

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。<br>・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。<br>・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。<br>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。<br>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15期 運用報告書（全体版）

（決算日 2025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15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<br>(分配落) | 価 額 |     |       | ベ ン チ<br>マ ー ク<br>期 騰 落 | 債 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|--------------|-----|-----|-------|-------------------------|----------------|--------------|
|                 |              | 税 分 | 達 配 | 金 騰 落 |                         |                |              |
|                 | 円            |     |     | 円     | 中 率                     |                | 百万円          |
| 11期(2021年4月15日) | 15,276       |     |     | 0     | 5.4                     | 292.944        | 5.462        |
| 12期(2022年4月15日) | 15,636       |     |     | 0     | 2.4                     | 300.586        | 7.007        |
| 13期(2023年4月17日) | 15,572       |     |     | 0     | △ 0.4                   | 300.267        | 8.823        |
| 14期(2024年4月15日) | 17,745       |     |     | 0     | 14.0                    | 343.390        | 12.342       |
| 15期(2025年4月15日) | 17,658       |     |     | 0     | △ 0.5                   | 342.494        | 14.041       |

(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<br>マ ー ク<br>期 騰 落 | 債 券<br>組 入 比 率 |
|------------|--------|------|------|-------------------------|----------------|
|            |        | 騰 落  | 率    |                         |                |
| (期 首)      | 円      |      | %    |                         | %              |
| 2024年4月15日 | 17,745 | —    | —    | 343.390                 | 98.7           |
| 4月末        | 18,093 | 2.0  | 2.0  | 350.129                 | 98.4           |
| 5月末        | 18,194 | 2.5  | 2.6  | 352.183                 | 98.6           |
| 6月末        | 18,819 | 6.1  | 6.1  | 364.447                 | 98.3           |
| 7月末        | 18,138 | 2.2  | 2.3  | 351.180                 | 98.7           |
| 8月末        | 17,673 | △0.4 | △0.3 | 342.231                 | 98.7           |
| 9月末        | 17,711 | △0.2 | △0.1 | 342.901                 | 98.7           |
| 10月末       | 18,435 | 3.9  | 4.0  | 357.115                 | 98.4           |
| 11月末       | 18,059 | 1.8  | 1.9  | 349.936                 | 98.7           |
| 12月末       | 18,621 | 4.9  | 5.1  | 360.828                 | 98.5           |
| 2025年1月末   | 18,230 | 2.7  | 2.9  | 353.315                 | 98.7           |
| 2月末        | 17,872 | 0.7  | 0.9  | 346.466                 | 98.2           |
| 3月末        | 18,059 | 1.8  | 2.0  | 350.256                 | 98.7           |
| (期 末)      |        |      |      |                         |                |
| 2025年4月15日 | 17,658 | △0.5 | △0.3 | 342.494                 | 98.9           |

(注) 騰落率は期首比です。

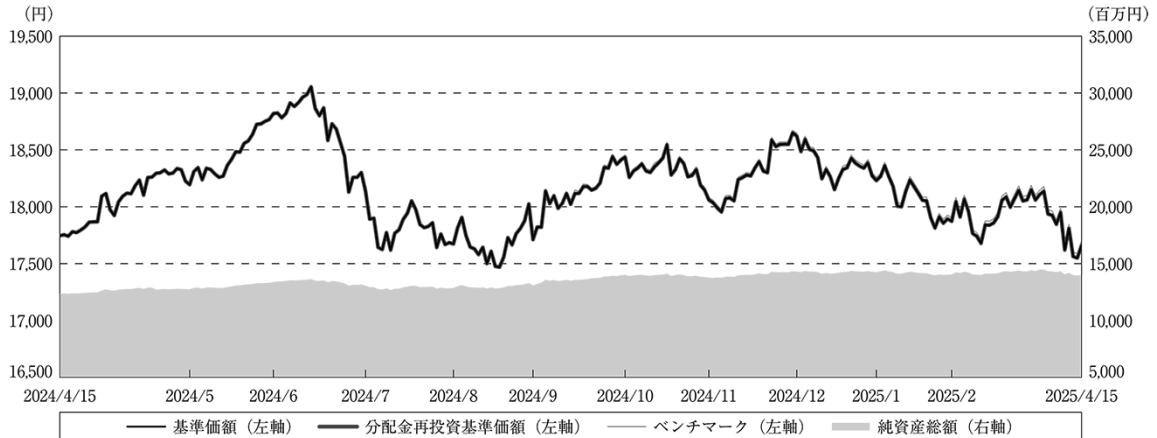
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2024年4月16日～2025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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2024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

- ・保有債券の利息収入

マイナス要因

- ・日銀の追加利上げを肯定する姿勢を受けた日米の短期金利差縮小による円高米ドル安の進行

## ■投資環境

### 【外国債券市場】

米国債利回りは低下しました。

期前半は、米国で景気・雇用に鈍化の兆候が見られ、FRB（米連邦準備制度理事会）による利下げが実施されたことから米国債利回りは低下しました。期半ばにかけて経済指標の多くが堅調であったことやトランプ氏の米国大統領選勝利を受けた財政悪化懸念などを背景に過度な利下げ期待が後退し、米国債利回りは上昇しましたが、期後半にかけては軟調な経済指標が続いたことやトランプ米政権の関税政策が事前予想よりも穏健だと思われたことなどから低下しました。期末にかけては、トランプ米大統領による大幅な追加関税政策などの影響を受けて、米国債利回りは大きく上下する展開となりました。

ドイツ国債利回りは小幅に上昇しました。

期前半は、米国債利回りに連動してドイツ国債利回りは低下しました。期後半にかけては、堅調な経済指標や欧州全体の防衛費強化などに関連する財政拡張リスクの高まりなどにより、ドイツ国債利回りは上昇しました。

### 【外国為替市場】

米ドル円為替レートは、円高米ドル安となりました。

期前半は、日銀が金融緩和姿勢を維持するなか、FRBが金融引き締め姿勢を維持したことにより円安米ドル高基調で推移しました。その後、財務省による為替介入などが意識された一方で、米国で景気後退懸念が高まったことから円高米ドル安が急激に進行しました。期後半は、日銀が追加利上げを急がない姿勢を示したことやトランプ氏の米国大統領選勝利による先行き不透明感などから円安米ドル高が進行しましたが、2025年1月に日銀が0.25%の利上げを行い、今後の追加利上げにも前向きな姿勢を示したことから再度円高米ドル安となりました。

ユーロ円為替レートは、期前半は日銀が金融緩和姿勢を維持したことにより円安ユーロ高が進行しましたが、その後、ドイツ国債利回りの低下や、財務省による為替介入や日銀による追加利上げの可能性が意識されたことにより、円高ユーロ安となりました。期後半は上下に振れながらもレンジ内で推移し、期を通しては小幅に円高ユーロ安となりました。

## ■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、0.5%下落しました。

### <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0.3%下落し、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 $\Delta 0.5\%$ となり、ベンチマークの騰落率 $\Delta 0.3\%$ にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

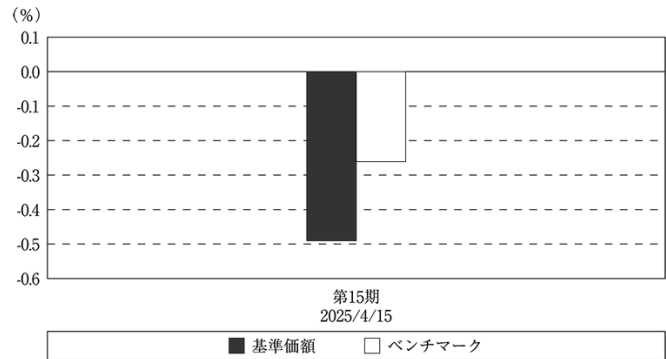
プラス要因

- ・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15期                      |
|-----------|---------------------------|
|           | 2024年4月16日～<br>2025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 | 8,871                     |

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

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

## ○今後の運用方針

<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

(2024年 4 月16日～2025年 4 月15日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                          |
|-----------------------|---------|------------|----------------------------------------------------|
|                       | 金 額     | 比 率        |                                                    |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>36 | %<br>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 )           | (18)    | (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 )           | (13)    | (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 )           | ( 4 )   | (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         | 6       | 0.035      | (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 )           | ( 5 )   | (0.030)    | *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 )   | (0.005)    | *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                   | 42      | 0.233      |                                                    |
| 期中の平均基準価額は、18,158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。

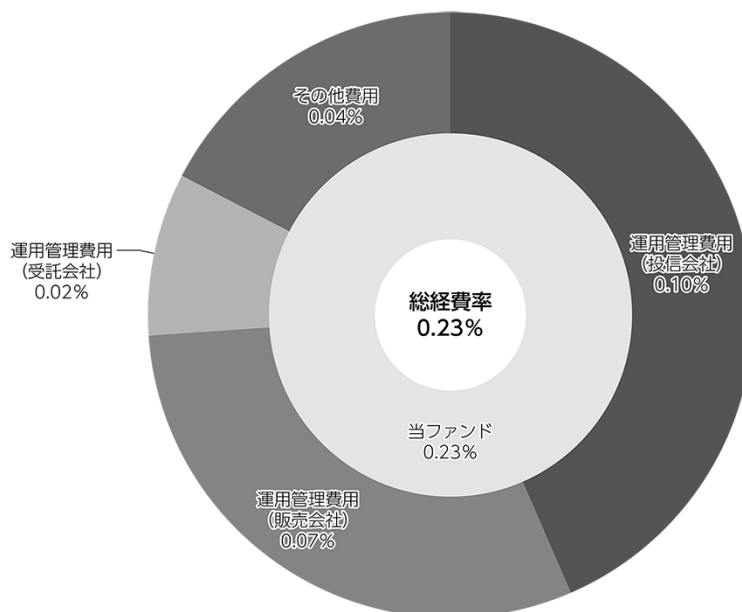
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.23%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

(2024年4月16日～2025年4月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘                    | 柄 | 設         |           | 解         |           |
|----------------------|---|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                      |   | 口         | 金         | 口         | 金         |
|                      |   | 数         | 額         | 数         | 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 |   | 1,937,663 | 3,940,561 | 1,061,983 | 2,158,667 |

○利害関係人との取引状況等

(2024年4月16日～2025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

(2025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         | 口         | 数          | 評 | 価 |
|                      |   | 千口        | 千口        | 千円         | 額 | 額 |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド |   | 6,214,755 | 7,090,436 | 14,041,899 |   |   |

○投資信託財産の構成

(2025年4月15日現在)

| 項                    | 目 | 当          |       | 期 | 末 |
|----------------------|---|------------|-------|---|---|
|                      |   | 評          | 価     | 額 | 率 |
|                      |   | 千円         | %     |   |   |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド |   | 14,041,899 | 99.6  |   |   |
| コール・ローン等、その他         |   | 57,557     | 0.4   |   |   |
| 投資信託財産総額             |   | 14,099,456 | 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（24,984,912千円）の投資信託財産総額（25,028,218千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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＝143.64円、1カナダドル＝103.38円、1メキシコペソ＝7.157円、1ユーロ＝162.66円、1英ポンド＝189.23円、1スウェーデンクローナ＝14.68円、1ノルウェークローネ＝13.55円、1デンマーククローネ＝21.78円、1ポーランドズロチ＝38.00円、1豪ドル＝90.90円、1ニュージーランドドル＝84.49円、1シンガポールドル＝109.11円、1マレーシアリングット＝32.5107円、1イスラエルシェケル＝39.0267円、1オフショア元＝19.6298円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年4月15日現在)

| 項 目                       | 当 期 末          |
|---------------------------|----------------|
|                           | 円              |
| (A) 資産                    | 14,099,456,140 |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 14,041,899,492 |
| 未収入金                      | 57,556,648     |
| (B) 負債                    | 57,556,648     |
| 未払解約金                     | 43,306,715     |
| 未払信託報酬                    | 13,921,787     |
| その他未払費用                   | 328,146        |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 14,041,899,492 |
| 元本                        | 7,952,088,134  |
| 次期繰越損益金                   | 6,089,811,358  |
| (D) 受益権総口数                | 7,952,088,134口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 17,658円        |

- (注) 当ファンドの期首元本額は6,955,598,638円、期中追加設定元本額は2,170,719,878円、期中一部解約元本額は1,174,230,382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 (2024年4月16日～2025年4月15日)

| 項 目            | 当 期              |
|----------------|------------------|
|                | 円                |
| (A) 有価証券売買損益   | △ 123,393,345    |
| 売買益            | 25,610,066       |
| 売買損            | △ 149,003,411    |
| (B) 信託報酬等      | △ 27,484,965     |
| (C) 当期損益金(A＋B) | △ 150,878,310    |
| (D) 前期繰越損益金    | 1,287,168,997    |
| (E) 追加信託差損益金   | 4,953,520,671    |
| (配当等相当額)       | ( 5,405,714,747) |
| (売買損益相当額)      | (△ 452,194,076)  |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 6,089,811,358    |
| (G) 収益分配金      | 0                |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 6,089,811,358    |
| 追加信託差損益金       | 4,953,520,671    |
| (配当等相当額)       | ( 5,414,135,315) |
| (売買損益相当額)      | (△ 460,614,644)  |
| 分配準備積立金        | 1,640,890,482    |
| 繰越損益金          | △ 504,599,795    |

- (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)     | 353,721,485円   |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 0円             |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 5,414,135,315円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 1,287,168,997円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)  | 7,055,025,797円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 8,871円         |
| g. 分配金              | 0円             |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 0円             |

○お知らせ

- ・2023年11月に成立した「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正の施行により、従来運用報告書の書面交付義務としていた規定が、電磁的方法を含む情報提供義務と改められることに伴い、2025年4月1日付で所要の約款変更を行いました。

上記の通り、2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

## TMA外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第19期（決算日 2024年11月11日）

（計算期間 2023年11月11日～2024年11月11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 組 | 入 比  | 純 資 産 額 |
|------------------|--------|-----|-------|---------|-------|-----|------|---------|
|                  |        | 期 騰 | 落 中 率 |         |       |     |      |         |
|                  | 円      |     | %     |         | %     |     | %    | 百万円     |
| 15期(2020年11月10日) | 16,671 |     | 5.5   | 287.164 | 5.5   |     | 98.8 | 6,878   |
| 16期(2021年11月10日) | 17,599 |     | 5.6   | 303.543 | 5.7   |     | 99.3 | 9,910   |
| 17期(2022年11月10日) | 17,776 |     | 1.0   | 307.252 | 1.2   |     | 98.6 | 12,958  |
| 18期(2023年11月10日) | 18,930 |     | 6.5   | 327.088 | 6.5   |     | 98.8 | 17,668  |
| 19期(2024年11月11日) | 20,507 |     | 8.3   | 354.543 | 8.4   |     | 98.7 | 24,613  |

## ○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 組  | 入 比 | 券 率  |
|-------------|--------|-----|------|---------|-------|------|-----|------|
|             |        | 騰 落 | 率    |         |       |      |     |      |
| (期 首)       | 円      |     | %    |         |       |      |     | %    |
| 2023年11月10日 | 18,930 |     | —    | 327.088 |       | —    |     | 98.8 |
| 11月末        | 19,027 |     | 0.5  | 328.916 |       | 0.6  |     | 98.5 |
| 12月末        | 19,052 |     | 0.6  | 329.251 |       | 0.7  |     | 98.2 |
| 2024年1月末    | 19,389 |     | 2.4  | 335.106 |       | 2.5  |     | 98.4 |
| 2月末         | 19,637 |     | 3.7  | 339.486 |       | 3.8  |     | 98.4 |
| 3月末         | 19,883 |     | 5.0  | 343.803 |       | 5.1  |     | 98.3 |
| 4月末         | 20,251 |     | 7.0  | 350.129 |       | 7.0  |     | 98.4 |
| 5月末         | 20,368 |     | 7.6  | 352.183 |       | 7.7  |     | 98.5 |
| 6月末         | 21,071 |     | 11.3 | 364.447 |       | 11.4 |     | 98.2 |
| 7月末         | 20,312 |     | 7.3  | 351.180 |       | 7.4  |     | 98.6 |
| 8月末         | 19,795 |     | 4.6  | 342.231 |       | 4.6  |     | 98.7 |
| 9月末         | 19,841 |     | 4.8  | 342.901 |       | 4.8  |     | 98.6 |
| 10月末        | 20,656 |     | 9.1  | 357.115 |       | 9.2  |     | 98.4 |
| (期 末)       |        |     |      |         |       |      |     |      |
| 2024年11月11日 | 20,507 |     | 8.3  | 354.543 |       | 8.4  |     | 98.7 |

（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

(2023年11月11日～2024年11月11日)

## ■期中の基準価額等の推移

期 首：18,930円

期 末：20,507円

騰落率： 8.3%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・欧米中央銀行の利下げを背景とした世界的な国債利回りの低下（債券価格の上昇）
- ・米国経済が堅調であることを受けて円安が進行したこと
- ・保有する債券の利息収入

## マイナス要因

- ・期中に日銀の利上げなどにより内外金利差が縮小し、円高が急速に進行する場面があったこと

## ■投資環境

## 【外国債券市場】

米国債利回りは低下しました。期初は米国で雇用統計やCPI（消費者物価指数）に落ち着きが見られたことを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め姿勢に後退の兆しが見え、米国債利回りは低下しました。期半ばにかけて、堅調な経済指標が確認されたことや、FRB高官による早期の利下げを否定する発言などから、米国債利回りは上昇（債券価格は下落）に転じる局面もありましたが、その後は、景気や雇用に鈍化の兆候が見られ、FRBによる利下げが実施されると、再度低下基調となりました。しかし、期末にかけて発表された経済指標の多くが堅調だったことを受けて過度な利下げ期待が剥落するなか、米国債利回りは再び上昇しましたが、前期末からは低下して期を終えました。

ドイツ国債利回りは低下しました。欧州域内の物価・景気指標に減速感が見られたことにより、ECB（欧州中央銀行）が利下げ姿勢に転換したことから、ドイツ国債利回りは低下しました。

## 【為替市場】

米ドル円為替レートは、日銀が金融政策を修正しつつも慎重な姿勢を維持するなか、FRBは利下げ姿勢に転じたものの米国経済は依然として堅調であることから、円安米ドル高が進行しました。期中、日銀による利上げの実施を受けて内外金利差が縮小し円高が急速に進行する場面もありましたが、前期末対比円安米ドル高となりました。

ユーロ円為替レートは、日銀が金融政策に慎重な姿勢を維持するなか、ECBは利下げ姿勢に転じたものの米国債に連動して欧州国債利回りが上昇した局面で円安ユーロ高が進行しました。期中、日銀による利上げの実施を受けて円高が急速に進行する場面もありましたが、前期末対比円安ユーロ高となりました。

## ■ポートフォリオについて

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8.3%上昇しました。



(注) ベンチマークは、期首（2023年11月10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。

## ■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+8.3%となり、ベンチマークの騰落率+8.4%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

- ・個別銘柄要因
- ・取引などに係るコスト

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<sup>(※)</sup>は、10月末現在、推定値で0.10%となっています。

※2024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運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2023年11月11日～2024年11月11日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                          |
|-----------------------|--------|------------|----------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                    |
| (a) そ の 他 費 用         | 円<br>7 | %<br>0.033 | (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 )           | (7)    | (0.033)    | *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                   | 7      | 0.033      |                                                    |
| 期中の平均基準価額は、19,940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。

(2023年11月11日～2024年11月11日)

|          |         |                    | 買 付 額              | 売 付 額              |
|----------|---------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 外 国      | アメリカ    | 国債証券               | 千米ドル<br>27,994     | 千米ドル<br>11,360     |
|          | カナダ     | 国債証券               | 千カナダドル<br>1,662    | 千カナダドル<br>689      |
|          | メキシコ    | 国債証券               | 千メキシコペソ<br>6,894   | 千メキシコペソ<br>2,533   |
|          | ユーロ     |                    | 千ユーロ               | 千ユーロ               |
|          | ドイツ     | 国債証券               | 2,559              | 1,180              |
|          | イタリア    | 国債証券               | 3,202              | 1,480              |
|          | フランス    | 国債証券               | 3,119              | 1,347              |
|          | オランダ    | 国債証券               | 467                | 193                |
|          | スペイン    | 国債証券               | 1,981              | 1,045              |
|          | ベルギー    | 国債証券               | 422                | 97                 |
|          | オーストリア  | 国債証券               | 483                | 96                 |
|          | フィンランド  | 国債証券               | 291                | 100                |
|          | アイルランド  | 国債証券               | 166                | 101                |
|          | ポルトガル   | 国債証券               | 807                | —                  |
|          | イギリス    | 国債証券               | 千英ポンド<br>2,224     | 千英ポンド<br>585       |
|          | スウェーデン  | 国債証券               | 千スウェーデンクローナ<br>592 | 千スウェーデンクローナ<br>496 |
|          | ノルウェー   | 国債証券               | 千ノルウェークローネ<br>954  | 千ノルウェークローネ<br>390  |
|          | デンマーク   | 国債証券               | 千デンマーククローネ<br>444  | 千デンマーククローネ<br>291  |
|          | ポーランド   | 国債証券               | 千ポーランドズロチ<br>1,489 | 千ポーランドズロチ<br>674   |
|          | オーストラリア | 国債証券               | 千豪ドル<br>642        | 千豪ドル<br>195        |
| ニュージーランド | 国債証券    | 千ニュージーランドドル<br>285 | 千ニュージーランドドル<br>—   |                    |
| シンガポール   | 国債証券    | 千シンガポールドル<br>294   | 千シンガポールドル<br>100   |                    |
| マレーシア    | 国債証券    | 千マレーシアリンギット<br>922 | 千マレーシアリンギット<br>201 |                    |
| イスラエル    | 国債証券    | 千イスラエルシェケル<br>979  | 千イスラエルシェケル<br>388  |                    |
| 中国       | 国債証券    | 千オフショア元<br>76,121  | 千オフショア元<br>11,955  |                    |

(2023年11月11日～2024年11月11日)

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

(2024年11月11日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分      | 当 期 末                |                      |            |      |                    |           |      |      |
|----------|----------------------|----------------------|------------|------|--------------------|-----------|------|------|
|          | 額面金額                 | 評 価 額                |            | 組入比率 | うちBB格以下<br>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     | 80,350               | 74,003               | 11,332,877 | 46.0 | —                  | 19.8      | 17.1 | 9.2  |
| カナダ      | 千カナダドル<br>4,500      | 千カナダドル<br>4,325      | 476,059    | 1.9  | —                  | 1.1       | 0.4  | 0.4  |
| メキシコ     | 千メキシコペソ<br>26,100    | 千メキシコペソ<br>23,456    | 178,506    | 0.7  | —                  | 0.4       | 0.2  | 0.1  |
| ユーロ      | 千ユーロ                 | 千ユーロ                 |            |      |                    |           |      |      |
| ドイツ      | 9,200                | 8,627                | 1,415,214  | 5.7  | —                  | 3.3       | 1.7  | 0.7  |
| イタリア     | 10,600               | 10,293               | 1,688,532  | 6.9  | —                  | 4.0       | 1.8  | 1.1  |
| フランス     | 12,100               | 11,037               | 1,810,665  | 7.4  | —                  | 4.2       | 2.2  | 0.9  |
| オランダ     | 2,100                | 1,934                | 317,394    | 1.3  | —                  | 0.8       | 0.4  | 0.1  |
| スペイン     | 6,900                | 6,581                | 1,079,623  | 4.4  | —                  | 2.4       | 1.4  | 0.5  |
| ベルギー     | 2,600                | 2,361                | 387,376    | 1.6  | —                  | 1.1       | 0.4  | 0.1  |
| オーストリア   | 1,900                | 1,710                | 280,603    | 1.1  | —                  | 0.8       | 0.2  | 0.2  |
| フィンランド   | 800                  | 743                  | 121,907    | 0.5  | —                  | 0.4       | 0.1  | —    |
| アイルランド   | 800                  | 714                  | 117,244    | 0.5  | —                  | 0.3       | 0.1  | 0.1  |
| ポルトガル    | 800                  | 802                  | 131,641    | 0.5  | —                  | 0.4       | 0.1  | —    |
| イギリス     | 千英ポンド<br>7,840       | 千英ポンド<br>6,385       | 1,262,785  | 5.1  | —                  | 3.6       | 1.3  | 0.3  |
| スウェーデン   | 千スウェーデンクローナ<br>2,800 | 千スウェーデンクローナ<br>2,744 | 38,840     | 0.2  | —                  | 0.1       | 0.1  | —    |
| ノルウェー    | 千ノルウェークローネ<br>2,800  | 千ノルウェークローネ<br>2,591  | 36,052     | 0.1  | —                  | 0.1       | 0.0  | 0.0  |
| デンマーク    | 千デンマーククローネ<br>2,900  | 千デンマーククローネ<br>2,805  | 61,715     | 0.3  | —                  | 0.2       | 0.0  | 0.0  |
| ポーランド    | 千ポーランドズロチ<br>3,600   | 千ポーランドズロチ<br>3,348   | 126,887    | 0.5  | —                  | 0.1       | 0.3  | 0.1  |
| オーストラリア  | 千豪ドル<br>3,500        | 千豪ドル<br>3,105        | 313,381    | 1.3  | —                  | 0.9       | 0.2  | 0.2  |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル<br>800   | 千ニュージーランドドル<br>732   | 66,942     | 0.3  | —                  | 0.2       | 0.1  | —    |
| シンガポール   | 千シンガポールドル<br>900     | 千シンガポールドル<br>895     | 103,302    | 0.4  | —                  | 0.3       | 0.0  | 0.0  |
| マレーシア    | 千マレーシアリンギット<br>3,500 | 千マレーシアリンギット<br>3,583 | 124,813    | 0.5  | —                  | 0.3       | 0.1  | 0.0  |
| イスラエル    | 千イスラエルシェケル<br>2,100  | 千イスラエルシェケル<br>1,883  | 76,910     | 0.3  | —                  | 0.2       | 0.1  | 0.0  |
| 中国       | 千オフショア元<br>122,900   | 千オフショア元<br>128,459   | 2,732,579  | 11.1 | —                  | 5.1       | 4.0  | 2.1  |
| 合 計      | —                    | —                    | 24,281,859 | 98.7 | —                  | 50.0      | 32.4 | 16.3 |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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               | 利率    | 当 期 末 |       |        |            |
|------------------|-------|-------|-------|--------|------------|
|                  |       | 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 0 1/2 02/28/26 | 0.5   | 100   | 95    | 14,579 | 2026/2/28  |
| T 0 1/2 04/30/27 | 0.5   | 100   | 91    | 13,991 | 2027/4/30  |
| T 0 1/2 05/31/27 | 0.5   | 200   | 182   | 27,893 | 2027/5/31  |
| T 0 1/2 06/30/27 | 0.5   | 100   | 90    | 13,907 | 2027/6/30  |
| T 0 1/2 08/31/27 | 0.5   | 300   | 270   | 41,482 | 2027/8/31  |
| T 0 1/2 10/31/27 | 0.5   | 200   | 179   | 27,485 | 2027/10/31 |
| T 0 1/4 10/31/25 | 0.25  | 400   | 384   | 58,893 | 2025/10/31 |
| T 0 3/4 01/31/28 | 0.75  | 300   | 268   | 41,188 | 2028/1/31  |
| T 0 3/4 03/31/26 | 0.75  | 300   | 285   | 43,758 | 2026/3/31  |
| T 0 3/4 04/30/26 | 0.75  | 200   | 189   | 29,095 | 2026/4/30  |
| T 0 3/4 05/31/26 | 0.75  | 100   | 94    | 14,506 | 2026/5/31  |
| T 0 3/4 08/31/26 | 0.75  | 300   | 281   | 43,165 | 2026/8/31  |
| T 0 3/8 01/31/26 | 0.375 | 500   | 476   | 73,003 | 2026/1/31  |
| T 0 3/8 07/31/27 | 0.375 | 200   | 180   | 27,637 | 2027/7/31  |
| T 0 3/8 09/30/27 | 0.375 | 400   | 358   | 54,931 | 2027/9/30  |
| T 0 3/8 11/30/25 | 0.375 | 100   | 95    | 14,693 | 2025/11/30 |
| T 0 3/8 12/31/25 | 0.375 | 300   | 286   | 43,942 | 2025/12/31 |
| T 0 5/8 05/15/30 | 0.625 | 400   | 330   | 50,543 | 2030/5/15  |
| T 0 5/8 07/31/26 | 0.625 | 300   | 282   | 43,189 | 2026/7/31  |
| T 0 5/8 08/15/30 | 0.625 | 400   | 327   | 50,083 | 2030/8/15  |
| T 0 5/8 11/30/27 | 0.625 | 400   | 359   | 55,011 | 2027/11/30 |
| T 0 5/8 12/31/27 | 0.625 | 300   | 268   | 41,139 | 2027/12/31 |
| T 0 7/8 06/30/26 | 0.875 | 200   | 189   | 28,994 | 2026/6/30  |
| T 0 7/8 09/30/26 | 0.875 | 400   | 375   | 57,537 | 2026/9/30  |
| T 0 7/8 11/15/30 | 0.875 | 500   | 412   | 63,185 | 2030/11/15 |
| T 1 07/31/28     | 1.0   | 300   | 267   | 40,903 | 2028/7/31  |
| T 1 1/2 01/31/27 | 1.5   | 200   | 188   | 28,874 | 2027/1/31  |
| T 1 1/2 02/15/30 | 1.5   | 500   | 436   | 66,846 | 2030/2/15  |
| T 1 1/2 11/30/28 | 1.5   | 400   | 359   | 55,108 | 2028/11/30 |
| T 1 1/4 04/30/28 | 1.25  | 300   | 271   | 41,590 | 2028/4/30  |
| T 1 1/4 05/15/50 | 1.25  | 200   | 100   | 15,426 | 2050/5/15  |
| T 1 1/4 05/31/28 | 1.25  | 300   | 270   | 41,495 | 2028/5/31  |
| T 1 1/4 06/30/28 | 1.25  | 200   | 180   | 27,599 | 2028/6/30  |
| T 1 1/4 08/15/31 | 1.25  | 500   | 412   | 63,215 | 2031/8/15  |
| T 1 1/4 09/30/28 | 1.25  | 400   | 357   | 54,794 | 2028/9/30  |
| T 1 1/4 11/30/26 | 1.25  | 500   | 470   | 72,107 | 2026/11/30 |
| T 1 1/4 12/31/26 | 1.25  | 600   | 563   | 86,353 | 2026/12/31 |
| T 1 1/8 02/15/31 | 1.125 | 500   | 416   | 63,777 | 2031/2/15  |
| T 1 1/8 02/29/28 | 1.125 | 300   | 271   | 41,609 | 2028/2/29  |
| T 1 1/8 05/15/40 | 1.125 | 200   | 125   | 19,156 | 2040/5/15  |
| T 1 1/8 08/15/40 | 1.125 | 100   | 61    | 9,490  | 2040/8/15  |
| T 1 1/8 08/31/28 | 1.125 | 300   | 267   | 40,990 | 2028/8/31  |
| T 1 1/8 10/31/26 | 1.125 | 400   | 376   | 57,676 | 2026/10/31 |
| T 1 3/4 01/31/29 | 1.75  | 200   | 181   | 27,728 | 2029/1/31  |
| T 1 3/4 08/15/41 | 1.75  | 300   | 201   | 30,928 | 2041/8/15  |
| T 1 3/4 11/15/29 | 1.75  | 300   | 267   | 40,988 | 2029/11/15 |
| T 1 3/4 12/31/26 | 1.75  | 300   | 285   | 43,648 | 2026/12/31 |
| T 1 3/8 08/15/50 | 1.375 | 200   | 103   | 15,884 | 2050/8/15  |

| 銘柄               | 利率    | 当 期 末 |       |         |            |
|------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|                  |       | 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 1 3/8 10/31/28 | 1.375 | 400   | 358   | 54,949  | 2028/10/31 |
| T 1 3/8 11/15/31 | 1.375 | 900   | 744   | 113,972 | 2031/11/15 |
| T 1 3/8 11/15/40 | 1.375 | 500   | 321   | 49,265  | 2040/11/15 |
| T 1 3/8 12/31/28 | 1.375 | 600   | 536   | 82,094  | 2028/12/31 |
| T 1 5/8 02/15/26 | 1.625 | 600   | 580   | 88,879  | 2026/2/15  |
| T 1 5/8 05/15/26 | 1.625 | 200   | 192   | 29,447  | 2026/5/15  |
| T 1 5/8 05/15/31 | 1.625 | 500   | 426   | 65,272  | 2031/5/15  |
| T 1 5/8 08/15/29 | 1.625 | 300   | 267   | 40,945  | 2029/8/15  |
| T 1 5/8 09/30/26 | 1.625 | 200   | 190   | 29,194  | 2026/9/30  |
| T 1 5/8 11/15/50 | 1.625 | 600   | 332   | 50,905  | 2050/11/15 |
| T 1 5/8 11/30/26 | 1.625 | 300   | 284   | 43,609  | 2026/11/30 |
| T 1 7/8 02/15/32 | 1.875 | 500   | 426   | 65,243  | 2032/2/15  |
| T 1 7/8 02/15/41 | 1.875 | 300   | 208   | 31,981  | 2041/2/15  |
| T 1 7/8 02/15/51 | 1.875 | 300   | 177   | 27,146  | 2051/2/15  |
| T 1 7/8 02/28/27 | 1.875 | 300   | 284   | 43,594  | 2027/2/28  |
| T 1 7/8 02/28/29 | 1.875 | 200   | 181   | 27,834  | 2029/2/28  |
| T 1 7/8 07/31/26 | 1.875 | 100   | 96    | 14,711  | 2026/7/31  |
| T 1 7/8 11/15/51 | 1.875 | 800   | 469   | 71,894  | 2051/11/15 |
| T 2 02/15/50     | 2.0   | 500   | 307   | 47,021  | 2050/2/15  |
| T 2 08/15/51     | 2.0   | 400   | 242   | 37,208  | 2051/8/15  |
| T 2 1/2 02/15/46 | 2.5   | 100   | 71    | 10,947  | 2046/2/15  |
| T 2 1/2 03/31/27 | 2.5   | 200   | 192   | 29,456  | 2027/3/31  |
| T 2 1/2 05/15/46 | 2.5   | 100   | 71    | 10,914  | 2046/5/15  |
| T 2 1/4 02/15/52 | 2.25  | 300   | 193   | 29,581  | 2052/2/15  |
| T 2 1/4 05/15/41 | 2.25  | 300   | 221   | 33,880  | 2041/5/15  |
| T 2 1/4 08/15/27 | 2.25  | 100   | 94    | 14,536  | 2027/8/15  |
| T 2 1/4 08/15/46 | 2.25  | 200   | 135   | 20,718  | 2046/8/15  |
| T 2 1/4 08/15/49 | 2.25  | 200   | 130   | 20,030  | 2049/8/15  |
| T 2 1/4 11/15/27 | 2.25  | 400   | 378   | 57,886  | 2027/11/15 |
| T 2 11/15/26     | 2.0   | 100   | 95    | 14,662  | 2026/11/15 |
| T 2 11/15/41     | 2.0   | 800   | 558   | 85,545  | 2041/11/15 |
| T 2 3/4 02/15/28 | 2.75  | 600   | 573   | 87,826  | 2028/2/15  |
| T 2 3/4 04/30/27 | 2.75  | 200   | 193   | 29,583  | 2027/4/30  |
| T 2 3/4 05/31/29 | 2.75  | 200   | 187   | 28,789  | 2029/5/31  |
| T 2 3/4 07/31/27 | 2.75  | 300   | 288   | 44,229  | 2027/7/31  |
| T 2 3/4 08/15/32 | 2.75  | 300   | 270   | 41,365  | 2032/8/15  |
| T 2 3/4 08/15/42 | 2.75  | 100   | 78    | 11,950  | 2042/8/15  |
| T 2 3/4 08/15/47 | 2.75  | 100   | 73    | 11,294  | 2047/8/15  |
| T 2 3/4 11/15/42 | 2.75  | 200   | 155   | 23,803  | 2042/11/15 |
| T 2 3/4 11/15/47 | 2.75  | 200   | 147   | 22,554  | 2047/11/15 |
| T 2 3/8 02/15/42 | 2.375 | 300   | 221   | 33,977  | 2042/2/15  |
| T 2 3/8 03/31/29 | 2.375 | 300   | 278   | 42,586  | 2029/3/31  |
| T 2 3/8 05/15/27 | 2.375 | 100   | 95    | 14,648  | 2027/5/15  |
| T 2 3/8 05/15/29 | 2.375 | 100   | 92    | 14,179  | 2029/5/15  |
| T 2 3/8 05/15/51 | 2.375 | 300   | 199   | 30,605  | 2051/5/15  |
| T 2 3/8 11/15/49 | 2.375 | 500   | 335   | 51,358  | 2049/11/15 |
| T 2 5/8 01/31/26 | 2.625 | 100   | 98    | 15,008  | 2026/1/31  |
| T 2 5/8 02/15/29 | 2.625 | 100   | 93    | 14,375  | 2029/2/15  |

| 銘柄               | 利率    | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|------------------|-------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                  |       | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円              | 債 額        | 償還年月日 |
| T 2 5/8 05/31/27 | 2.625 | 200   | 192   | 29,461          | 2027/5/31  |       |
| T 2 5/8 07/31/29 | 2.625 | 200   | 186   | 28,573          | 2029/7/31  |       |
| T 2 7/8 04/30/29 | 2.875 | 200   | 189   | 28,976          | 2029/4/30  |       |
| T 2 7/8 05/15/28 | 2.875 | 100   | 95    | 14,650          | 2028/5/15  |       |
| T 2 7/8 05/15/32 | 2.875 | 600   | 546   | 83,720          | 2032/5/15  |       |
| T 2 7/8 05/15/43 | 2.875 | 100   | 78    | 12,050          | 2043/5/15  |       |
| T 2 7/8 05/15/52 | 2.875 | 300   | 222   | 34,018          | 2052/5/15  |       |
| T 2 7/8 08/15/28 | 2.875 | 100   | 95    | 14,604          | 2028/8/15  |       |
| T 2 7/8 08/15/45 | 2.875 | 100   | 76    | 11,788          | 2045/8/15  |       |
| T 2 7/8 11/15/46 | 2.875 | 200   | 152   | 23,289          | 2046/11/15 |       |
| T 3 02/15/47     | 3.0   | 300   | 232   | 35,654          | 2047/2/15  |       |
| T 3 02/15/48     | 3.0   | 300   | 231   | 35,375          | 2048/2/15  |       |
| T 3 02/15/49     | 3.0   | 400   | 306   | 46,863          | 2049/2/15  |       |
| T 3 05/15/47     | 3.0   | 100   | 77    | 11,858          | 2047/5/15  |       |
| T 3 08/15/48     | 3.0   | 200   | 153   | 23,495          | 2048/8/15  |       |
| T 3 08/15/52     | 3.0   | 300   | 228   | 34,919          | 2052/8/15  |       |
| T 3 1/2 01/31/28 | 3.5   | 300   | 293   | 44,976          | 2028/1/31  |       |
| T 3 1/2 01/31/30 | 3.5   | 200   | 193   | 29,612          | 2030/1/31  |       |
| T 3 1/2 02/15/33 | 3.5   | 500   | 473   | 72,449          | 2033/2/15  |       |
| T 3 1/2 04/30/30 | 3.5   | 200   | 193   | 29,576          | 2030/4/30  |       |
| T 3 1/2 09/30/26 | 3.5   | 700   | 690   | 105,728         | 2026/9/30  |       |
| T 3 1/4 05/15/42 | 3.25  | 100   | 84    | 12,928          | 2042/5/15  |       |
| T 3 1/4 06/30/27 | 3.25  | 300   | 292   | 44,859          | 2027/6/30  |       |
| T 3 1/4 06/30/29 | 3.25  | 200   | 191   | 29,398          | 2029/6/30  |       |
| T 3 1/8 02/15/43 | 3.125 | 100   | 82    | 12,576          | 2043/2/15  |       |
| T 3 1/8 05/15/48 | 3.125 | 100   | 78    | 12,048          | 2048/5/15  |       |
| T 3 1/8 08/15/44 | 3.125 | 300   | 242   | 37,158          | 2044/8/15  |       |
| T 3 1/8 08/31/27 | 3.125 | 300   | 291   | 44,639          | 2027/8/31  |       |
| T 3 1/8 08/31/29 | 3.125 | 100   | 95    | 14,598          | 2029/8/31  |       |
| T 3 1/8 11/15/28 | 3.125 | 200   | 192   | 29,416          | 2028/11/15 |       |
| T 3 1/8 11/15/41 | 3.125 | 100   | 83    | 12,830          | 2041/11/15 |       |
| T 3 11/15/44     | 3.0   | 100   | 79    | 12,110          | 2044/11/15 |       |
| T 3 11/15/45     | 3.0   | 400   | 314   | 48,093          | 2045/11/15 |       |
| T 3 3/4 04/15/26 | 3.75  | 200   | 198   | 30,393          | 2026/4/15  |       |
| T 3 3/4 05/31/30 | 3.75  | 200   | 195   | 29,934          | 2030/5/31  |       |
| T 3 3/4 06/30/30 | 3.75  | 200   | 195   | 29,919          | 2030/6/30  |       |
| T 3 3/4 08/15/27 | 3.75  | 1,000 | 988   | 151,327         | 2027/8/15  |       |
| T 3 3/4 08/31/31 | 3.75  | 300   | 291   | 44,603          | 2031/8/31  |       |
| T 3 3/4 11/15/43 | 3.75  | 200   | 178   | 27,407          | 2043/11/15 |       |
| T 3 3/4 12/31/28 | 3.75  | 900   | 884   | 135,403         | 2028/12/31 |       |
| T 3 3/4 12/31/30 | 3.75  | 500   | 487   | 74,586          | 2030/12/31 |       |
| T 3 3/8 05/15/33 | 3.375 | 500   | 467   | 71,633          | 2033/5/15  |       |
| T 3 3/8 08/15/42 | 3.375 | 300   | 257   | 39,390          | 2042/8/15  |       |
| T 3 3/8 09/15/27 | 3.375 | 500   | 489   | 74,915          | 2027/9/15  |       |
| T 3 3/8 11/15/48 | 3.375 | 400   | 328   | 50,234          | 2048/11/15 |       |
| T 3 5/8 02/15/44 | 3.625 | 100   | 87    | 13,432          | 2044/2/15  |       |
| T 3 5/8 02/15/53 | 3.625 | 300   | 258   | 39,511          | 2053/2/15  |       |
| T 3 5/8 03/31/28 | 3.625 | 300   | 294   | 45,112          | 2028/3/31  |       |
| T 3 5/8 03/31/30 | 3.625 | 300   | 291   | 44,655          | 2030/3/31  |       |

| 銘柄               | 利率    | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|------------------|-------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                  |       | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円              | 債 額        | 償還年月日 |
| T 3 5/8 05/15/26 | 3.625 | 400   | 396   | 60,662          | 2026/5/15  |       |
| T 3 5/8 05/15/53 | 3.625 | 300   | 258   | 39,537          | 2053/5/15  |       |
| T 3 5/8 05/31/28 | 3.625 | 600   | 588   | 90,132          | 2028/5/31  |       |
| T 3 5/8 08/15/43 | 3.625 | 100   | 88    | 13,484          | 2043/8/15  |       |
| T 3 5/8 08/31/29 | 3.625 | 400   | 390   | 59,772          | 2029/8/31  |       |
| T 3 5/8 09/30/31 | 3.625 | 300   | 289   | 44,258          | 2031/9/30  |       |
| T 3 7/8 01/15/26 | 3.875 | 300   | 298   | 45,706          | 2026/1/15  |       |
| T 3 7/8 02/15/43 | 3.875 | 100   | 91    | 14,042          | 2043/2/15  |       |
| T 3 7/8 05/15/43 | 3.875 | 300   | 274   | 42,030          | 2043/5/15  |       |
| T 3 7/8 08/15/33 | 3.875 | 600   | 581   | 89,087          | 2033/8/15  |       |
| T 3 7/8 08/15/34 | 3.875 | 600   | 579   | 88,790          | 2034/8/15  |       |
| T 3 7/8 08/15/40 | 3.875 | 200   | 187   | 28,653          | 2040/8/15  |       |
| T 3 7/8 09/30/29 | 3.875 | 300   | 295   | 45,269          | 2029/9/30  |       |
| T 3 7/8 11/30/27 | 3.875 | 400   | 396   | 60,675          | 2027/11/30 |       |
| T 3 7/8 11/30/29 | 3.875 | 100   | 98    | 15,083          | 2029/11/30 |       |
| T 3 7/8 12/31/27 | 3.875 | 1,100 | 1,089 | 166,838         | 2027/12/31 |       |
| T 3 7/8 12/31/29 | 3.875 | 700   | 689   | 105,541         | 2029/12/31 |       |
| T 4 01/15/27     | 4.0   | 300   | 298   | 45,717          | 2027/1/15  |       |
| T 4 01/31/29     | 4.0   | 500   | 495   | 75,949          | 2029/1/31  |       |
| T 4 01/31/31     | 4.0   | 400   | 394   | 60,471          | 2031/1/31  |       |
| T 4 02/15/26     | 4.0   | 100   | 99    | 15,255          | 2026/2/15  |       |
| T 4 02/15/34     | 4.0   | 700   | 684   | 104,765         | 2034/2/15  |       |
| T 4 02/28/30     | 4.0   | 100   | 99    | 15,162          | 2030/2/28  |       |
| T 4 02/29/28     | 4.0   | 200   | 198   | 30,435          | 2028/2/29  |       |
| T 4 07/31/29     | 4.0   | 700   | 694   | 106,303         | 2029/7/31  |       |
| T 4 07/31/30     | 4.0   | 300   | 296   | 45,437          | 2030/7/31  |       |
| T 4 1/2 02/15/44 | 4.5   | 400   | 397   | 60,806          | 2044/2/15  |       |
| T 4 1/2 03/31/26 | 4.5   | 200   | 200   | 30,702          | 2026/3/31  |       |
| T 4 1/2 04/15/27 | 4.5   | 100   | 100   | 15,410          | 2027/4/15  |       |
| T 4 1/2 05/15/27 | 4.5   | 300   | 301   | 46,247          | 2027/5/15  |       |
| T 4 1/2 05/31/29 | 4.5   | 500   | 506   | 77,531          | 2029/5/31  |       |
| T 4 1/2 07/15/26 | 4.5   | 200   | 200   | 30,731          | 2026/7/15  |       |
| T 4 1/2 11/15/25 | 4.5   | 300   | 300   | 46,003          | 2025/11/15 |       |
| T 4 1/2 11/15/33 | 4.5   | 900   | 913   | 139,901         | 2033/11/15 |       |
| T 4 1/4 01/31/26 | 4.25  | 600   | 599   | 91,794          | 2026/1/31  |       |
| T 4 1/4 02/15/54 | 4.25  | 400   | 385   | 59,034          | 2054/2/15  |       |
| T 4 1/4 02/28/29 | 4.25  | 500   | 500   | 76,692          | 2029/2/28  |       |
| T 4 1/4 02/28/31 | 4.25  | 200   | 200   | 30,651          | 2031/2/28  |       |
| T 4 1/4 03/15/27 | 4.25  | 500   | 500   | 76,623          | 2027/3/15  |       |
| T 4 1/4 06/30/29 | 4.25  | 400   | 400   | 61,378          | 2029/6/30  |       |
| T 4 1/4 08/15/54 | 4.25  | 500   | 482   | 73,866          | 2054/8/15  |       |
| T 4 1/4 11/15/40 | 4.25  | 100   | 97    | 14,972          | 2040/11/15 |       |
| T 4 1/4 12/31/25 | 4.25  | 700   | 699   | 107,064         | 2025/12/31 |       |
| T 4 1/8 02/15/27 | 4.125 | 500   | 498   | 76,387          | 2027/2/15  |       |
| T 4 1/8 03/31/29 | 4.125 | 300   | 298   | 45,788          | 2029/3/31  |       |
| T 4 1/8 03/31/31 | 4.125 | 100   | 99    | 15,217          | 2031/3/31  |       |
| T 4 1/8 06/15/26 | 4.125 | 500   | 498   | 76,368          | 2026/6/15  |       |
| T 4 1/8 07/31/28 | 4.125 | 500   | 498   | 76,351          | 2028/7/31  |       |
| T 4 1/8 07/31/31 | 4.125 | 500   | 496   | 76,034          | 2031/7/31  |       |

| 銘柄                 | 利率    | 当 期 末  |        |                 |            | 償還年月日 |
|--------------------|-------|--------|--------|-----------------|------------|-------|
|                    |       | 額面金額   | 外貨建金額  | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (アメリカ)<br>国債証券     | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円              |            |       |
| T 4 1/8 08/15/44   | 4.125 | 200    | 188    | 28,862          | 2044/8/15  |       |
| T 4 1/8 08/15/53   | 4.125 | 400    | 376    | 57,687          | 2053/8/15  |       |
| T 4 1/8 08/31/30   | 4.125 | 200    | 198    | 30,468          | 2030/8/31  |       |
| T 4 1/8 09/30/27   | 4.125 | 200    | 199    | 30,572          | 2027/9/30  |       |
| T 4 1/8 10/31/27   | 4.125 | 300    | 299    | 45,845          | 2027/10/31 |       |
| T 4 1/8 11/15/32   | 4.125 | 1,000  | 991    | 151,791         | 2032/11/15 |       |
| T 4 10/31/29       | 4.0   | 300    | 297    | 45,514          | 2029/10/31 |       |
| T 4 11/15/42       | 4.0   | 400    | 374    | 57,279          | 2042/11/15 |       |
| T 4 11/15/52       | 4.0   | 500    | 460    | 70,502          | 2052/11/15 |       |
| T 4 12/15/25       | 4.0   | 300    | 298    | 45,771          | 2025/12/15 |       |
| T 4 3/4 02/15/41   | 4.75  | 100    | 103    | 15,855          | 2041/2/15  |       |
| T 4 3/4 11/15/43   | 4.75  | 400    | 410    | 62,865          | 2043/11/15 |       |
| T 4 3/4 11/15/53   | 4.75  | 500    | 522    | 80,024          | 2053/11/15 |       |
| T 4 3/8 02/15/38   | 4.375 | 100    | 100    | 15,382          | 2038/2/15  |       |
| T 4 3/8 05/15/34   | 4.375 | 700    | 704    | 107,826         | 2034/5/15  |       |
| T 4 3/8 05/15/40   | 4.375 | 100    | 99     | 15,219          | 2040/5/15  |       |
| T 4 3/8 07/15/27   | 4.375 | 300    | 301    | 46,126          | 2027/7/15  |       |
| T 4 3/8 07/31/26   | 4.375 | 700    | 700    | 107,350         | 2026/7/31  |       |
| T 4 3/8 08/15/43   | 4.375 | 200    | 195    | 29,956          | 2043/8/15  |       |
| T 4 3/8 08/31/28   | 4.375 | 100    | 100    | 15,395          | 2028/8/31  |       |
| T 4 3/8 11/15/39   | 4.375 | 300    | 298    | 45,716          | 2039/11/15 |       |
| T 4 3/8 11/30/28   | 4.375 | 500    | 502    | 77,027          | 2028/11/30 |       |
| T 4 3/8 11/30/30   | 4.375 | 300    | 302    | 46,304          | 2030/11/30 |       |
| T 4 3/8 12/15/26   | 4.375 | 500    | 501    | 76,764          | 2026/12/15 |       |
| T 4 5/8 02/28/26   | 4.625 | 500    | 501    | 76,845          | 2026/2/28  |       |
| T 4 5/8 03/15/26   | 4.625 | 100    | 100    | 15,371          | 2026/3/15  |       |
| T 4 5/8 04/30/29   | 4.625 | 200    | 203    | 31,150          | 2029/4/30  |       |
| T 4 5/8 04/30/31   | 4.625 | 200    | 204    | 31,289          | 2031/4/30  |       |
| T 4 5/8 05/15/44   | 4.625 | 200    | 201    | 30,891          | 2044/5/15  |       |
| T 4 5/8 05/15/54   | 4.625 | 400    | 410    | 62,844          | 2054/5/15  |       |
| T 4 5/8 05/31/31   | 4.625 | 500    | 510    | 78,210          | 2031/5/31  |       |
| T 4 5/8 06/30/26   | 4.625 | 700    | 703    | 107,750         | 2026/6/30  |       |
| T 4 5/8 09/15/26   | 4.625 | 800    | 804    | 123,272         | 2026/9/15  |       |
| T 4 5/8 09/30/30   | 4.625 | 200    | 204    | 31,259          | 2030/9/30  |       |
| T 4 5/8 10/15/26   | 4.625 | 200    | 201    | 30,831          | 2026/10/15 |       |
| T 4 5/8 11/15/26   | 4.625 | 500    | 503    | 77,120          | 2026/11/15 |       |
| T 4 7/8 04/30/26   | 4.875 | 100    | 100    | 15,437          | 2026/4/30  |       |
| T 4 7/8 05/31/26   | 4.875 | 600    | 605    | 92,659          | 2026/5/31  |       |
| T 4 7/8 10/31/28   | 4.875 | 1,000  | 1,023  | 156,789         | 2028/10/31 |       |
| T 4 7/8 10/31/30   | 4.875 | 200    | 206    | 31,668          | 2030/10/31 |       |
| T 4 7/8 11/30/25   | 4.875 | 1,000  | 1,005  | 153,936         | 2025/11/30 |       |
| T 5 05/15/37       | 5.0   | 50     | 53     | 8,173           | 2037/5/15  |       |
| T 5 10/31/25       | 5.0   | 1,000  | 1,005  | 154,043         | 2025/10/31 |       |
| T 5 3/8 02/15/31   | 5.375 | 100    | 106    | 16,314          | 2031/2/15  |       |
| 小 計                |       |        |        | 11,332,877      |            |       |
| (カナダ)<br>国債証券      |       | 千カナダドル | 千カナダドル |                 |            |       |
| CAN 0 1/2 12/01/30 | 0.5   | 300    | 257    | 28,366          | 2030/12/1  |       |
| CAN 0 1/4 03/01/26 | 0.25  | 100    | 96     | 10,606          | 2026/3/1   |       |

| 銘柄                   | 利率   | 当 期 末   |         |                 |            | 償還年月日 |
|----------------------|------|---------|---------|-----------------|------------|-------|
|                      |      | 額面金額    | 外貨建金額   | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (カナダ)<br>国債証券        | %    | 千カナダドル  | 千カナダドル  | 千円              |            |       |
| CAN 1 06/01/27       | 1.0  | 100     | 95      | 10,488          | 2027/6/1   |       |
| CAN 1 1/2 06/01/26   | 1.5  | 100     | 97      | 10,751          | 2026/6/1   |       |
| CAN 1 1/2 06/01/31   | 1.5  | 200     | 181     | 19,923          | 2031/6/1   |       |
| CAN 1 1/2 12/01/31   | 1.5  | 200     | 179     | 19,777          | 2031/12/1  |       |
| CAN 1 1/4 06/01/30   | 1.25 | 100     | 90      | 9,997           | 2030/6/1   |       |
| CAN 1 3/4 12/01/53   | 1.75 | 200     | 145     | 16,027          | 2053/12/1  |       |
| CAN 2 06/01/28       | 2.0  | 100     | 96      | 10,655          | 2028/6/1   |       |
| CAN 2 06/01/32       | 2.0  | 100     | 92      | 10,169          | 2032/6/1   |       |
| CAN 2 1/2 12/01/32   | 2.5  | 200     | 190     | 21,004          | 2032/12/1  |       |
| CAN 2 1/4 06/01/29   | 2.25 | 100     | 97      | 10,696          | 2029/6/1   |       |
| CAN 2 12/01/51       | 2.0  | 200     | 156     | 17,197          | 2051/12/1  |       |
| CAN 2 3/4 09/01/27   | 2.75 | 100     | 99      | 10,927          | 2027/9/1   |       |
| CAN 2 3/4 12/01/48   | 2.75 | 100     | 92      | 10,160          | 2048/12/1  |       |
| CAN 2 3/4 12/01/55   | 2.75 | 200     | 182     | 20,092          | 2055/12/1  |       |
| CAN 3 04/01/26       | 3.0  | 100     | 99      | 10,986          | 2026/4/1   |       |
| CAN 3 06/01/34       | 3.0  | 100     | 98      | 10,844          | 2034/6/1   |       |
| CAN 3 1/2 03/01/34   | 3.5  | 100     | 102     | 11,289          | 2034/3/1   |       |
| CAN 3 1/2 09/01/29   | 3.5  | 100     | 102     | 11,243          | 2029/9/1   |       |
| CAN 3 1/2 12/01/45   | 3.5  | 100     | 104     | 11,499          | 2045/12/1  |       |
| CAN 3 1/4 09/01/28   | 3.25 | 200     | 201     | 22,213          | 2028/9/1   |       |
| CAN 3 1/4 11/01/26   | 3.25 | 100     | 100     | 11,042          | 2026/11/1  |       |
| CAN 3 1/4 12/01/33   | 3.25 | 100     | 100     | 11,074          | 2033/12/1  |       |
| CAN 3 1/4 12/01/34   | 3.25 | 100     | 100     | 11,066          | 2034/12/1  |       |
| CAN 3 10/01/25       | 3.0  | 100     | 99      | 10,983          | 2025/10/1  |       |
| CAN 4 03/01/29       | 4.0  | 200     | 208     | 22,894          | 2029/3/1   |       |
| CAN 4 05/01/26       | 4.0  | 200     | 202     | 22,282          | 2026/5/1   |       |
| CAN 4 06/01/41       | 4.0  | 100     | 110     | 12,137          | 2041/6/1   |       |
| CAN 4 1/2 02/01/26   | 4.5  | 100     | 101     | 11,180          | 2026/2/1   |       |
| CAN 4 1/2 11/01/25   | 4.5  | 200     | 202     | 22,275          | 2025/11/1  |       |
| CAN 5 3/4 06/01/33   | 5.75 | 200     | 238     | 26,200          | 2033/6/1   |       |
| 小 計                  |      |         |         | 476,059         |            |       |
| (メキシコ)<br>国債証券       |      | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ |                 |            |       |
| MBONO 10 11/20/36    | 10.0 | 500     | 505     | 3,843           | 2036/11/20 |       |
| MBONO 5 1/2 03/04/27 | 5.5  | 2,700   | 2,463   | 18,745          | 2027/3/4   |       |
| MBONO 5 3/4 03/05/26 | 5.75 | 2,200   | 2,085   | 15,871          | 2026/3/5   |       |
| MBONO 7 09/03/26     | 7.0  | 2,400   | 2,285   | 17,392          | 2026/9/3   |       |
| MBONO 7 1/2 05/26/33 | 7.5  | 1,900   | 1,646   | 12,529          | 2033/5/26  |       |
| MBONO 7 1/2 06/03/27 | 7.5  | 1,700   | 1,616   | 12,298          | 2027/6/3   |       |
| MBONO 7 3/4 05/29/31 | 7.75 | 2,400   | 2,177   | 16,571          | 2031/5/29  |       |
| MBONO 7 3/4 11/13/42 | 7.75 | 2,200   | 1,774   | 13,504          | 2042/11/13 |       |
| MBONO 7 3/4 11/23/34 | 7.75 | 1,400   | 1,216   | 9,254           | 2034/11/23 |       |
| MBONO 8 05/24/35     | 8.0  | 100     | 87      | 669             | 2035/5/24  |       |
| MBONO 8 07/31/53     | 8.0  | 2,200   | 1,775   | 13,510          | 2053/7/31  |       |
| MBONO 8 1/2 03/01/29 | 8.5  | 2,100   | 2,005   | 15,264          | 2029/3/1   |       |
| MBONO 8 1/2 05/31/29 | 8.5  | 1,500   | 1,432   | 10,904          | 2029/5/31  |       |
| MBONO 8 1/2 11/18/38 | 8.5  | 1,300   | 1,160   | 8,835           | 2038/11/18 |       |
| MBONO 8 11/07/47     | 8.0  | 1,500   | 1,223   | 9,311           | 2047/11/7  |       |
| 小 計                  |      |         |         | 178,506         |            |       |

| 銘柄                 | 利率   | 当 期 末 |       |        |            |
|--------------------|------|-------|-------|--------|------------|
|                    |      | 額面金額  | 評 価 額 | 外貨建金額  | 償還年月日      |
|                    |      | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円     |            |
| (ユーロ…ドイツ)          |      |       |       |        |            |
| 国債証券               |      |       |       |        |            |
| BKO 2 1/2 03/19/26 | 2.5  | 100   | 100   | 16,452 | 2026/3/19  |
| BKO 2 12/10/26     | 2.0  | 100   | 99    | 16,344 | 2026/12/10 |
| BKO 2.9 06/18/26   | 2.9  | 100   | 101   | 16,569 | 2026/6/18  |
| BKO 3.1 12/12/25   | 3.1  | 200   | 201   | 33,062 | 2025/12/12 |
| DBR 0 02/15/30     | —    | 100   | 89    | 14,681 | 2030/2/15  |
| DBR 0 02/15/31     | —    | 200   | 175   | 28,713 | 2031/2/15  |
| DBR 0 02/15/32     | —    | 200   | 170   | 27,987 | 2032/2/15  |
| DBR 0 05/15/35     | —    | 100   | 77    | 12,773 | 2035/5/15  |
| DBR 0 05/15/36     | —    | 200   | 151   | 24,809 | 2036/5/15  |
| DBR 0 08/15/26     | —    | 100   | 96    | 15,802 | 2026/8/15  |
| DBR 0 08/15/29     | —    | 200   | 181   | 29,711 | 2029/8/15  |
| DBR 0 08/15/30     | —    | 400   | 354   | 58,114 | 2030/8/15  |
| DBR 0 08/15/31     | —    | 300   | 259   | 42,552 | 2031/8/15  |
| DBR 0 08/15/50     | —    | 300   | 156   | 25,707 | 2050/8/15  |
| DBR 0 08/15/52     | —    | 200   | 99    | 16,295 | 2052/8/15  |
| DBR 0 1/2 02/15/26 | 0.5  | 100   | 97    | 16,055 | 2026/2/15  |
| DBR 0 1/4 02/15/27 | 0.25 | 100   | 96    | 15,751 | 2027/2/15  |
| DBR 0 1/4 02/15/29 | 0.25 | 100   | 92    | 15,198 | 2029/2/15  |
| DBR 0 1/4 08/15/28 | 0.25 | 300   | 280   | 46,031 | 2028/8/15  |
| DBR 0 11/15/27     | —    | 200   | 187   | 30,824 | 2027/11/15 |
| DBR 0 11/15/28     | —    | 300   | 276   | 45,321 | 2028/11/15 |
| DBR 1 05/15/38     | 1.0  | 200   | 165   | 27,082 | 2038/5/15  |
| DBR 1 1/4 08/15/48 | 1.25 | 200   | 153   | 25,148 | 2048/8/15  |
| DBR 1.7 08/15/32   | 1.7  | 200   | 192   | 31,560 | 2032/8/15  |
| DBR 1.8 08/15/53   | 1.8  | 200   | 168   | 27,614 | 2053/8/15  |
| DBR 2 1/2 07/04/44 | 2.5  | 200   | 197   | 32,338 | 2044/7/4   |
| DBR 2 1/2 08/15/46 | 2.5  | 200   | 197   | 32,324 | 2046/8/15  |
| DBR 2 1/2 08/15/54 | 2.5  | 100   | 98    | 16,080 | 2054/8/15  |
| DBR 2.1 11/15/29   | 2.1  | 200   | 199   | 32,658 | 2029/11/15 |
| DBR 2.2 02/15/34   | 2.2  | 200   | 197   | 32,435 | 2034/2/15  |
| DBR 2.3 02/15/33   | 2.3  | 100   | 100   | 16,423 | 2033/2/15  |
| DBR 2.3 02/15/33   | 2.3  | 300   | 300   | 49,299 | 2033/2/15  |
| DBR 2.4 11/15/30   | 2.4  | 200   | 201   | 33,127 | 2030/11/15 |
| DBR 2.6 05/15/41   | 2.6  | 100   | 99    | 16,398 | 2041/5/15  |
| DBR 2.6 08/15/33   | 2.6  | 100   | 102   | 16,777 | 2033/8/15  |
| DBR 2.6 08/15/34   | 2.6  | 200   | 204   | 33,473 | 2034/8/15  |
| DBR 3 1/4 07/04/42 | 3.25 | 100   | 109   | 17,923 | 2042/7/4   |
| DBR 4 01/04/37     | 4.0  | 200   | 231   | 37,963 | 2037/1/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/34 | 4.75 | 100   | 120   | 19,766 | 2034/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/40 | 4.75 | 100   | 127   | 20,968 | 2040/7/4   |
| DBR 4.25 07/04/39  | 4.25 | 100   | 120   | 19,756 | 2039/7/4   |
| DBR 5.5 01/04/31   | 5.5  | 100   | 118   | 19,455 | 2031/1/4   |
| DBR 6.5 07/04/27   | 6.5  | 100   | 111   | 18,226 | 2027/7/4   |
| OBL 0 04/10/26     | —    | 200   | 193   | 31,818 | 2026/4/10  |
| OBL 0 04/16/27     | —    | 200   | 190   | 31,188 | 2027/4/16  |
| OBL 0 10/09/26     | —    | 300   | 288   | 47,268 | 2026/10/9  |
| OBL 1.3 10/15/27   | 1.3  | 400   | 391   | 64,178 | 2027/10/15 |
| OBL 2.1 04/12/29   | 2.1  | 100   | 99    | 16,350 | 2029/4/12  |
| OBL 2.1 04/12/29   | 2.1  | 200   | 199   | 32,711 | 2029/4/12  |

| 銘柄                  | 利率   | 当 期 末 |       |        |            |
|---------------------|------|-------|-------|--------|------------|
|                     |      | 額面金額  | 評 価 額 | 外貨建金額  | 償還年月日      |
|                     |      | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円     |            |
| (ユーロ…ドイツ)           |      |       |       |        |            |
| 国債証券                |      |       |       |        |            |
| OBL 2.2 04/13/28    | 2.2  | 100   | 100   | 16,450 | 2028/4/13  |
| OBL 2.4 10/19/28    | 2.4  | 300   | 302   | 49,681 | 2028/10/19 |
| (ユーロ…イタリア)          |      |       |       |        |            |
| 国債証券                |      |       |       |        |            |
| BTPS 0 04/01/26     | —    | 200   | 192   | 31,655 | 2026/4/1   |
| BTPS 0 08/01/26     | —    | 200   | 191   | 31,396 | 2026/8/1   |
| BTPS 0 1/2 02/01/26 | 0.5  | 100   | 97    | 15,979 | 2026/2/1   |
| BTPS 0 1/2 07/15/28 | 0.5  | 100   | 92    | 15,106 | 2028/7/15  |
| BTPS 0 1/4 03/15/28 | 0.25 | 100   | 92    | 15,104 | 2028/3/15  |
| BTPS 0.45 02/15/29  | 0.45 | 100   | 90    | 14,821 | 2029/2/15  |
| BTPS 0.6 08/01/31   | 0.6  | 100   | 84    | 13,834 | 2031/8/1   |
| BTPS 0.85 01/15/27  | 0.85 | 300   | 288   | 47,397 | 2027/1/15  |
| BTPS 0.9 04/01/31   | 0.9  | 100   | 86    | 14,251 | 2031/4/1   |
| BTPS 0.95 03/01/37  | 0.95 | 200   | 145   | 23,907 | 2037/3/1   |
| BTPS 0.95 06/01/32  | 0.95 | 100   | 84    | 13,853 | 2032/6/1   |
| BTPS 0.95 08/01/30  | 0.95 | 200   | 177   | 29,120 | 2030/8/1   |
| BTPS 0.95 12/01/31  | 0.95 | 200   | 171   | 28,102 | 2031/12/1  |
| BTPS 1 1/2 04/30/45 | 1.5  | 100   | 65    | 10,777 | 2045/4/30  |
| BTPS 1.1 04/01/27   | 1.1  | 100   | 96    | 15,831 | 2027/4/1   |
| BTPS 1.45 03/01/36  | 1.45 | 100   | 79    | 13,074 | 2036/3/1   |
| BTPS 1.6 06/01/26   | 1.6  | 200   | 197   | 32,325 | 2026/6/1   |
| BTPS 1.65 03/01/32  | 1.65 | 100   | 89    | 14,706 | 2032/3/1   |
| BTPS 1.65 12/01/30  | 1.65 | 200   | 183   | 30,102 | 2030/12/1  |
| BTPS 1.7 09/01/51   | 1.7  | 100   | 62    | 10,280 | 2051/9/1   |
| BTPS 1.8 03/01/41   | 1.8  | 100   | 74    | 12,182 | 2041/3/1   |
| BTPS 2 02/01/28     | 2.0  | 100   | 97    | 16,045 | 2028/2/1   |
| BTPS 2 1/2 12/01/32 | 2.5  | 200   | 188   | 30,875 | 2032/12/1  |
| BTPS 2 1/4 09/01/36 | 2.25 | 100   | 86    | 14,177 | 2036/9/1   |
| BTPS 2 12/01/25     | 2.0  | 100   | 99    | 16,298 | 2025/12/1  |
| BTPS 2.15 09/01/52  | 2.15 | 100   | 68    | 11,209 | 2052/9/1   |
| BTPS 2.45 09/01/33  | 2.45 | 100   | 92    | 15,219 | 2033/9/1   |
| BTPS 2.45 09/01/50  | 2.45 | 100   | 74    | 12,211 | 2050/9/1   |
| BTPS 2.65 12/01/27  | 2.65 | 300   | 299   | 49,120 | 2027/12/1  |
| BTPS 2.7 03/01/47   | 2.7  | 100   | 80    | 13,209 | 2047/3/1   |
| BTPS 2.8 03/01/67   | 2.8  | 100   | 75    | 12,397 | 2067/3/1   |
| BTPS 2.8 06/15/29   | 2.8  | 100   | 99    | 16,297 | 2029/6/15  |
| BTPS 2.8 12/01/28   | 2.8  | 100   | 99    | 16,400 | 2028/12/1  |
| BTPS 2.95 02/15/27  | 2.95 | 100   | 100   | 16,500 | 2027/2/15  |
| BTPS 2.95 09/01/38  | 2.95 | 100   | 90    | 14,881 | 2038/9/1   |
| BTPS 3 08/01/29     | 3.0  | 200   | 200   | 32,910 | 2029/8/1   |
| BTPS 3 1/2 01/15/26 | 3.5  | 100   | 100   | 16,551 | 2026/1/15  |
| BTPS 3 1/2 02/15/31 | 3.5  | 100   | 101   | 16,668 | 2031/2/15  |
| BTPS 3 1/2 03/01/30 | 3.5  | 100   | 102   | 16,818 | 2030/3/1   |
| BTPS 3 1/4 03/01/38 | 3.25 | 100   | 94    | 15,420 | 2038/3/1   |
| BTPS 3 1/4 09/01/46 | 3.25 | 100   | 88    | 14,524 | 2046/9/1   |
| BTPS 3.1 03/01/40   | 3.1  | 100   | 90    | 14,858 | 2040/3/1   |
| BTPS 3.1 08/28/26   | 3.1  | 100   | 100   | 16,521 | 2026/8/28  |
| BTPS 3.15 11/15/31  | 3.15 | 100   | 99    | 16,244 | 2031/11/15 |
| BTPS 3.2 01/28/26   | 3.2  | 100   | 100   | 16,496 | 2026/1/28  |

| 銘柄                  | 利率   | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|---------------------|------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                     |      | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (ユーロ…イタリア)          | %    | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円              |            |       |
| 国債証券                |      |       |       |                 |            |       |
| BTPS 3.35 03/01/35  | 3.35 | 100   | 98    | 16,094          | 2035/3/1   |       |
| BTPS 3.35 07/01/29  | 3.35 | 200   | 203   | 33,324          | 2029/7/1   |       |
| BTPS 3.4 04/01/28   | 3.4  | 100   | 101   | 16,730          | 2028/4/1   |       |
| BTPS 3.45 03/01/48  | 3.45 | 100   | 90    | 14,870          | 2048/3/1   |       |
| BTPS 3.45 07/15/27  | 3.45 | 200   | 203   | 33,429          | 2027/7/15  |       |
| BTPS 3.45 07/15/31  | 3.45 | 200   | 202   | 33,185          | 2031/7/15  |       |
| BTPS 3.6 09/29/25   | 3.6  | 100   | 100   | 16,520          | 2025/9/29  |       |
| BTPS 3.7 06/15/30   | 3.7  | 100   | 102   | 16,891          | 2030/6/15  |       |
| BTPS 3.8 04/15/26   | 3.8  | 100   | 101   | 16,660          | 2026/4/15  |       |
| BTPS 3.8 08/01/28   | 3.8  | 300   | 310   | 50,871          | 2028/8/1   |       |
| BTPS 3.85 02/01/35  | 3.85 | 100   | 101   | 16,724          | 2035/2/1   |       |
| BTPS 3.85 07/01/34  | 3.85 | 100   | 102   | 16,795          | 2034/7/1   |       |
| BTPS 3.85 09/01/49  | 3.85 | 100   | 96    | 15,761          | 2049/9/1   |       |
| BTPS 3.85 09/15/26  | 3.85 | 200   | 204   | 33,502          | 2026/9/15  |       |
| BTPS 3.85 12/15/29  | 3.85 | 200   | 207   | 34,078          | 2029/12/15 |       |
| BTPS 4 02/01/37     | 4.0  | 100   | 103   | 16,943          | 2037/2/1   |       |
| BTPS 4 04/30/35     | 4.0  | 100   | 103   | 17,051          | 2035/4/30  |       |
| BTPS 4 1/2 10/01/53 | 4.5  | 100   | 105   | 17,256          | 2053/10/1  |       |
| BTPS 4 10/30/31     | 4.0  | 100   | 104   | 17,214          | 2031/10/30 |       |
| BTPS 4 11/15/30     | 4.0  | 200   | 208   | 34,281          | 2030/11/15 |       |
| BTPS 4 3/4 09/01/28 | 4.75 | 100   | 106   | 17,541          | 2028/9/1   |       |
| BTPS 4 3/4 09/01/44 | 4.75 | 100   | 109   | 17,963          | 2044/9/1   |       |
| BTPS 4.05 10/30/37  | 4.05 | 100   | 102   | 16,879          | 2037/10/30 |       |
| BTPS 4.1 02/01/29   | 4.1  | 100   | 104   | 17,165          | 2029/2/1   |       |
| BTPS 4.15 10/01/39  | 4.15 | 200   | 204   | 33,604          | 2039/10/1  |       |
| BTPS 4.2 03/01/34   | 4.2  | 100   | 105   | 17,292          | 2034/3/1   |       |
| BTPS 4.3 10/01/54   | 4.3  | 100   | 100   | 16,535          | 2054/10/1  |       |
| BTPS 4.35 11/01/33  | 4.35 | 200   | 213   | 35,022          | 2033/11/1  |       |
| BTPS 4.4 05/01/33   | 4.4  | 100   | 107   | 17,611          | 2033/5/1   |       |
| BTPS 4.45 09/01/43  | 4.45 | 100   | 104   | 17,220          | 2043/9/1   |       |
| BTPS 5 08/01/34     | 5.0  | 200   | 223   | 36,734          | 2034/8/1   |       |
| BTPS 5 08/01/39     | 5.0  | 100   | 112   | 18,392          | 2039/8/1   |       |
| BTPS 5 09/01/40     | 5.0  | 100   | 112   | 18,377          | 2040/9/1   |       |
| BTPS 5 3/4 02/01/33 | 5.75 | 100   | 116   | 19,145          | 2033/2/1   |       |
| BTPS 6 05/01/31     | 6.0  | 100   | 116   | 19,128          | 2031/5/1   |       |
| BTPS 6 1/2 11/01/27 | 6.5  | 100   | 110   | 18,184          | 2027/11/1  |       |
| BTPS 7 1/4 11/01/26 | 7.25 | 100   | 108   | 17,873          | 2026/11/1  |       |
| (ユーロ…フランス)          |      |       |       |                 |            |       |
| 国債証券                |      |       |       |                 |            |       |
| FRTR 0 02/25/26     | —    | 300   | 291   | 47,755          | 2026/2/25  |       |
| FRTR 0 02/25/27     | —    | 500   | 473   | 77,656          | 2027/2/25  |       |
| FRTR 0 05/25/32     | —    | 100   | 80    | 13,227          | 2032/5/25  |       |
| FRTR 0 1/2 05/25/26 | 0.5  | 100   | 97    | 15,952          | 2026/5/25  |       |
| FRTR 0 1/2 05/25/29 | 0.5  | 200   | 181   | 29,815          | 2029/5/25  |       |
| FRTR 0 1/2 05/25/40 | 0.5  | 200   | 131   | 21,575          | 2040/5/25  |       |
| FRTR 0 1/2 05/25/72 | 0.5  | 100   | 36    | 5,929           | 2072/5/25  |       |
| FRTR 0 1/2 06/25/44 | 0.5  | 100   | 58    | 9,673           | 2044/6/25  |       |
| FRTR 0 1/4 11/25/26 | 0.25 | 300   | 287   | 47,137          | 2026/11/25 |       |
| FRTR 0 11/25/29     | —    | 300   | 262   | 43,042          | 2029/11/25 |       |

| 銘柄                    | 利率   | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|-----------------------|------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                       |      | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 債 額        |       |
| (ユーロ…フランス)            | %    | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円              |            |       |
| 国債証券                  |      |       |       |                 |            |       |
| FRTR 0 11/25/30       | —    | 500   | 424   | 69,569          | 2030/11/25 |       |
| FRTR 0 11/25/31       | —    | 600   | 492   | 80,769          | 2031/11/25 |       |
| FRTR 0 3/4 02/25/28   | 0.75 | 700   | 660   | 108,413         | 2028/2/25  |       |
| FRTR 0 3/4 05/25/28   | 0.75 | 100   | 93    | 15,409          | 2028/5/25  |       |
| FRTR 0 3/4 05/25/52   | 0.75 | 200   | 103   | 17,022          | 2052/5/25  |       |
| FRTR 0 3/4 05/25/53   | 0.75 | 200   | 101   | 16,591          | 2053/5/25  |       |
| FRTR 0 3/4 11/25/28   | 0.75 | 300   | 278   | 45,742          | 2028/11/25 |       |
| FRTR 1 05/25/27       | 1.0  | 300   | 289   | 47,489          | 2027/5/25  |       |
| FRTR 1 1/2 05/25/31   | 1.5  | 200   | 184   | 30,287          | 2031/5/25  |       |
| FRTR 1 1/2 05/25/50   | 1.5  | 200   | 132   | 21,761          | 2050/5/25  |       |
| FRTR 1 1/4 05/25/34   | 1.25 | 300   | 255   | 41,902          | 2034/5/25  |       |
| FRTR 1 1/4 05/25/36   | 1.25 | 300   | 244   | 40,094          | 2036/5/25  |       |
| FRTR 1 1/4 05/25/38   | 1.25 | 300   | 233   | 38,254          | 2038/5/25  |       |
| FRTR 1 11/25/25       | 1.0  | 300   | 295   | 48,482          | 2025/11/25 |       |
| FRTR 1 3/4 05/25/66   | 1.75 | 100   | 62    | 10,274          | 2066/5/25  |       |
| FRTR 1 3/4 06/25/39   | 1.75 | 200   | 164   | 27,029          | 2039/6/25  |       |
| FRTR 2 05/25/48       | 2.0  | 200   | 152   | 25,029          | 2048/5/25  |       |
| FRTR 2 1/2 05/25/30   | 2.5  | 200   | 197   | 32,430          | 2030/5/25  |       |
| FRTR 2 1/2 05/25/43   | 2.5  | 100   | 87    | 14,308          | 2043/5/25  |       |
| FRTR 2 1/2 09/24/26   | 2.5  | 500   | 500   | 82,163          | 2026/9/24  |       |
| FRTR 2 1/2 09/24/27   | 2.5  | 300   | 300   | 49,212          | 2027/9/24  |       |
| FRTR 2 11/25/32       | 2.0  | 500   | 466   | 76,487          | 2032/11/25 |       |
| FRTR 2 3/4 02/25/29   | 2.75 | 500   | 501   | 82,299          | 2029/2/25  |       |
| FRTR 2 3/4 02/25/30   | 2.75 | 200   | 200   | 32,809          | 2030/2/25  |       |
| FRTR 3 05/25/33       | 3.0  | 200   | 199   | 32,806          | 2033/5/25  |       |
| FRTR 3 05/25/54       | 3.0  | 200   | 178   | 29,260          | 2054/5/25  |       |
| FRTR 3 06/25/49       | 3.0  | 100   | 92    | 15,095          | 2049/6/25  |       |
| FRTR 3 1/2 04/25/26   | 3.5  | 200   | 203   | 33,327          | 2026/4/25  |       |
| FRTR 3 1/2 11/25/33   | 3.5  | 300   | 310   | 50,982          | 2033/11/25 |       |
| FRTR 3 1/4 05/25/45   | 3.25 | 200   | 194   | 31,887          | 2045/5/25  |       |
| FRTR 3 1/4 05/25/55   | 3.25 | 100   | 93    | 15,285          | 2055/5/25  |       |
| FRTR 3 11/25/34       | 3.0  | 200   | 198   | 32,482          | 2034/11/25 |       |
| FRTR 4 04/25/55       | 4.0  | 100   | 107   | 17,596          | 2055/4/25  |       |
| FRTR 4 04/25/60       | 4.0  | 100   | 107   | 17,702          | 2060/4/25  |       |
| FRTR 4 10/25/38       | 4.0  | 100   | 107   | 17,707          | 2038/10/25 |       |
| FRTR 4 3/4 04/25/35   | 4.75 | 200   | 228   | 37,524          | 2035/4/25  |       |
| FRTR 5 1/2 04/25/29   | 5.5  | 200   | 223   | 36,650          | 2029/4/25  |       |
| FRTR 5 3/4 10/25/32   | 5.75 | 200   | 239   | 39,303          | 2032/10/25 |       |
| FRTR 4.5 04/25/41     | 4.5  | 200   | 228   | 37,455          | 2041/4/25  |       |
| (ユーロ…オランダ)            |      |       |       |                 |            |       |
| 国債証券                  |      |       |       |                 |            |       |
| NETHER 0 01/15/27     | —    | 100   | 95    | 15,653          | 2027/1/15  |       |
| NETHER 0 01/15/29     | —    | 200   | 181   | 29,832          | 2029/1/15  |       |
| NETHER 0 01/15/38     | —    | 100   | 69    | 11,435          | 2038/1/15  |       |
| NETHER 0 01/15/52     | —    | 100   | 48    | 7,980           | 2052/1/15  |       |
| NETHER 0 07/15/30     | —    | 100   | 87    | 14,346          | 2030/7/15  |       |
| NETHER 0 07/15/31     | —    | 100   | 85    | 13,975          | 2031/7/15  |       |
| NETHER 0 1/2 01/15/40 | 0.5  | 100   | 72    | 11,836          | 2040/1/15  |       |
| NETHER 0 1/2 07/15/26 | 0.5  | 100   | 97    | 15,950          | 2026/7/15  |       |

| 銘柄                    | 利率   | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|-----------------------|------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                       |      | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 額          |       |
| (ユーロ…オランダ)<br>国債証券    | %    | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円              |            |       |
| NETHER 0 1/2 07/15/32 | 0.5  | 100   | 86    | 14,154          | 2032/7/15  |       |
| NETHER 0 3/4 07/15/27 | 0.75 | 100   | 96    | 15,786          | 2027/7/15  |       |
| NETHER 0 3/4 07/15/28 | 0.75 | 100   | 94    | 15,536          | 2028/7/15  |       |
| NETHER 2 01/15/54     | 2.0  | 100   | 85    | 13,954          | 2054/1/15  |       |
| NETHER 2 1/2 01/15/30 | 2.5  | 100   | 100   | 16,503          | 2030/1/15  |       |
| NETHER 2 1/2 01/15/33 | 2.5  | 100   | 99    | 16,374          | 2033/1/15  |       |
| NETHER 2 1/2 07/15/33 | 2.5  | 100   | 99    | 16,319          | 2033/7/15  |       |
| NETHER 2 1/2 07/15/34 | 2.5  | 100   | 99    | 16,243          | 2034/7/15  |       |
| NETHER 2 3/4 01/15/47 | 2.75 | 100   | 99    | 16,374          | 2047/1/15  |       |
| NETHER 3 3/4 01/15/42 | 3.75 | 100   | 113   | 18,549          | 2042/1/15  |       |
| NETHER 4 01/15/37     | 4.0  | 100   | 113   | 18,562          | 2037/1/15  |       |
| NETHER 5 1/2 01/15/28 | 5.5  | 100   | 109   | 18,025          | 2028/1/15  |       |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券    |      |       |       |                 |            |       |
| SPGB 0 01/31/26       | —    | 200   | 194   | 31,834          | 2026/1/31  |       |
| SPGB 0 01/31/27       | —    | 300   | 284   | 46,636          | 2027/1/31  |       |
| SPGB 0 01/31/28       | —    | 500   | 461   | 75,690          | 2028/1/31  |       |
| SPGB 0 1/2 10/31/31   | 0.5  | 200   | 171   | 28,075          | 2031/10/31 |       |
| SPGB 0.1 04/30/31     | 0.1  | 100   | 84    | 13,846          | 2031/4/30  |       |
| SPGB 0.6 10/31/29     | 0.6  | 100   | 90    | 14,850          | 2029/10/31 |       |
| SPGB 0.8 07/30/27     | 0.8  | 200   | 191   | 31,376          | 2027/7/30  |       |
| SPGB 0.8 07/30/29     | 0.8  | 300   | 275   | 45,223          | 2029/7/30  |       |
| SPGB 0.85 07/30/37    | 0.85 | 100   | 74    | 12,244          | 2037/7/30  |       |
| SPGB 1 07/30/42       | 1.0  | 100   | 67    | 11,043          | 2042/7/30  |       |
| SPGB 1 1/4 10/31/30   | 1.25 | 300   | 275   | 45,225          | 2030/10/31 |       |
| SPGB 1 10/31/50       | 1.0  | 100   | 56    | 9,237           | 2050/10/31 |       |
| SPGB 1.2 10/31/40     | 1.2  | 200   | 144   | 23,736          | 2040/10/31 |       |
| SPGB 1.3 10/31/26     | 1.3  | 200   | 195   | 32,124          | 2026/10/31 |       |
| SPGB 1.4 07/30/28     | 1.4  | 100   | 96    | 15,751          | 2028/7/30  |       |
| SPGB 1.45 04/30/29    | 1.45 | 100   | 95    | 15,614          | 2029/4/30  |       |
| SPGB 1.45 10/31/27    | 1.45 | 100   | 97    | 15,923          | 2027/10/31 |       |
| SPGB 1.85 07/30/35    | 1.85 | 200   | 176   | 28,994          | 2035/7/30  |       |
| SPGB 1.9 10/31/52     | 1.9  | 100   | 69    | 11,334          | 2052/10/31 |       |
| SPGB 1.95 04/30/26    | 1.95 | 100   | 99    | 16,299          | 2026/4/30  |       |
| SPGB 1.95 07/30/30    | 1.95 | 200   | 192   | 31,515          | 2030/7/30  |       |
| SPGB 2 1/2 05/31/27   | 2.5  | 100   | 99    | 16,403          | 2027/5/31  |       |
| SPGB 2.35 07/30/33    | 2.35 | 200   | 190   | 31,267          | 2033/7/30  |       |
| SPGB 2.55 10/31/32    | 2.55 | 400   | 390   | 63,983          | 2032/10/31 |       |
| SPGB 2.7 10/31/48     | 2.7  | 100   | 85    | 13,998          | 2048/10/31 |       |
| SPGB 2.8 05/31/26     | 2.8  | 300   | 301   | 49,453          | 2026/5/31  |       |
| SPGB 2.9 10/31/46     | 2.9  | 100   | 89    | 14,697          | 2046/10/31 |       |
| SPGB 3 1/2 05/31/29   | 3.5  | 200   | 207   | 34,003          | 2029/5/31  |       |
| SPGB 3 1/4 04/30/34   | 3.25 | 200   | 203   | 33,318          | 2034/4/30  |       |
| SPGB 3.1 07/30/31     | 3.1  | 100   | 101   | 16,686          | 2031/7/30  |       |
| SPGB 3.45 07/30/43    | 3.45 | 100   | 98    | 16,094          | 2043/7/30  |       |
| SPGB 3.45 07/30/66    | 3.45 | 100   | 92    | 15,237          | 2066/7/30  |       |
| SPGB 3.45 10/31/34    | 3.45 | 100   | 102   | 16,888          | 2034/10/31 |       |
| SPGB 3.55 10/31/33    | 3.55 | 200   | 208   | 34,176          | 2033/10/31 |       |
| SPGB 3.9 07/30/39     | 3.9  | 100   | 105   | 17,288          | 2039/7/30  |       |

| 銘柄                   | 利率   | 当 期 末 |       |                 |            | 償還年月日 |
|----------------------|------|-------|-------|-----------------|------------|-------|
|                      |      | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 額          |       |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券   | %    | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円              |            |       |
| SPGB 4 10/31/54      | 4.0  | 100   | 104   | 17,088          | 2054/10/31 |       |
| SPGB 4.2 01/31/37    | 4.2  | 100   | 109   | 17,970          | 2037/1/31  |       |
| SPGB 4.7 07/30/41    | 4.7  | 100   | 115   | 18,908          | 2041/7/30  |       |
| SPGB 4.9 07/30/40    | 4.9  | 100   | 117   | 19,238          | 2040/7/30  |       |
| SPGB 5 3/4 07/30/32  | 5.75 | 100   | 119   | 19,647          | 2032/7/30  |       |
| SPGB 5.15 10/31/28   | 5.15 | 100   | 109   | 17,984          | 2028/10/31 |       |
| SPGB 5.15 10/31/44   | 5.15 | 100   | 122   | 20,071          | 2044/10/31 |       |
| SPGB 6 01/31/29      | 6.0  | 100   | 113   | 18,634          | 2029/1/31  |       |
| (ユーロ…ベルギー)<br>国債証券   |      |       |       |                 |            |       |
| BGB 0 10/22/27       | —    | 100   | 93    | 15,298          | 2027/10/22 |       |
| BGB 0 10/22/31       | —    | 100   | 82    | 13,604          | 2031/10/22 |       |
| BGB 0.1 06/22/30     | 0.1  | 100   | 87    | 14,283          | 2030/6/22  |       |
| BGB 0.35 06/22/32    | 0.35 | 200   | 166   | 27,337          | 2032/6/22  |       |
| BGB 0.4 06/22/40     | 0.4  | 100   | 65    | 10,719          | 2040/6/22  |       |
| BGB 0.8 06/22/27     | 0.8  | 100   | 96    | 15,761          | 2027/6/22  |       |
| BGB 0.8 06/22/28     | 0.8  | 100   | 94    | 15,480          | 2028/6/22  |       |
| BGB 0.9 06/22/29     | 0.9  | 100   | 92    | 15,244          | 2029/6/22  |       |
| BGB 1 06/22/26       | 1.0  | 200   | 195   | 32,117          | 2026/6/22  |       |
| BGB 1 06/22/31       | 1.0  | 100   | 89    | 14,741          | 2031/6/22  |       |
| BGB 1 1/4 04/22/33   | 1.25 | 100   | 88    | 14,532          | 2033/4/22  |       |
| BGB 1.4 06/22/53     | 1.4  | 100   | 62    | 10,301          | 2053/6/22  |       |
| BGB 1.6 06/22/47     | 1.6  | 100   | 71    | 11,809          | 2047/6/22  |       |
| BGB 1.7 06/22/50     | 1.7  | 100   | 70    | 11,585          | 2050/6/22  |       |
| BGB 1.9 06/22/38     | 1.9  | 100   | 86    | 14,137          | 2038/6/22  |       |
| BGB 2.15 06/22/66    | 2.15 | 100   | 73    | 12,018          | 2066/6/22  |       |
| BGB 2.7 10/22/29     | 2.7  | 100   | 100   | 16,503          | 2029/10/22 |       |
| BGB 3 06/22/33       | 3.0  | 100   | 101   | 16,587          | 2033/6/22  |       |
| BGB 3 06/22/34       | 3.0  | 100   | 100   | 16,527          | 2034/6/22  |       |
| BGB 3 3/4 06/22/45   | 3.75 | 100   | 105   | 17,322          | 2045/6/22  |       |
| BGB 3.3 06/22/54     | 3.3  | 100   | 96    | 15,753          | 2054/6/22  |       |
| BGB 4 1/4 03/28/41   | 4.25 | 100   | 112   | 18,419          | 2041/3/28  |       |
| BGB 5 03/28/35       | 5.0  | 100   | 117   | 19,291          | 2035/3/28  |       |
| BGB 5 1/2 03/28/28   | 5.5  | 100   | 109   | 17,998          | 2028/3/28  |       |
| (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 |      |       |       |                 |            |       |
| RAGB 0 02/20/30      | —    | 100   | 87    | 14,365          | 2030/2/20  |       |
| RAGB 0 02/20/31      | —    | 100   | 84    | 13,938          | 2031/2/20  |       |
| RAGB 0 1/2 02/20/29  | 0.5  | 100   | 92    | 15,125          | 2029/2/20  |       |
| RAGB 0 1/2 04/20/27  | 0.5  | 100   | 95    | 15,710          | 2027/4/20  |       |
| RAGB 0 1/4 10/20/36  | 0.25 | 100   | 72    | 11,974          | 2036/10/20 |       |
| RAGB 0 10/20/28      | —    | 100   | 91    | 14,933          | 2028/10/20 |       |
| RAGB 0 10/20/40      | —    | 100   | 62    | 10,218          | 2040/10/20 |       |
| RAGB 0 3/4 03/20/51  | 0.75 | 100   | 58    | 9,636           | 2051/3/20  |       |
| RAGB 0 3/4 10/20/26  | 0.75 | 100   | 97    | 15,931          | 2026/10/20 |       |
| RAGB 0.9 02/20/32    | 0.9  | 100   | 88    | 14,480          | 2032/2/20  |       |
| RAGB 1 1/2 02/20/47  | 1.5  | 100   | 75    | 12,349          | 2047/2/20  |       |
| RAGB 1.2 10/20/25    | 1.2  | 100   | 98    | 16,216          | 2025/10/20 |       |
| RAGB 1.85 05/23/49   | 1.85 | 100   | 79    | 13,079          | 2049/5/23  |       |

| 銘柄                   | 当 期 末 |       |                        |           |            |
|----------------------|-------|-------|------------------------|-----------|------------|
|                      | 利率    | 額面金額  | 評価額<br>外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 償還年月日     |            |
| (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ                   | 千円        |            |
| RAGB 2 07/15/26      | 2.0   | 100   | 99                     | 16,316    | 2026/7/15  |
| RAGB 2.4 05/23/34    | 2.4   | 100   | 96                     | 15,846    | 2034/5/23  |
| RAGB 2.9 02/20/33    | 2.9   | 100   | 101                    | 16,572    | 2033/2/20  |
| RAGB 3.15 06/20/44   | 3.15  | 100   | 101                    | 16,592    | 2044/6/20  |
| RAGB 3.8 01/26/62    | 3.8   | 100   | 115                    | 18,895    | 2062/1/26  |
| RAGB 4.15 03/37      | 4.15  | 100   | 112                    | 18,420    | 2037/3/15  |
| (ユーロ…フィンランド)<br>国債証券 |       |       |                        |           |            |
| RFGB 0 09/15/30      | —     | 100   | 86                     | 14,131    | 2030/9/15  |
| RFGB 0 1/2 09/15/28  | 0.5   | 100   | 93                     | 15,259    | 2028/9/15  |
| RFGB 0 3/4 04/15/31  | 0.75  | 100   | 89                     | 14,601    | 2031/4/15  |
| RFGB 1 1/2 09/15/32  | 1.5   | 100   | 91                     | 14,991    | 2032/9/15  |
| RFGB 1 1/8 04/15/34  | 1.125 | 100   | 86                     | 14,119    | 2034/4/15  |
| RFGB 2 5/8 07/04/42  | 2.625 | 100   | 94                     | 15,463    | 2042/7/4   |
| RFGB 2 7/8 04/15/29  | 2.875 | 100   | 101                    | 16,667    | 2029/4/15  |
| RFGB 3 09/15/33      | 3.0   | 100   | 101                    | 16,671    | 2033/9/15  |
| (ユーロ…アイルランド)<br>国債証券 |       |       |                        |           |            |
| IRISH 0.2 10/18/30   | 0.2   | 100   | 87                     | 14,418    | 2030/10/18 |
| IRISH 1 05/15/26     | 1.0   | 100   | 98                     | 16,097    | 2026/5/15  |
| IRISH 1 1/2 05/15/50 | 1.5   | 100   | 75                     | 12,407    | 2050/5/15  |
| IRISH 1.1 05/15/29   | 1.1   | 100   | 94                     | 15,522    | 2029/5/15  |
| IRISH 1.3 05/15/33   | 1.3   | 100   | 90                     | 14,832    | 2033/5/15  |
| IRISH 1.35 03/18/31  | 1.35  | 100   | 93                     | 15,336    | 2031/3/18  |
| IRISH 1.7 05/15/37   | 1.7   | 100   | 88                     | 14,466    | 2037/5/15  |
| IRISH 2 02/18/45     | 2.0   | 100   | 86                     | 14,163    | 2045/2/18  |
| (ユーロ…ポルトガル)<br>国債証券  |       |       |                        |           |            |
| PGB 0.3 10/17/31     | 0.3   | 100   | 86                     | 14,109    | 2031/10/17 |
| PGB 1.95 06/15/29    | 1.95  | 200   | 196                    | 32,236    | 2029/6/15  |
| PGB 2 1/4 04/18/34   | 2.25  | 200   | 191                    | 31,334    | 2034/4/18  |
| PGB 3 7/8 02/15/30   | 3.875 | 100   | 107                    | 17,581    | 2030/2/15  |
| PGB 4.1 04/15/37     | 4.1   | 200   | 221                    | 36,380    | 2037/4/15  |
| ユーロ計                 |       |       |                        | 7,350,202 |            |
| (イギリス)<br>国債証券       |       | 千英ポンド | 千英ポンド                  |           |            |
| UKT 0 1/2 01/31/29   | 0.5   | 200   | 171                    | 34,000    | 2029/1/31  |
| UKT 0 1/2 10/22/61   | 0.5   | 200   | 57                     | 11,271    | 2061/10/22 |
| UKT 0 1/4 07/31/31   | 0.25  | 200   | 154                    | 30,491    | 2031/7/31  |
| UKT 0 1/8 01/30/26   | 0.125 | 100   | 95                     | 18,877    | 2026/1/30  |
| UKT 0 1/8 01/31/28   | 0.125 | 100   | 88                     | 17,441    | 2028/1/31  |
| UKT 0 3/8 10/22/26   | 0.375 | 100   | 92                     | 18,379    | 2026/10/22 |
| UKT 0 3/8 10/22/30   | 0.375 | 100   | 80                     | 15,879    | 2030/10/22 |
| UKT 0 5/8 07/31/35   | 0.625 | 100   | 67                     | 13,393    | 2035/7/31  |
| UKT 0 5/8 10/22/50   | 0.625 | 100   | 38                     | 7,621     | 2050/10/22 |
| UKT 0 7/8 01/31/46   | 0.875 | 100   | 47                     | 9,455     | 2046/1/31  |
| UKT 0 7/8 07/31/33   | 0.875 | 100   | 74                     | 14,818    | 2033/7/31  |
| UKT 0 7/8 10/22/29   | 0.875 | 100   | 85                     | 16,934    | 2029/10/22 |
| UKT 1 01/31/32       | 1.0   | 300   | 239                    | 47,359    | 2032/1/31  |
| UKT 1 1/2 07/22/26   | 1.5   | 200   | 190                    | 37,769    | 2026/7/22  |

| 銘柄                       | 当 期 末 |             |                        |           |            |
|--------------------------|-------|-------------|------------------------|-----------|------------|
|                          | 利率    | 額面金額        | 評価額<br>外貨建金額<br>邦貨換算金額 | 償還年月日     |            |
| (イギリス)<br>国債証券           | %     | 千英ポンド       | 千英ポンド                  | 千円        |            |
| UKT 1 1/2 07/22/47       | 1.5   | 100         | 54                     | 10,710    | 2047/7/22  |
| UKT 1 1/4 07/22/27       | 1.25  | 100         | 92                     | 18,300    | 2027/7/22  |
| UKT 1 1/4 07/31/51       | 1.25  | 200         | 92                     | 18,351    | 2051/7/31  |
| UKT 1 1/4 10/22/41       | 1.25  | 200         | 119                    | 23,645    | 2041/10/22 |
| UKT 1 1/8 01/31/39       | 1.125 | 300         | 191                    | 37,934    | 2039/1/31  |
| UKT 1 1/8 10/22/2073     | 1.125 | 100         | 34                     | 6,845     | 2073/10/22 |
| UKT 1 3/4 01/22/49       | 1.75  | 100         | 56                     | 11,092    | 2049/1/22  |
| UKT 1 3/4 07/22/57       | 1.75  | 100         | 50                     | 9,909     | 2057/7/22  |
| UKT 1 3/4 09/07/37       | 1.75  | 100         | 73                     | 14,443    | 2037/9/7   |
| UKT 1 5/8 10/22/28       | 1.625 | 100         | 90                     | 17,984    | 2028/10/22 |
| UKT 1 5/8 10/22/54       | 1.625 | 100         | 49                     | 9,798     | 2054/10/22 |
| UKT 1 5/8 10/22/71       | 1.625 | 100         | 43                     | 8,528     | 2071/10/22 |
| UKT 2 1/2 07/22/65       | 2.5   | 100         | 59                     | 11,772    | 2065/7/22  |
| UKT 3 1/2 01/22/45       | 3.5   | 100         | 82                     | 16,309    | 2045/1/22  |
| UKT 3 1/2 07/22/68       | 3.5   | 100         | 76                     | 15,214    | 2068/7/22  |
| UKT 3 1/4 01/22/44       | 3.25  | 100         | 80                     | 15,841    | 2044/1/22  |
| UKT 3 1/4 01/31/33       | 3.25  | 300         | 277                    | 54,783    | 2033/1/31  |
| UKT 3 3/4 01/29/38       | 3.75  | 200         | 183                    | 36,261    | 2038/1/29  |
| UKT 3 3/4 03/07/27       | 3.75  | 300         | 295                    | 58,441    | 2027/3/7   |
| UKT 3 3/4 07/22/52       | 3.75  | 100         | 82                     | 16,373    | 2052/7/22  |
| UKT 3 3/4 10/22/53       | 3.75  | 300         | 246                    | 48,830    | 2053/10/22 |
| UKT 4 01/22/60           | 4.0   | 100         | 85                     | 16,984    | 2060/1/22  |
| UKT 4 1/2 06/07/28       | 4.5   | 300         | 301                    | 59,597    | 2028/6/7   |
| UKT 4 1/2 12/07/42       | 4.5   | 100         | 96                     | 19,047    | 2042/12/7  |
| UKT 4 1/4 03/07/36       | 4.25  | 100         | 97                     | 19,338    | 2036/3/7   |
| UKT 4 1/4 12/07/27       | 4.25  | 30          | 30                     | 5,934     | 2027/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/40       | 4.25  | 100         | 94                     | 18,687    | 2040/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/46       | 4.25  | 100         | 91                     | 18,071    | 2046/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/49       | 4.25  | 100         | 90                     | 17,938    | 2049/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/55       | 4.25  | 100         | 90                     | 17,799    | 2055/12/7  |
| UKT 4 1/8 01/29/27       | 4.125 | 200         | 198                    | 39,303    | 2027/1/29  |
| UKT 4 1/8 07/22/29       | 4.125 | 200         | 198                    | 39,225    | 2029/7/22  |
| UKT 4 10/22/31           | 4.0   | 100         | 98                     | 19,383    | 2031/10/22 |
| UKT 4 10/22/63           | 4.0   | 100         | 85                     | 16,870    | 2063/10/22 |
| UKT 4 3/4 10/22/43       | 4.75  | 200         | 197                    | 39,075    | 2043/10/22 |
| UKT 4 3/4 12/07/30       | 4.75  | 100         | 102                    | 20,321    | 2030/12/7  |
| UKT 4 3/4 12/07/38       | 4.75  | 100         | 101                    | 20,006    | 2038/12/7  |
| UKT 4 3/8 07/31/54       | 4.375 | 100         | 91                     | 18,150    | 2054/7/31  |
| UKT 4 5/8 01/31/34       | 4.625 | 300         | 304                    | 60,231    | 2034/1/31  |
| UKT 4.25 06/07/32        | 4.25  | 100         | 99                     | 19,738    | 2032/6/7   |
| UKT 4.5 09/07/34         | 4.5   | 100         | 100                    | 19,902    | 2034/9/7   |
| UKT 6 12/07/28           | 6.0   | 10          | 10                     | 2,110     | 2028/12/7  |
| 小計                       |       |             |                        | 1,262,785 |            |
| (スウェーデン)<br>国債証券         |       | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ            |           |            |
| SGB 0 1/8 05/12/31       | 0.125 | 300         | 265                    | 3,749     | 2031/5/12  |
| SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 | 0.75  | 500         | 480                    | 6,799     | 2028/5/12  |
| SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 | 0.75  | 500         | 470                    | 6,664     | 2029/11/12 |
| SGB 1 11/12/26 #1059     | 1.0   | 500         | 491                    | 6,958     | 2026/11/12 |

| 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  |            |
|                          |       | %    | 千円    | 千円      |            |
| (スウェーデン)<br>国債証券         |       |      |       |         |            |
| SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 | 1.75  | 300  | 290   | 4,114   | 2033/11/11 |
| SGB 2 1/4 05/11/35 #1066 | 2.25  | 100  | 100   | 1,421   | 2035/5/11  |
| SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 | 2.25  | 300  | 303   | 4,289   | 2032/6/1   |
| SGB 3 1/2 03/30/39       | 3.5   | 300  | 342   | 4,841   | 2039/3/30  |
| 小 計                      |       |      |       | 38,840  |            |
| (ノルウェー)<br>国債証券          |       |      |       |         |            |
| NGB 1 1/2 02/19/26       | 1.5   | 400  | 387   | 5,389   | 2026/2/19  |
| NGB 1 1/4 09/17/31       | 1.25  | 300  | 254   | 3,546   | 2031/9/17  |
| NGB 1 3/4 02/17/27       | 1.75  | 300  | 286   | 3,983   | 2027/2/17  |
| NGB 1 3/4 09/06/29       | 1.75  | 300  | 273   | 3,807   | 2029/9/6   |
| NGB 1 3/8 08/19/30       | 1.375 | 300  | 263   | 3,660   | 2030/8/19  |
| NGB 2 04/26/28           | 2.0   | 300  | 282   | 3,934   | 2028/4/26  |
| NGB 2 1/8 05/18/32       | 2.125 | 300  | 267   | 3,725   | 2032/5/18  |
| NGB 3 08/15/33           | 3.0   | 300  | 282   | 3,925   | 2033/8/15  |
| NGB 3 1/2 10/06/42       | 3.5   | 100  | 96    | 1,345   | 2042/10/6  |
| NGB 3 5/8 04/13/34       | 3.625 | 200  | 196   | 2,735   | 2034/4/13  |
| 小 計                      |       |      |       | 36,052  |            |
| (デンマーク)<br>国債証券          |       |      |       |         |            |
| DGB 0 1/2 11/15/27       | 0.5   | 400  | 384   | 8,460   | 2027/11/15 |
| DGB 0 1/2 11/15/29       | 0.5   | 400  | 373   | 8,210   | 2029/11/15 |
| DGB 0 1/4 11/15/52       | 0.25  | 400  | 231   | 5,093   | 2052/11/15 |
| DGB 0 11/15/31           | —     | 400  | 348   | 7,669   | 2031/11/15 |
| DGB 1 3/4 11/15/25       | 1.75  | 400  | 399   | 8,780   | 2025/11/15 |
| DGB 2 1/4 11/15/26       | 2.25  | 100  | 100   | 2,218   | 2026/11/15 |
| DGB 2 1/4 11/15/33       | 2.25  | 200  | 202   | 4,452   | 2033/11/15 |
| DGB 4 1/2 11/15/39       | 4.5   | 600  | 764   | 16,829  | 2039/11/15 |
| 小 計                      |       |      |       | 61,715  |            |
| (ポーランド)<br>国債証券          |       |      |       |         |            |
| POLGB 0 04/25/26         | —     | 100  | 93    | 3,549   | 2026/4/25  |
| POLGB 0 1/4 10/25/26     | 0.25  | 300  | 274   | 10,407  | 2026/10/25 |
| POLGB 1 1/4 10/25/30     | 1.25  | 300  | 237   | 9,003   | 2030/10/25 |
| POLGB 1 3/4 04/25/32     | 1.75  | 300  | 231   | 8,786   | 2032/4/25  |
| POLGB 2 1/2 07/25/26     | 2.5   | 200  | 192   | 7,287   | 2026/7/25  |
| POLGB 2 1/2 07/25/27     | 2.5   | 100  | 93    | 3,558   | 2027/7/25  |
| POLGB 2 3/4 04/25/28     | 2.75  | 200  | 185   | 7,023   | 2028/4/25  |
| POLGB 2 3/4 10/25/29     | 2.75  | 600  | 534   | 20,257  | 2029/10/25 |
| POLGB 3 3/4 05/25/27     | 3.75  | 400  | 388   | 14,731  | 2027/5/25  |
| POLGB 4 3/4 07/25/29     | 4.75  | 400  | 390   | 14,783  | 2029/7/25  |
| POLGB 5 10/25/34         | 5.0   | 100  | 94    | 3,599   | 2034/10/25 |
| POLGB 6 10/25/33         | 6.0   | 300  | 307   | 11,659  | 2033/10/25 |
| POLGB 7 1/2 07/25/28     | 7.5   | 300  | 322   | 12,239  | 2028/7/25  |
| 小 計                      |       |      |       | 126,887 |            |
| (オーストラリア)<br>国債証券        |       |      |       |         |            |
| ACGB 0 1/2 09/21/26      | 0.5   | 100  | 93    | 9,452   | 2026/9/21  |
| ACGB 0 1/4 11/21/25      | 0.25  | 100  | 96    | 9,695   | 2025/11/21 |
| ACGB 1 1/2 06/21/31      | 1.5   | 200  | 167   | 16,898  | 2031/6/21  |

| 銘 柄                 | 当 期 末 |      |               |              | 償還年月日      |
|---------------------|-------|------|---------------|--------------|------------|
|                     | 利率    | 額面金額 | 評 価 額         |              |            |
|                     |       |      | 外貨建金額<br>千豪ドル | 邦貨換算金額<br>千円 |            |
| (オーストラリア)<br>国債証券   |       |      |               |              |            |
| ACGB 1 1/4 05/21/32 | 1.25  | 100  | 79            | 8,046        | 2032/5/21  |
| ACGB 1 11/21/31     | 1.0   | 100  | 79            | 8,034        | 2031/11/21 |
| ACGB 1 12/21/30     | 1.0   | 200  | 164           | 16,633       | 2030/12/21 |
| ACGB 1 3/4 06/21/51 | 1.75  | 100  | 52            | 5,265        | 2051/6/21  |
| ACGB 1 3/4 11/21/32 | 1.75  | 300  | 245           | 24,741       | 2032/11/21 |
| ACGB 2 1/2 05/21/30 | 2.5   | 100  | 91            | 9,234        | 2030/5/21  |
| ACGB 2 1/4 05/21/28 | 2.25  | 100  | 94            | 9,485        | 2028/5/21  |
| ACGB 2 3/4 05/21/41 | 2.75  | 100  | 76            | 7,695        | 2041/5/21  |
| ACGB 2 3/4 06/21/35 | 2.75  | 200  | 169           | 17,064       | 2035/6/21  |
| ACGB 2 3/4 11/21/27 | 2.75  | 200  | 192           | 19,423       | 2027/11/21 |
| ACGB 2 3/4 11/21/28 | 2.75  | 100  | 95            | 9,586        | 2028/11/21 |
| ACGB 2 3/4 11/21/29 | 2.75  | 100  | 93            | 9,439        | 2029/11/21 |
| ACGB 3 03/21/47     | 3.0   | 100  | 73            | 7,403        | 2047/3/21  |
| ACGB 3 1/2 12/21/34 | 3.5   | 100  | 91            | 9,219        | 2034/12/21 |
| ACGB 3 1/4 04/21/29 | 3.25  | 100  | 96            | 9,727        | 2029/4/21  |
| ACGB 3 1/4 06/21/39 | 3.25  | 100  | 84            | 8,494        | 2039/6/21  |
| ACGB 3 11/21/33     | 3.0   | 100  | 88            | 8,949        | 2033/11/21 |
| ACGB 3 3/4 04/21/37 | 3.75  | 100  | 91            | 9,222        | 2037/4/21  |
| ACGB 3 3/4 05/21/34 | 3.75  | 100  | 93            | 9,470        | 2034/5/21  |
| ACGB 4 1/2 04/21/33 | 4.5   | 200  | 200           | 20,187       | 2033/4/21  |
| ACGB 4 1/4 04/21/26 | 4.25  | 200  | 200           | 20,223       | 2026/4/21  |
| ACGB 4 1/4 06/21/34 | 4.25  | 100  | 97            | 9,853        | 2034/6/21  |
| ACGB 4 3/4 04/21/27 | 4.75  | 100  | 101           | 10,245       | 2027/4/21  |
| ACGB 4 3/4 06/21/54 | 4.75  | 100  | 96            | 9,687        | 2054/6/21  |
| 小 計                 |       |      |               | 313,381      |            |
| (ニュージーランド)<br>国債証券  |       |      |               |              |            |
| NZGB 1 1/2 05/15/31 | 1.5   | 100  | 84            | 7,683        | 2031/5/15  |
| NZGB 2 05/15/32     | 2.0   | 100  | 84            | 7,731        | 2032/5/15  |
| NZGB 2 3/4 04/15/37 | 2.75  | 100  | 80            | 7,389        | 2037/4/15  |
| NZGB 3 04/20/29     | 3.0   | 100  | 95            | 8,738        | 2029/4/20  |
| NZGB 3 1/2 04/14/33 | 3.5   | 100  | 92            | 8,495        | 2033/4/14  |
| NZGB 4 1/2 04/15/27 | 4.5   | 100  | 101           | 9,259        | 2027/4/15  |
| NZGB 4 1/4 05/15/34 | 4.25  | 100  | 97            | 8,906        | 2034/5/15  |
| NZGB 4 1/4 05/15/36 | 4.25  | 100  | 95            | 8,737        | 2036/5/15  |
| 小 計                 |       |      |               | 66,942       |            |
| (シンガポール)<br>国債証券    |       |      |               |              |            |
| SIGB 2 1/4 08/01/36 | 2.25  | 100  | 94            | 10,868       | 2036/8/1   |
| SIGB 2 1/8 06/01/26 | 2.125 | 100  | 99            | 11,441       | 2026/6/1   |
| SIGB 2 3/4 03/01/46 | 2.75  | 100  | 98            | 11,381       | 2046/3/1   |
| SIGB 2 3/4 04/01/42 | 2.75  | 100  | 98            | 11,348       | 2042/4/1   |
| SIGB 2 3/8 07/01/39 | 2.375 | 100  | 93            | 10,839       | 2039/7/1   |
| SIGB 2 7/8 09/01/30 | 2.875 | 100  | 100           | 11,612       | 2030/9/1   |
| SIGB 3 1/2 03/01/27 | 3.5   | 100  | 101           | 11,731       | 2027/3/1   |
| SIGB 3 3/8 05/01/34 | 3.375 | 100  | 104           | 12,049       | 2034/5/1   |
| SIGB 3 3/8 09/01/33 | 3.375 | 100  | 104           | 12,028       | 2033/9/1   |
| 小 計                 |       |      |               | 103,302      |            |

| 銘柄                   | 利率    | 当 期 末 |       |                 |            |
|----------------------|-------|-------|-------|-----------------|------------|
|                      |       | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 償還年月日      |
| (マレーシア)              | %     | 千円    | 千円    | 千円              |            |
| 国債証券                 |       |       |       |                 |            |
| MGS 2.632 04/15/31   | 2.632 | 100   | 93    | 3,248           | 2031/4/15  |
| MGS 3.502 05/31/27   | 3.502 | 300   | 300   | 10,451          | 2027/5/31  |
| MGS 3.582 07/15/32   | 3.582 | 100   | 98    | 3,415           | 2032/7/15  |
| MGS 3.733 06/15/28   | 3.733 | 100   | 100   | 3,502           | 2028/6/15  |
| MGS 3.757 05/22/40   | 3.757 | 100   | 96    | 3,358           | 2040/5/22  |
| MGS 3.828 07/05/34   | 3.828 | 100   | 99    | 3,466           | 2034/7/5   |
| MGS 3.844 04/15/33   | 3.844 | 200   | 199   | 6,934           | 2033/4/15  |
| MGS 3.885 08/15/29   | 3.885 | 200   | 202   | 7,048           | 2029/8/15  |
| MGS 3.899 11/16/27   | 3.899 | 100   | 101   | 3,521           | 2027/11/16 |
| MGS 4.054 04/18/39   | 4.054 | 100   | 100   | 3,494           | 2039/4/18  |
| MGS 4.065 06/15/50   | 4.065 | 200   | 195   | 6,806           | 2050/6/15  |
| MGS 4.18 05/16/44    | 4.18  | 100   | 100   | 3,510           | 2044/5/16  |
| MGS 4.232 06/30/31   | 4.232 | 200   | 204   | 7,129           | 2031/6/30  |
| MGS 4.254 05/31/35   | 4.254 | 100   | 102   | 3,571           | 2035/5/31  |
| MGS 4.392 04/15/26   | 4.392 | 300   | 304   | 10,598          | 2026/4/15  |
| MGS 4.457 03/31/53   | 4.457 | 100   | 103   | 3,622           | 2053/3/31  |
| MGS 4.498 04/15/30   | 4.498 | 200   | 207   | 7,239           | 2030/4/15  |
| MGS 4.696 10/15/42   | 4.696 | 200   | 214   | 7,472           | 2042/10/15 |
| MGS 4.736 03/15/46   | 4.736 | 100   | 107   | 3,753           | 2046/3/15  |
| MGS 4.762 04/07/37   | 4.762 | 200   | 214   | 7,479           | 2037/4/7   |
| MGS 4.893 06/08/38   | 4.893 | 100   | 108   | 3,795           | 2038/6/8   |
| MGS 4.921 07/06/48   | 4.921 | 100   | 110   | 3,857           | 2048/7/6   |
| MGS 4.935 09/30/43   | 4.935 | 100   | 110   | 3,845           | 2043/9/30  |
| MGS 5.248 09/28      | 5.248 | 100   | 105   | 3,688           | 2028/9/15  |
| 小 計                  |       |       |       | 124,813         |            |
| (イスラエル)              | %     | 千円    | 千円    | 千円              |            |
| 国債証券                 |       |       |       |                 |            |
| ILGOV 0 1/2 02/27/26 | —     | 200   | 190   | 7,797           | 2026/2/27  |
| ILGOV 1 03/31/30     | —     | 200   | 167   | 6,846           | 2030/3/31  |
| ILGOV 1 1/2 05/31/37 | —     | 200   | 139   | 5,708           | 2037/5/31  |
| ILGOV 1.3 04/30/32   | —     | 200   | 159   | 6,529           | 2032/4/30  |
| ILGOV 2 03/31/27     | —     | 200   | 191   | 7,816           | 2027/3/31  |
| ILGOV 2 1/4 09/28/28 | —     | 200   | 184   | 7,541           | 2028/9/28  |
| ILGOV 2.8 11/29/52   | —     | 100   | 68    | 2,813           | 2052/11/29 |
| ILGOV 3 3/4 02/28/29 | —     | 200   | 199   | 8,136           | 2029/2/28  |
| ILGOV 3 3/4 03/31/47 | —     | 200   | 171   | 6,990           | 2047/3/31  |
| ILGOV 3 3/4 09/30/27 | —     | 100   | 98    | 4,017           | 2027/9/30  |
| ILGOV 4 03/30/35     | —     | 100   | 96    | 3,943           | 2035/3/30  |
| ILGOV 5 1/2 01/31/42 | —     | 100   | 111   | 4,540           | 2042/1/31  |
| ILGOV 6 1/4 10/30/26 | —     | 100   | 103   | 4,227           | 2026/10/30 |
| 小 計                  |       |       |       | 76,910          |            |
| (中国)                 | %     | 千円    | 千円    | 千円              |            |
| 国債証券                 |       |       |       |                 |            |
| CGB 1.35 09/25/26    | 1.35  | 1,600 | 1,597 | 33,985          | 2026/9/25  |
| CGB 1.62 08/15/27    | 1.62  | 2,600 | 2,609 | 55,506          | 2027/8/15  |
| CGB 1.67 06/15/26    | 1.67  | 3,700 | 3,720 | 79,136          | 2026/6/15  |
| CGB 1.85 05/15/27    | 1.85  | 3,100 | 3,128 | 66,541          | 2027/5/15  |
| CGB 1.91 07/15/29    | 1.91  | 3,400 | 3,425 | 72,870          | 2029/7/15  |
| CGB 1.99 03/15/26    | 1.99  | 3,200 | 3,224 | 68,592          | 2026/3/15  |

| 銘柄                 | 利率   | 当 期 末 |       |                 |            |
|--------------------|------|-------|-------|-----------------|------------|
|                    |      | 額面金額  | 外貨建金額 | 評 価 額<br>邦貨換算金額 | 償還年月日      |
| (中国)               | %    | 千円    | 千円    | 千円              |            |
| 国債証券               |      |       |       |                 |            |
| CGB 2 1/2 07/25/27 | 2.5  | 1,100 | 1,126 | 23,963          | 2027/7/25  |
| CGB 2 3/4 02/17/32 | 2.75 | 300   | 315   | 6,703           | 2032/2/17  |
| CGB 2 3/4 06/15/29 | 2.75 | 500   | 521   | 11,096          | 2029/6/15  |
| CGB 2.04 02/25/27  | 2.04 | 2,300 | 2,328 | 49,527          | 2027/2/25  |
| CGB 2.05 04/15/29  | 2.05 | 3,000 | 3,038 | 64,626          | 2029/4/15  |
| CGB 2.11 08/25/34  | 2.11 | 1,900 | 1,901 | 40,455          | 2034/8/25  |
| CGB 2.12 06/25/31  | 2.12 | 3,600 | 3,635 | 77,344          | 2031/6/25  |
| CGB 2.18 08/15/26  | 2.18 | 2,200 | 2,227 | 47,381          | 2026/8/15  |
| CGB 2.27 05/25/34  | 2.27 | 2,000 | 2,027 | 43,125          | 2034/5/25  |
| CGB 2.28 03/25/31  | 2.28 | 2,000 | 2,037 | 43,341          | 2031/3/25  |
| CGB 2.28 11/25/25  | 2.28 | 1,300 | 1,311 | 27,903          | 2025/11/25 |
| CGB 2.3 05/15/26   | 2.3  | 1,200 | 1,214 | 25,845          | 2026/5/15  |
| CGB 2.33 12/15/25  | 2.33 | 5,800 | 5,856 | 124,577         | 2025/12/15 |
| CGB 2.35 02/25/34  | 2.35 | 2,500 | 2,549 | 54,230          | 2034/2/25  |
| CGB 2.37 01/15/29  | 2.37 | 2,400 | 2,461 | 52,358          | 2029/1/15  |
| CGB 2.37 01/20/27  | 2.37 | 600   | 611   | 13,002          | 2027/1/20  |
| CGB 2.39 11/15/26  | 2.39 | 3,500 | 3,562 | 75,774          | 2026/11/15 |
| CGB 2.4 07/15/28   | 2.4  | 2,100 | 2,151 | 45,763          | 2028/7/15  |
| CGB 2.44 10/15/27  | 2.44 | 4,900 | 5,022 | 106,833         | 2027/10/15 |
| CGB 2.46 02/15/26  | 2.46 | 1,900 | 1,924 | 40,930          | 2026/2/15  |
| CGB 2.48 04/15/27  | 2.48 | 600   | 614   | 13,061          | 2027/4/15  |
| CGB 2.49 05/25/44  | 2.49 | 200   | 205   | 4,378           | 2044/5/25  |
| CGB 2.52 08/25/33  | 2.52 | 1,500 | 1,548 | 32,936          | 2033/8/25  |
| CGB 2.54 12/25/30  | 2.54 | 4,500 | 4,658 | 99,099          | 2030/12/25 |
| CGB 2.55 10/15/28  | 2.55 | 6,800 | 7,012 | 149,162         | 2028/10/15 |
| CGB 2.6 09/01/32   | 2.6  | 800   | 831   | 17,686          | 2032/9/1   |
| CGB 2.6 09/15/30   | 2.6  | 2,400 | 2,492 | 53,011          | 2030/9/15  |
| CGB 2.62 04/15/28  | 2.62 | 1,500 | 1,547 | 32,925          | 2028/4/15  |
| CGB 2.62 06/25/30  | 2.62 | 1,100 | 1,144 | 24,338          | 2030/6/25  |
| CGB 2.62 09/25/29  | 2.62 | 600   | 623   | 13,267          | 2029/9/25  |
| CGB 2.64 01/15/28  | 2.64 | 1,100 | 1,134 | 24,140          | 2028/1/15  |
| CGB 2.67 05/25/33  | 2.67 | 700   | 731   | 15,551          | 2033/5/25  |
| CGB 2.67 11/25/33  | 2.67 | 3,900 | 4,075 | 86,703          | 2033/11/25 |
| CGB 2.68 05/21/30  | 2.68 | 700   | 731   | 15,560          | 2030/5/21  |
| CGB 2.69 08/12/26  | 2.69 | 900   | 919   | 19,553          | 2026/8/12  |
| CGB 2.69 08/15/32  | 2.69 | 400   | 418   | 8,910           | 2032/8/15  |
| CGB 2.76 05/15/32  | 2.76 | 300   | 315   | 6,704           | 2032/5/15  |
| CGB 2.79 12/15/29  | 2.79 | 3,800 | 3,983 | 84,737          | 2029/12/15 |
| CGB 2.8 03/24/29   | 2.8  | 600   | 626   | 13,319          | 2029/3/24  |
| CGB 2.8 03/25/30   | 2.8  | 1,400 | 1,469 | 31,250          | 2030/3/25  |
| CGB 2.8 11/15/32   | 2.8  | 4,600 | 4,851 | 103,192         | 2032/11/15 |
| CGB 2.85 06/04/27  | 2.85 | 500   | 516   | 10,996          | 2027/6/4   |
| CGB 2.88 02/25/33  | 2.88 | 900   | 957   | 20,372          | 2033/2/25  |
| CGB 2.89 11/18/31  | 2.89 | 1,900 | 2,015 | 42,876          | 2031/11/18 |
| CGB 2.91 10/14/28  | 2.91 | 800   | 836   | 17,804          | 2028/10/14 |
| CGB 3 1/4 06/06/26 | 3.25 | 500   | 514   | 10,939          | 2026/6/6   |
| CGB 3 1/4 11/22/28 | 3.25 | 500   | 532   | 11,321          | 2028/11/22 |
| CGB 3 10/15/53     | 3.0  | 1,400 | 1,613 | 34,311          | 2053/10/15 |
| CGB 3.01 05/13/28  | 3.01 | 700   | 733   | 15,592          | 2028/5/13  |

| 銘柄                | 当 期 末 |       |       |        |            |
|-------------------|-------|-------|-------|--------|------------|
|                   | 利率    | 額面金額  | 評 価 額 |        | 償還年月日      |
|                   |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |
| (中国)<br>国債証券      | %     | 千円    | 千円    | 千円     |            |
| CGB 3.02 05/27/31 | 3.02  | 500   | 534   | 11,366 | 2031/5/27  |
| CGB 3.03 03/11/26 | 3.03  | 700   | 715   | 15,217 | 2026/3/11  |
| CGB 3.12 10/25/52 | 3.12  | 1,600 | 1,865 | 39,682 | 2052/10/25 |
| CGB 3.12 12/05/26 | 3.12  | 900   | 930   | 19,787 | 2026/12/5  |
| CGB 3.13 11/21/29 | 3.13  | 400   | 427   | 9,086  | 2029/11/21 |
| CGB 3.19 04/15/53 | 3.19  | 700   | 830   | 17,662 | 2053/4/15  |
| CGB 3.22 12/06/25 | 3.22  | 500   | 509   | 10,846 | 2025/12/6  |
| CGB 3.27 11/19/30 | 3.27  | 1,000 | 1,083 | 23,045 | 2030/11/19 |
| CGB 3.28 12/03/27 | 3.28  | 400   | 421   | 8,967  | 2027/12/3  |
| CGB 3.29 05/23/29 | 3.29  | 300   | 321   | 6,845  | 2029/5/23  |
| CGB 3.32 04/15/52 | 3.32  | 400   | 481   | 10,247 | 2052/4/15  |
| CGB 3.39 03/16/50 | 3.39  | 600   | 724   | 15,413 | 2050/3/16  |
| CGB 3.53 10/18/51 | 3.53  | 1,500 | 1,864 | 39,663 | 2051/10/18 |
| CGB 3.54 08/16/28 | 3.54  | 100   | 107   | 2,288  | 2028/8/16  |

| 銘柄                | 当 期 末 |       |       |            |           |
|-------------------|-------|-------|-------|------------|-----------|
|                   | 利率    | 額面金額  | 評 価 額 |            | 償還年月日     |
|                   |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額     |           |
| (中国)<br>国債証券      | %     | 千円    | 千円    | 千円         |           |
| CGB 3.72 04/12/51 | 3.72  | 500   | 639   | 13,597     | 2051/4/12 |
| CGB 3.81 09/14/50 | 3.81  | 2,800 | 3,618 | 76,975     | 2050/9/14 |
| CGB 3.86 07/22/49 | 3.86  | 1,700 | 2,198 | 46,760     | 2049/7/22 |
| 小 計               |       |       |       | 2,732,579  |           |
| 合 計               |       |       |       | 24,281,859 |           |

(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

(2024年11月11日現在)

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 公社債          | 24,281,859 | 98.5  |
| コール・ローン等、その他 | 363,482    | 1.5   |
| 投資信託財産総額     | 24,645,341 | 100.0 |

(注) 当期末における外貨建純資産（24,603,645千円）の投資信託財産総額（24,645,341千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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＝153.14円、1カナダドル＝110.07円、1メキシコペソ＝7.6101円、1ユーロ＝164.04円、1英ポンド＝197.75円、1スウェーデンクローナ＝14.15円、1ノルウェークローネ＝13.91円、1デンマーククローネ＝22.00円、1ポーランドズロチ＝37.8969円、1豪ドル＝100.90円、1ニュージーランドドル＝91.36円、1シンガポールドル＝115.38円、1マレーシアリンギット＝34.8344円、1イスラエルシェケル＝40.8304円、1オフショア元＝21.2719円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月11日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 24,645,341,617  |
| コール・ローン等        | 126,983,895     |
| 公社債(評価額)        | 24,281,859,508  |
| 未収利息            | 214,664,418     |
| 前払費用            | 21,833,796      |
| (B) 負債          | 32,079,859      |
| 未払解約金           | 32,079,859      |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 24,613,261,758  |
| 元本              | 12,002,273,864  |
| 次期繰越損益金         | 12,610,987,894  |
| (D) 受益権総口数      | 12,002,273,864口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 20,507円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,333,811,825円、期中追加設定元本額は4,073,840,281円、期中一部解約元本額は1,405,378,242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           | 6,799,903,277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＞ | 2,836,859,224円 |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)        | 965,921,897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＞ | 773,931,029円   |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035          | 250,306,970円   |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045          | 142,351,032円   |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065          | 134,281,755円   |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055          | 89,239,341円    |
| TMA外国債券インデックスVA＜適格機関投資家限定＞      | 9,479,339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 (2023年11月11日～2024年11月11日)

| 項 目              | 当 期             |
|------------------|-----------------|
|                  | 円               |
| (A) 配当等収益        | 586,183,896     |
| 受取利息             | 586,183,143     |
| その他収益金           | 5,286           |
| 支払利息             | △ 4,533         |
| (B) 有価証券売買損益     | 1,073,924,283   |
| 売買益              | 1,166,520,786   |
| 売買損              | △ 92,596,503    |
| (C) 保管費用等        | △ 7,220,832     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,652,887,347   |
| (E) 前期繰越損益金      | 8,335,131,781   |
| (F) 追加信託差損益金     | 4,027,009,749   |
| (G) 解約差損益金       | △ 1,404,040,983 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 12,610,987,894  |
| 次期繰越損益金(H)       | 12,610,987,894  |

(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。