1
CAN 2 12/01/51	2.0	100	101	8,794	2051/12/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	102	8,958	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	117	10,212	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	130	11,399	2045/12/1
小 計				153,734	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	253	1,373	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	691	3,749	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	800	800	4,344	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	612	3,322	2022/6/9
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	103	561	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,830	9,932	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	324	1,760	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	700	712	3,862	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	212	1,155	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,402	7,611	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,702	9,236	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	400	442	2,401	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	600	621	3,372	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,500	1,607	8,722	2023/12/7
小 計				61,406	
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 0 03/10/23	—	300	304	39,691	2023/3/10
BKO 0 09/16/22	—	100	100	13,183	2022/9/16
DBR 0 02/15/30	—	100	103	13,461	2030/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	100	13,105	2035/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	103	13,481	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	103	13,479	2029/8/15
DBR 0 08/15/30	—	200	205	26,863	2030/8/15
DBR 0 08/15/50	—	100	92	12,061	2050/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	104	13,659	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	105	13,782	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	104	13,691	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	105	13,759	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	316	41,259	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	100	103	13,500	2027/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	107	14,010	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	104	13,590	2023/2/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	103	13,459	2022/9/4

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額 千ユーロ	邦貨換算金額 千円	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券					
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	126	16,497	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	103	13,448	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	153	20,102	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	157	20,507	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	166	21,741	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	163	21,386	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	165	21,632	2034/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	177	23,129	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	157	20,601	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	144	18,916	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	200	204	26,666	2024/4/5
OBL 0 04/11/25	—	200	205	26,817	2025/4/11
OBL 0 10/13/23	—	200	203	26,586	2023/10/13
OBL 0 10/18/24	—	200	204	26,748	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0 1/2 02/01/26	0.5	100	101	13,310	2026/2/1
BTPS 0.3 08/15/23	0.3	300	304	39,692	2023/8/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	200	203	26,506	2025/2/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	200	207	27,028	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	102	13,362	2023/3/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	100	102	13,347	2030/8/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	106	13,874	2025/6/1
BTPS 1 3/4 07/01/24	1.75	100	106	13,853	2024/7/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	300	305	39,857	2022/4/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	105	13,784	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	214	28,049	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	108	14,117	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	100	108	14,152	2030/12/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	100	107	14,065	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	110	14,464	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	114	14,928	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	109	14,231	2025/12/1
BTPS 2.45 09/01/50	2.45	100	115	15,062	2050/9/1
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	121	15,801	2047/3/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	124	16,287	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	239	31,227	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	124	16,254	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	132	17,270	2046/9/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	113	14,768	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	128	16,776	2035/3/1
BTPS 3.45 03/01/48	3.45	100	137	17,948	2048/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	138	18,123	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	113	14,814	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	109	14,340	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	111	14,579	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	130	17,088	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	161	21,027	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	148	19,364	2034/8/1

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…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	158	20,668	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	159	20,846	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	218	28,462	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	153	20,048	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	150	19,654	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	139	18,236	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	138	18,137	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	300	303	39,646	2023/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	200	204	26,698	2026/2/25
FRTR 0 03/25/23	—	100	100	13,160	2023/3/25
FRTR 0 03/25/24	—	200	203	26,588	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	300	306	40,037	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	105	13,714	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	200	198	25,937	2040/5/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	201	26,336	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	100	99	12,985	2030/11/25
FRTR 0 3/4 05/25/52	0.75	100	97	12,689	2052/5/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	320	41,792	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	325	42,460	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	229	30,020	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	118	15,409	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	224	29,258	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	200	227	29,681	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	107	13,975	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	105	13,724	2023/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	121	15,825	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	217	28,335	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	129	16,843	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	247	32,292	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	313	40,914	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	240	31,417	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	157	20,615	2045/5/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	193	25,230	2055/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	160	20,991	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	162	21,210	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	112	14,690	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	292	38,201	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	200	330	43,139	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	130	16,975	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	177	23,128	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/27	—	100	101	13,219	2027/1/15
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	105	13,754	2026/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	108	14,195	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	130	17,017	2033/1/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	161	21,128	2047/1/15

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	173	22,588 2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	161	21,073 2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	140	18,342 2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	114	14,950 2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券				
SPGB 0 01/31/25	—	200	202	26,446 2025/1/31
SPGB 0 04/30/23	—	100	100	13,183 2023/4/30
SPGB 0 05/31/24	—	100	100	13,180 2024/5/31
SPGB 0.35 07/30/23	0.35	100	101	13,308 2023/7/30
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	101	13,219 2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	102	13,428 2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	211	27,555 2027/7/30
SPGB 1 1/4 10/31/30	1.25	100	108	14,206 2030/10/31
SPGB 1 10/31/50	1.0	100	91	11,944 2050/10/31
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	103	13,460 2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	107	14,093 2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	109	14,322 2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	109	14,309 2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	114	14,962 2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	111	14,496 2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	230	30,114 2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	111	14,517 2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	111	14,514 2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	120	15,725 2033/7/30
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	136	17,844 2046/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	150	19,627 2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	112	14,689 2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	167	21,904 2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	114	14,949 2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	168	21,979 2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	158	20,633 2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	138	18,049 2028/10/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	145	19,047 2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券				
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	103	13,455 2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	13,338 2023/10/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	106	13,888 2027/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	107	14,057 2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	110	14,383 2031/6/22
BGB 1 1/4 04/22/33	1.25	100	111	14,608 2033/4/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	120	15,703 2047/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	168	21,947 2045/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	169	22,171 2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	107	13,993 2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	165	21,548 2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	141	18,427 2028/3/28

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…オーストリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円
RAGB 0 09/20/22	—	100	100	13,178 2022/9/20
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	105	13,811 2029/2/20
RAGB 0 1/2 04/20/27	0.5	100	105	13,792 2027/4/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	106	13,934 2026/10/20
RAGB 1 1/2 02/20/47	1.5	100	124	16,193 2047/2/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	106	13,844 2023/10/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	160	20,962 2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	161	21,114 2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券				
RFGB 0 1/2 09/15/28	0.5	100	106	13,869 2028/9/15
RFGB 0 3/4 04/15/31	0.75	100	108	14,169 2031/4/15
RFGB 1 1/8 04/15/34	1.125	100	113	14,801 2034/4/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	100	119	15,628 2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券				
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	102	13,321 2030/10/18
IRISH 1 05/15/26	1.0	100	107	13,998 2026/5/15
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	113	14,830 2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	113	14,770 2031/3/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	123	16,122 2025/3/13
ユ ー ロ 計				3,288,028
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド	
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	98	14,849 2026/1/30
UKT 0 1/8 01/31/23	0.125	100	100	15,034 2023/1/31
UKT 0 5/8 06/07/25	0.625	100	101	15,249 2025/6/7
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	82	12,394 2050/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	102	15,410 2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	103	15,551 2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	104	15,708 2027/7/22
UKT 1 1/4 10/22/41	1.25	100	99	14,882 2041/10/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	200	204	30,763 2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	108	16,228 2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	107	16,122 2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	107	16,153 2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	105	15,800 2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	144	21,681 2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	182	27,370 2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	138	20,856 2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	162	24,376 2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	160	24,107 2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	142	21,443 2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	100	149	22,529 2039/9/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	37	5,602 2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	152	22,861 2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	163	24,505 2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	169	25,487 2049/12/7
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	100	182	27,453 2055/12/7

銘柄		当 期 末			
		利率	額面金額	評価額 外貨建金額 邦貨換算金額	償還年月日
(イギリス) 国債証券		%	千英ポンド	千英ポンド 千円	
UKT 4 3/4 12/07/30		4.75	100	136 20,509	2030/12/7
UKT 4.25 06/07/32		4.25	100	135 20,279	2032/6/7
UKT 6 12/07/28		6.0	10	13 2,099	2028/12/7
小 計				525,313	
(スウェーデン) 国債証券			千クローナ	千クローナ	
SGB 0 1/8 05/12/31		0.125	100	97 1,256	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060		0.75	200	208 2,685	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061		0.75	200	208 2,679	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23		1.5	300	313 4,040	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059		1.0	300	317 4,080	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058		2.5	200	221 2,855	2025/5/12
SGB 1 1/2 03/30/39		3.5	200	293 3,772	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22		3.5	300	313 4,028	2022/6/1
小 計				25,400	
(ノルウェー) 国債証券			千ノルウェークローナ	千ノルウェークローナ	
NGB 1 1/2 02/19/26		1.5	100	102 1,328	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27		1.75	100	103 1,344	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25		1.75	200	206 2,684	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29		1.75	100	103 1,338	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30		1.375	200	199 2,586	2030/8/19
NGB 2 04/26/28		2.0	100	105 1,364	2028/4/26
NGB 2 05/24/23		2.0	300	309 4,019	2023/5/24
NGB 3 03/14/24		3.0	200	213 2,764	2024/3/14
小 計				17,430	
(デンマーク) 国債証券			千デンマーククローナ	千デンマーククローナ	
DGB 0 1/2 11/15/27		0.5	300	315 5,546	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29		0.5	400	421 7,406	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/22		0.25	200	202 3,555	2022/11/15
DGB 0 1/4 11/15/52		0.25	100	93 1,646	2052/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23		1.5	200	210 3,698	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25		1.75	200	220 3,868	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39		4.5	400	706 12,400	2039/11/15
小 計				38,123	
(ポーランド) 国債証券			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	
POLGB 0 07/25/22		—	200	199 5,711	2022/7/25
POLGB 0 3/4 04/25/25		0.75	200	201 5,780	2025/4/25
POLGB 1 1/4 10/25/30		1.25	100	97 2,803	2030/10/25
POLGB 2 1/2 01/25/23		2.5	200	208 5,974	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24		2.5	100	106 3,044	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26		2.5	200	217 6,234	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27		2.5	100	109 3,130	2027/7/25
POLGB 2 1/4 10/25/24		2.25	100	106 3,046	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28		2.75	100	109 3,140	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29		2.75	200	221 6,332	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25		3.25	100	111 3,187	2025/7/25

銘柄		当 期 末			
		利率	額面金額	評価額 外貨建金額 邦貨換算金額	償還年月日
(ポーランド) 国債証券		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ 千円	
POLGB 5 3/4 09/23/22		5.75	100	108 3,099	2022/9/23
小 計				51,485	
(オーストラリア) 国債証券			千豪ドル	千豪ドル	
ACGB 0 1/2 09/21/26		0.5	100	98 8,285	2026/9/21
ACGB 0 1/4 11/21/25		0.25	100	98 8,294	2025/11/21
ACGB 1 1/2 06/21/31		1.5	200	195 16,505	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32		1.25	100	94 7,972	2032/5/21
ACGB 1 12/21/30		1.0	100	94 7,945	2030/12/21
ACGB 1 3/4 06/21/51		1.75	100	81 6,837	2051/6/21
ACGB 2 1/2 05/21/30		2.5	100	107 9,093	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28		2.25	100	107 9,025	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24		2.75	200	215 18,204	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27		2.75	200	220 18,628	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29		2.75	100	110 9,286	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47		3.0	100	106 8,990	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25		3.25	100	111 9,373	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29		3.25	100	114 9,650	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33		4.5	100	128 10,824	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26		4.25	100	117 9,904	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23		5.5	100	110 9,345	2023/4/21
ACGB 5 3/4 07/15/22		5.75	100	107 9,025	2022/7/15
小 計				187,193	
(シンガポール) 国債証券			千シンガポールドollar	千シンガポールドollar	
SIGB 2 1/4 08/01/36		2.25	100	104 8,491	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26		2.125	100	105 8,610	2026/6/1
SIGB 3 1/2 03/01/27		3.5	200	226 18,476	2027/3/1
小 計				35,578	
(マレーシア) 国債証券			千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット	
MGS 2.632 04/15/31		2.632	100	95 2,523	2031/4/15
MGS 3.48 03/15/23		3.48	100	102 2,706	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27		3.502	100	103 2,736	2027/5/31
MGS 3.757 05/22/40		3.757	100	95 2,532	2040/5/22
MGS 3.828 07/05/34		3.828	100	100 2,654	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33		3.844	100	99 2,629	2033/4/15
MGS 3.885 08/15/29		3.885	100	105 2,788	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25		3.955	100	105 2,790	2025/9/15
MGS 4.181 07/15/24		4.181	100	105 2,788	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26		4.392	100	108 2,853	2026/4/15
MGS 4.498 04/15/30		4.498	100	110 2,911	2030/4/15
MGS 4.736 03/15/46		4.736	100	105 2,786	2046/3/15
MGS 4.762 04/07/37		4.762	100	108 2,862	2037/4/7
MGS 5.248 09/28		5.248	100	114 3,025	2028/9/15
小 計				38,587	
(イスラエル) 国債証券			千イスラエリシェケル	千イスラエリシェケル	
ILGOV 1 03/31/30		—	100	99 3,296	2030/3/31
ILGOV 1 3/4 08/31/25		—	100	106 3,546	2025/8/31

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	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ILGOV 2 03/31/27	—	200	216	7,175	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	111	3,691	2028/9/28
ILGOV 3 3/4 03/31/47	—	100	130	4,346	2047/3/31
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	108	3,591	2023/3/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	162	5,395	2042/1/31
小 計				31,044	
合 計				7,991,718	

- (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で邦貨換算したものです。
- (注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2020年11月10日）

（計算期間 2019年11月12日～2020年11月10日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。
また、一印は組み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		ベ ン チ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
	円	%		%		百万円
11期(2016年11月10日)	14,050	△11.0	243.067	△10.6	98.6	103,516
12期(2017年11月10日)	15,662	11.5	269.321	10.8	98.6	46,126
13期(2018年11月12日)	15,274	△ 2.5	262.755	△ 2.4	98.9	4,169
14期(2019年11月11日)	15,809	3.5	272.101	3.6	97.7	4,542
15期(2020年11月10日)	16,671	5.5	287.164	5.5	98.8	6,878

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 券	
		騰 落	率	騰 落	率	組 入 比	率
(期 首)	円		%		%		%
2019年11月11日	15,809		—	272.101	—		97.7
11月末	15,989		1.1	275.243	1.2		96.6
12月末	16,061		1.6	276.470	1.6		98.7
2020年1月末	16,197		2.5	278.723	2.4		98.4
2月末	16,387		3.7	281.924	3.6		97.6
3月末	16,394		3.7	282.047	3.7		98.7
4月末	16,094		1.8	277.083	1.8		98.2
5月末	16,330		3.3	281.271	3.4		97.7
6月末	16,591		4.9	285.877	5.1		97.5
7月末	16,754		6.0	288.729	6.1		98.7
8月末	16,735		5.9	288.410	6.0		98.5
9月末	16,809		6.3	289.800	6.5		98.4
10月末	16,559		4.7	285.441	4.9		98.0
(期 末)							
2020年11月10日	16,671		5.5	287.164	5.5		98.8

(注) 騰落率は期首比です。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。
FTSE世界国債インデックスは、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。

○運用経過

(2019年11月12日～2020年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：15,809円

期 末：16,671円

騰落率： 5.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国債を中心に世界的に国債利回りが低下したこと（債券価格は上昇）
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・世界的な景気減速懸念の高まりなどによる円高の進行

■投資環境

【外国債券市場動向】

米国債利回りは低下しました。期前半は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による緊急利下げや無制限での量的緩和により米国債利回りは大きく低下しました。期後半も、2020年7月に米国で新型コロナウイルスの感染拡大ペースが加速したことに加えて、FRBが2%以上の物価上昇率を許容することや2023年までゼロ金利政策の維持を明確にしたことで、米国債利回りは一段と低下しました。期末にかけては、米国の経済指標の改善や米国大統領選挙後の次期政権の財政拡大に対する期待から米国債利回りは上昇基調に転じましたが、期を通してみると低下しました。

ドイツ国債利回りは低下しました。欧州において新型コロナウイルスの感染が拡大し、ユーロ圏の経済指標が悪化したことで、ドイツ国債利回りは大きく低下しました。その後、欧州各国で経済活動が段階的に再開されたことによりドイツ国債利回りは上昇基調で推移する場面もありましたが、欧州での新型コロナウイルスの感染再拡大や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念が高まるなか、ドイツ国債利回りは低下傾向が続き、前期末対比低下した水準で期を終えました。

【外国為替市場動向】

当期、米ドル円相場は円高米ドル安、ユーロ円相場は円安ユーロ高となりました。

期初、米ドル円相場は米中貿易協議の進展に伴い円安米ドル高傾向で推移しましたが、新型コロナウイルスの感染拡大を受けてFRBが緊急利下げや大規模な資産購入を発表すると円高米ドル安が大きく進行しました。また、FRBによる2023年までのゼロ金利政策維持の表明や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大により米ドル安傾向が続き、前期末対比円高米ドル安の水準で期を終えました。

ユーロ円相場は、欧州復興基金の設立などが好感されたほか、対米ドルでユーロ高が進行したこともあり前期末対比円安ユーロ高の水準で期を終えました。



(注) ベンチマークは、期首(2019年11月11日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は5.5%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+5.5%に対して、基準価額の騰落率は+5.5%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

(主な差異要因)

プラス要因

・保有債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

マイナス要因

・取引や保管などに係るコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、10月末現在、推定値で0.10%となっています。

※2020年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するように運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2019年11月12日～2020年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.018	(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)	(0.018)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	3	0.018	
期中の平均基準価額は、16,408円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(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を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2019年11月12日～2020年11月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 14,380	千米ドル 7,240
	カナダ	国債証券	千カナダドル 814	千カナダドル 203
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 5,467	千メキシコペソ 1,013
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	2,767	880
	イタリア	国債証券	2,175	449
	フランス	国債証券	2,376	209
	オランダ	国債証券	407	—
	スペイン	国債証券	1,736	426
	ベルギー	国債証券	570	—
	オーストリア	国債証券	501	256
	フィンランド	国債証券	116	—
	アイルランド	国債証券	217	—
	イギリス	国債証券	千英ポンド 1,492	千英ポンド 375
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 860	千スウェーデンクローナ 211
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 431	千ノルウェークローネ 207
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 827	千デンマーククローネ 207
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 852	千ポーランドズロチ 203
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 1,232	千豪ドル 105
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 224	千シンガポールドル —
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 783	千マレーシアリングgit 102
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 844	千イスラエルシェケル —
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド —	千南アフリカランド 2,909

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

○利害関係人との取引状況等

(2019年11月12日～2020年11月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年11月10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80格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	25,850	27,995	2,945,442	42.8	—	18.9	16.6	7.3
カナダ	千カナダドル 1,600	千カナダドル 1,732	140,031	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 9,700	千メキシコペソ 10,906	56,275	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	3,500	4,208	523,009	7.6	—	4.8	1.9	0.9
イタリア	4,300	5,188	644,811	9.4	—	6.3	2.1	1.0
フランス	4,700	5,769	716,979	10.4	—	7.9	2.0	0.6
オランダ	800	1,064	132,288	1.9	—	1.3	0.4	0.2
スペイン	2,800	3,431	426,418	6.2	—	4.4	1.4	0.4
ベルギー	1,100	1,458	181,249	2.6	—	2.1	0.4	0.2
オーストリア	600	767	95,352	1.4	—	1.0	0.2	0.2
フィンランド	300	348	43,259	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	400	463	57,646	0.8	—	0.6	0.2	—
イギリス	千英ポンド 2,340	千英ポンド 3,185	441,268	6.4	—	5.4	0.6	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,600	千スウェーデンクローナ 1,759	21,452	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,100	千ノルウェークローネ 1,172	13,618	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,600	千デンマーククローネ 2,039	34,034	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,400	千ポーランドズロチ 1,512	41,881	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル 2,100	千豪ドル 2,388	182,864	2.7	—	1.9	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 400	千シンガポールドル 461	36,043	0.5	—	0.5	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 1,300	千マレーシアリンギット 1,415	36,203	0.5	—	0.4	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 700	千イスラエルシェケル 834	26,057	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	6,796,189	98.8	—	58.4	28.2	12.2

(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で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です。

(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	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	99	10,423	2027/4/30
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	197	20,826	2027/5/31
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	98	10,404	2027/6/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	200	197	20,774	2027/8/31
T 0 1/4 04/15/23	0.25	100	100	10,528	2023/4/15
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	198	20,895	2025/5/31
T 0 1/4 06/15/23	0.25	200	200	21,048	2023/6/15
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	297	31,321	2025/6/30
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	99	10,435	2025/7/31
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	297	31,289	2025/8/31
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	198	20,846	2025/9/30
T 0 1/8 04/30/22	0.125	100	99	10,512	2022/4/30
T 0 1/8 05/15/23	0.125	200	199	20,991	2023/5/15
T 0 1/8 05/31/22	0.125	100	99	10,510	2022/5/31
T 0 1/8 06/30/22	0.125	200	199	21,018	2022/6/30
T 0 1/8 07/15/23	0.125	200	199	20,977	2023/7/15
T 0 1/8 07/31/22	0.125	300	299	31,528	2022/7/31
T 0 1/8 08/15/23	0.125	100	99	10,486	2023/8/15
T 0 1/8 09/15/23	0.125	100	99	10,482	2023/9/15
T 0 1/8 09/30/22	0.125	200	199	21,015	2022/9/30
T 0 1/8 10/15/23	0.125	300	298	31,449	2023/10/15
T 0 3/8 03/31/22	0.375	300	300	31,649	2022/3/31
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	99	10,511	2025/4/30
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	196	20,622	2027/7/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	200	195	20,581	2027/9/30
T 0 5/8 05/15/30	0.625	300	291	30,677	2030/5/15
T 0 5/8 08/15/30	0.625	200	193	20,392	2030/8/15
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	210	22,181	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	300	315	33,227	2030/2/15
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	102	10,830	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	103	10,841	2023/3/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	200	204	21,548	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	104	10,994	2024/9/30
T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	313	33,000	2024/10/31
T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	209	22,013	2024/11/30
T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	176	18,610	2050/5/15
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	102	10,811	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	100	103	10,887	2024/8/31
T 1 1/8 02/28/22	1.125	100	101	10,651	2022/2/28
T 1 1/8 05/15/40	1.125	100	93	9,850	2040/5/15
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	310	32,643	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	510	53,685	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	409	43,080	2022/5/15

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	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	519	54,610	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	315	33,229	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	205	21,658	2022/9/30
T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	322	33,947	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/24	1.75	200	211	22,242	2024/12/31
T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	320	33,757	2026/12/31
T 1 3/8 01/31/22	1.375	300	304	32,026	2022/1/31
T 1 3/8 01/31/25	1.375	100	104	10,964	2025/1/31
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	205	21,591	2023/2/15
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	182	19,218	2050/8/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	102	10,760	2022/10/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	635	66,854	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	211	22,301	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	512	53,940	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	212	22,398	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	212	22,330	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/22	1.625	100	102	10,822	2022/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	200	212	22,335	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	102	10,834	2022/12/15
T 1 5/8 12/31/21	1.625	500	508	53,480	2021/12/31
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	204	21,507	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	107	11,307	2026/7/31
T 2 02/15/22	2.0	500	511	53,825	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	312	32,832	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	213	22,483	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	100	106	11,181	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	106	11,164	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	859	90,388	2025/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	214	22,551	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	117	12,351	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	538	56,636	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	117	12,362	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	318	33,530	2023/8/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	110	11,616	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	224	23,593	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	100	112	11,787	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	860	90,546	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	442	46,542	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	323	34,004	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	108	11,402	2026/11/15
T 2 11/30/22	2.0	400	414	43,635	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	685	72,165	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	106	11,239	2023/7/31

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)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	645	67,880	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	244	25,709	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	111	11,685	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	112	11,846	2029/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	215	22,661	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	100	115	12,101	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	111	11,687	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	114	12,036	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	109	11,543	2025/3/31
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	115	12,152	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	124	13,119	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	222	23,387	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	111	11,728	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	115	12,182	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	125	13,165	2045/8/15
T 3 02/15/47	3.0	300	385	40,583	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	200	257	27,126	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	517	54,485	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	128	13,535	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	129	13,589	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	129	13,622	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	131	13,873	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	389	40,985	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	236	24,836	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	129	13,588	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	383	40,371	2045/11/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	100	137	14,517	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	139	14,695	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	139	14,665	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	283	29,845	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	148	15,654	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	158	16,638	2041/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	150	15,834	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	149	15,776	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	77	8,201	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	143	15,105	2031/2/15
小 計				2,945,442	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0 1/2 03/01/22	0.5	100	100	8,110	2022/3/1
CAN 0 1/2 09/01/25	0.5	100	100	8,089	2025/9/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	100	98	7,952	2030/12/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	103	8,386	2027/6/1
CAN 1 09/01/22	1.0	200	202	16,385	2022/9/1

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					
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	103	8,335	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	105	8,525	2026/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	103	8,366	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	104	8,437	2030/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	104	8,464	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	107	8,696	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	112	9,128	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	103	8,397	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	133	10,791	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	148	11,963	2045/12/1
小 計				140,031	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	267	1,377	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	714	3,687	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	410	2,119	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	619	3,196	2022/6/9
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	105	542	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,892	9,764	2027/6/3
MBONO 7 1/4 12/09/21	7.25	100	103	532	2021/12/9
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	339	1,752	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	437	2,256	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	225	1,161	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,445	7,458	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,777	9,174	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	400	471	2,431	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	400	450	2,326	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,500	1,646	8,494	2023/12/7
小 計				56,275	
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 0 03/11/22	—	200	201	25,090	2022/3/11
BKO 0 09/16/22	—	100	101	12,597	2022/9/16
DBR 0 02/15/30	—	100	105	13,071	2030/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	104	12,999	2035/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	104	12,951	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	105	13,073	2029/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	105	13,104	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	106	13,250	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	106	13,183	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	107	13,331	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	321	39,902	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	100	104	13,004	2027/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	108	13,482	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	105	13,071	2023/2/15

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	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	104	12,937	2022/9/4
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	137	17,140	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	104	12,939	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	165	20,513	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	169	21,027	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	177	22,058	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	172	21,384	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	172	21,474	2034/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	187	23,263	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	163	20,263	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	149	18,531	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	200	205	25,505	2024/4/5
OBL 0 04/11/25	—	100	103	12,838	2025/4/11
OBL 0 10/13/23	—	200	204	25,420	2023/10/13
OBL 0 10/18/24	—	200	205	25,595	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.3 08/15/23	0.3	200	202	25,224	2023/8/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	100	101	12,605	2025/2/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	200	206	25,684	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	102	12,781	2023/3/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	100	102	12,752	2030/8/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	106	13,244	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	200	204	25,458	2022/4/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	106	13,173	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	215	26,772	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	108	13,544	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	100	109	13,552	2030/12/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	100	108	13,437	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	111	13,816	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	116	14,455	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	109	13,603	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	102	12,783	2021/12/15
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	125	15,563	2047/3/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	127	15,807	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	241	29,983	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	125	15,648	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	136	17,007	2046/9/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	114	14,236	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	130	16,228	2035/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	141	17,571	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	115	14,339	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	111	13,903	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	113	14,136	2023/8/1

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…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	132	16,458	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	165	20,564	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	151	18,766	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	161	20,114	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	163	20,320	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	223	27,724	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	155	19,382	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	152	18,969	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	141	17,621	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	141	17,571	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	200	203	25,235	2023/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	200	206	25,615	2026/2/25
FRTR 0 03/25/24	—	100	102	12,710	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	200	205	25,559	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	106	13,178	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	100	106	13,177	2040/5/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	206	25,604	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	100	101	12,674	2030/11/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	324	40,364	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	330	41,035	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	237	29,486	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	130	16,198	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	234	29,126	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	119	14,826	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	108	13,452	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	106	13,203	2023/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	129	16,032	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	219	27,299	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	141	17,564	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	254	31,654	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	317	39,441	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	245	30,505	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	170	21,135	2045/5/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	213	26,469	2055/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	170	21,190	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	170	21,193	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	114	14,264	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	301	37,507	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	172	21,403	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	133	16,581	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	187	23,288	2041/4/25

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…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHER 0 01/15/22	—	100	100	12,532	2022/1/15
NETHER 0 01/15/27	—	100	102	12,704	2027/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	110	13,673	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	135	16,817	2033/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	184	22,870	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	169	21,057	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	144	17,952	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	118	14,681	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	200	203	25,241	2025/1/31
SPGB 0 04/30/23	—	100	101	12,581	2023/4/30
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	101	12,673	2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	104	12,994	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	213	26,483	2027/7/30
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	110	13,747	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	109	13,572	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	111	13,816	2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	110	13,765	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	119	14,791	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	112	13,954	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	234	29,178	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	112	14,005	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	112	14,015	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	124	15,464	2033/7/30
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	145	18,101	2046/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	157	19,515	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	114	14,260	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	175	21,861	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	117	14,552	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	177	22,070	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	163	20,273	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	141	17,550	2028/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	107	13,403	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	149	18,543	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	103	12,905	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	12,749	2023/10/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	107	13,391	2027/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	108	13,537	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	113	14,077	2031/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	134	16,680	2047/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	180	22,443	2045/6/22

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	
(ユーロ…ベルギー) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	179	22,357	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	109	13,596	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	173	21,516	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	144	17,994	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	—	100	101	12,594	2022/9/20
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	108	13,422	2029/2/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	108	13,435	2026/10/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	107	13,337	2023/10/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	172	21,442	2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	169	21,119	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	108	13,427	2028/9/15
RFBG 1 1/8 04/15/34	1.125	100	118	14,675	2034/4/15
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	121	15,157	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	104	12,956	2030/10/18
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	117	14,643	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	115	14,369	2031/3/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	126	15,676	2025/3/13
ユ ー ロ 計				2,821,015	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	100	13,868	2026/1/30
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	90	12,601	2050/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	103	14,335	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	112	15,577	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	107	14,857	2027/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	200	206	28,587	2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	114	15,928	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	111	15,375	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	109	15,169	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	106	14,741	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	154	21,467	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	200	27,802	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	148	20,520	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	176	24,448	2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	171	23,794	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	151	20,956	2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	100	159	22,111	2039/9/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	38	5,352	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	162	22,477	2040/12/7

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千英ポンド	千英ポンド	千円	
(イギリス) 国債証券	%				
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	175	24,358	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	183	25,411	2049/12/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	143	19,823	2030/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	142	19,679	2032/6/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,018	2028/12/7
小 計				441,268	
(スウェーデン) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	100	101	1,231	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	200	213	2,601	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	200	214	2,616	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	300	316	3,861	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	200	214	2,618	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	200	225	2,749	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	155	1,894	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	300	318	3,879	2022/6/1
小 計				21,452	
(ノルウェー) 国債証券		千クローネ	千クローネ		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	105	1,221	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	107	1,244	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	105	1,227	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	100	108	1,261	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	100	105	1,224	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	100	109	1,274	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	300	312	3,636	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	200	217	2,528	2024/3/14
小 計				13,618	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク	千デンマーク		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	300	321	5,358	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	300	324	5,414	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/22	0.25	200	203	3,397	2022/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	200	213	3,555	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	223	3,733	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	400	753	12,574	2039/11/15
小 計				34,034	
(ポーランド) 国債証券		千ズロツ	千ズロツ		
POLGB 0 07/25/22	—	200	199	5,513	2022/7/25
POLGB 0 3/4 04/25/25	0.75	100	101	2,815	2025/4/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	200	210	5,835	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	107	2,984	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	110	3,064	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	111	3,078	2027/7/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千豪ドル	千豪ドル	千円	
(ポーランド) 国債証券	%				
POLGB 2 1/4 10/25/24	2.25	100	107	2,979	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	100	112	3,117	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	200	226	6,280	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	113	3,146	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	110	3,064	2022/9/23
小 計				41,881	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	211	16,183	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	104	7,974	2032/5/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	100	102	7,827	2030/12/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	115	8,808	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	112	8,577	2028/5/21
ACGB 2 12/21/21	2.0	100	102	7,812	2021/12/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	200	218	16,697	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	230	17,634	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/28	2.75	200	232	17,787	2028/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	116	8,953	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	124	9,546	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	113	8,675	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	121	9,324	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	100	140	10,738	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	121	9,278	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	113	8,661	2023/4/21
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	109	8,384	2022/7/15
小 計				182,864	
(シンガポール) 国債証券		千シンガポール	千シンガポール		
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	117	9,142	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	108	8,495	2026/6/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	235	18,405	2027/3/1
小 計				36,043	
(マレーシア) 国債証券		千マレーシア	千マレーシア		
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	99	2,542	2031/4/15
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	103	2,653	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	106	2,728	2027/5/31
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	108	2,771	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	108	2,768	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	102	2,631	2022/3/10
MGS 3.885 08/15/29	3.885	100	109	2,789	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25	3.955	100	108	2,780	2025/9/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	107	2,753	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	110	2,825	2026/4/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	114	2,926	2046/3/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア) 国債証券	%	千円	千円	千円	
MGS 4.762 04/07/37	4.762	100	117	3,004	2037/4/7
MGS 5.248 09/28	5.248	100	118	3,026	2028/9/15
小 計				36,203	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	106	3,334	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	200	220	6,882	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	111	3,492	2028/9/28
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	112	3,505	2023/3/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ILGOV 5 1/2 01/31/22	—	100	110	3,465	2022/1/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	172	5,377	2042/1/31
小 計				26,057	
合 計				6,796,189	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,796,189	98.4
コール・ローン等、その他	112,772	1.6
投資信託財産総額	6,908,961	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産（6,867,158千円）の投資信託財産総額（6,908,961千円）に対する比率は99.4%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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは 1米ドル＝105.21円、1カナダドル＝80.83円、1メキシコペソ＝5.16円、1ユーロ＝124.27円、1英ポンド＝138.52円、1スウェーデンクローナ＝12.19円、1ノルウェークローネ＝11.62円、1デンマーククローネ＝16.69円、1ポーランドズロチ＝27.69円、1豪ドル＝76.56円、1シンガポールドル＝78.11円、1マレーシアリンギット＝25.58円、1イスラエルシェケル＝31.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,908,961,580
コール・ローン等	69,569,760
公社債(評価額)	6,796,189,549
未収利息	40,325,109
前払費用	2,877,162
(B) 負債	30,232,462
未払解約金	30,232,417
未払利息	45
(C) 純資産総額(A－B)	6,878,729,118
元本	4,126,162,688
次期繰越損益金	2,752,566,430
(D) 受益権総口数	4,126,162,688口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,671円

(注) 当親ファンドの期首元本額は2,873,096,055円、期中追加設定元本額は2,083,380,530円、期中一部解約元本額は830,313,897円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国債券インデックス	2,934,373,285円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	671,465,206円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	205,686,377円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	113,758,392円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	110,288,088円
L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	26,530,967円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	24,672,262円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	13,691,530円
L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)	9,000,542円
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	6,373,645円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	4,842,031円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	2,687,879円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	1,531,889円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	1,260,595円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2019年11月12日～2020年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	115,871,550
受取利息	115,888,316
その他収益金	10,773
支払利息	△ 27,539
(B) 有価証券売買損益	166,732,775
売買益	315,128,638
売買損	△ 148,395,863
(C) 保管費用等	△ 1,019,425
(D) 当期損益金(A+B+C)	281,584,900
(E) 前期繰越損益金	1,668,989,368
(F) 追加信託差損益金	1,329,022,043
(G) 解約差損益金	△ 527,029,881
(H) 計(D+E+F+G)	2,752,566,430
次期繰越損益金(H)	2,752,566,430

(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です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

2020年10月24日付で、ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないことを明確にするため、所要の約款変更を行いました。