

## 運用報告書 (全体版)

第7期<決算日2022年5月9日>

### MHAM外国債券インデックスファンド <為替ヘッジあり> (ファンドラップ)

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   | 2015年10月19日から無期限です。   |                                   |
| 運用方針   | FTSE世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の動きに連動する投資成果を目指します。  |                                   |
| 主要投資対象 | MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)   | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを主要投資対象とします。 |
|        | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 海外の公社債を主要投資対象とします。                |
| 運用方法   | 公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。  |                                   |
| 組入制限   | MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)   | 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。          |
|        | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 外貨建資産への投資には、制限を設けません。             |
| 分配方針   | 毎年原則として5月8日に決算を行い、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。) 等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                                   |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)」は、2022年5月9日に第7期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

# MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)

## ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |            |           | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |           | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額 |
|----------------|--------|------------|-----------|------------------------------------|-----------|------------|------------|-----------|
|                | (分配落)  | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                           | 期中<br>騰落率 |            |            |           |
|                | 円      | 円          | %         |                                    | %         | %          | %          | 百万円       |
| 3期(2018年5月8日)  | 9,843  | 0          | △0.7      | 10,068.60                          | △0.1      | 95.8       | —          | 745       |
| 4期(2019年5月8日)  | 10,014 | 0          | 1.7       | 10,312.56                          | 2.4       | 96.0       | —          | 1,254     |
| 5期(2020年5月8日)  | 10,769 | 0          | 7.5       | 11,155.20                          | 8.2       | 95.9       | —          | 1,338     |
| 6期(2021年5月10日) | 10,494 | 0          | △2.6      | 10,907.16                          | △2.2      | 98.5       | —          | 727       |
| 7期(2022年5月9日)  | 9,458  | 0          | △9.9      | 9,839.01                           | △9.8      | 94.1       | —          | 499       |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークは、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いて、設定日(2015年10月19日)を10,000として指数化しております(小数点第3位を四捨五入)(以下同じ)。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(円ベースの指数)で、対円での為替ヘッジコストが考慮されています。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します(以下同じ)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日        | 基準価額   |          | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |      | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 |
|------------|--------|----------|------------------------------------|------|------------|------------|
|            | 騰落率    | (ベンチマーク) | 騰落率                                |      |            |            |
| (期首)       | 円      | %        |                                    | %    | %          | %          |
| 2021年5月10日 | 10,494 | —        | 10,907.16                          | —    | 98.5       | —          |
| 5月末        | 10,492 | △0.0     | 10,904.95                          | △0.0 | 99.1       | —          |
| 6月末        | 10,530 | 0.3      | 10,950.96                          | 0.4  | 98.2       | —          |
| 7月末        | 10,712 | 2.1      | 11,141.68                          | 2.2  | 97.4       | —          |
| 8月末        | 10,713 | 2.1      | 11,144.81                          | 2.2  | 98.7       | —          |
| 9月末        | 10,545 | 0.5      | 10,969.31                          | 0.6  | 98.7       | —          |
| 10月末       | 10,537 | 0.4      | 10,962.52                          | 0.5  | 98.3       | —          |
| 11月末       | 10,602 | 1.0      | 11,031.90                          | 1.1  | 97.0       | —          |
| 12月末       | 10,506 | 0.1      | 10,933.02                          | 0.2  | 97.6       | —          |
| 2022年1月末   | 10,373 | △1.2     | 10,798.21                          | △1.0 | 97.3       | —          |
| 2月末        | 10,156 | △3.2     | 10,570.49                          | △3.1 | 76.3       | —          |
| 3月末        | 9,895  | △5.7     | 10,289.65                          | △5.7 | 97.3       | —          |
| 4月末        | 9,669  | △7.9     | 10,065.02                          | △7.7 | 101.6      | —          |
| (期末)       |        |          |                                    |      |            |            |
| 2022年5月9日  | 9,458  | △9.9     | 9,839.01                           | △9.8 | 94.1       | —          |

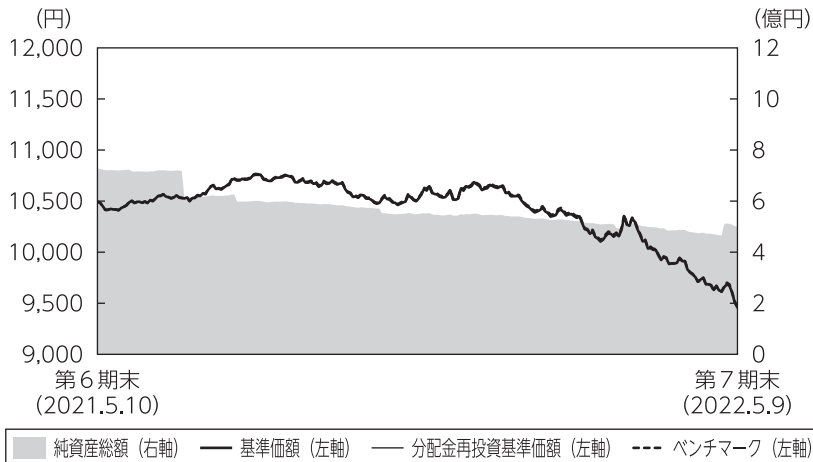
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2021年5月11日から2022年5月9日まで)

### 基準価額等の推移



第7期首： 10,494円  
第7期末： 9,458円  
(既払分配金0円)  
騰落率： △9.9%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ロシアのウクライナへの侵攻を受けて、インフレ加速観測の高まりを背景に米国国債、ドイツ国債の利回りは上昇（価格は下落）したことなどから基準価額は下落しました。

## 投資環境

米国国債、および、ドイツ国債の利回りはともに上昇しました。

米国国債は、F R B（米連邦準備理事会）高官からインフレを抑制するため、利上げペースを早める旨の発言が相次いだこと、ロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行いました。約款変更により、2022年3月1日に主な投資対象として外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券の組み入れを開始しました。また、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券は2022年3月28日に繰上償還しました。

### ●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

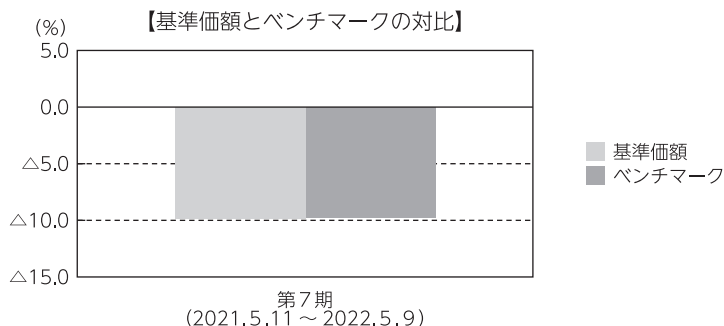
F T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。2022年3月28日に繰上償還しました。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率はベンチマークを0.1%下回りました。この差異は、信託報酬や取引コストなどによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                       |
|------------|--------------------------|
|            | 2021年5月11日<br>～2022年5月9日 |
| 当期分配金（税引前） | －円                       |
| 対基準価額比率    | －％                       |
| 当期の収益      | －円                       |
| 当期の収益以外    | －円                       |
| 翌期繰越分配対象額  | 1,365円                   |

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行います。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目        | 第7期                        |         | 項目の概要  |
|-----------|----------------------------|---------|--|
|           | (2021年5月11日<br>～2022年5月9日) |         |  |
|           | 金額                         | 比率      |  |
| (a) 信託報酬  | 13円                        | 0.126%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,416円です。 |
| (投信会社)    | ( 7)                       | (0.071) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価         |
| (販売会社)    | ( 1)                       | (0.011) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社)    | ( 5)                       | (0.044) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価             |
| (b) その他費用 | 3                          | 0.026   | (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)    | ( 2)                       | (0.020) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用                           |
| (監査費用)    | ( 0)                       | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用                     |
| (その他)     | ( 0)                       | (0.003) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等                             |
| 合計        | 16                         | 0.153   |  |

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

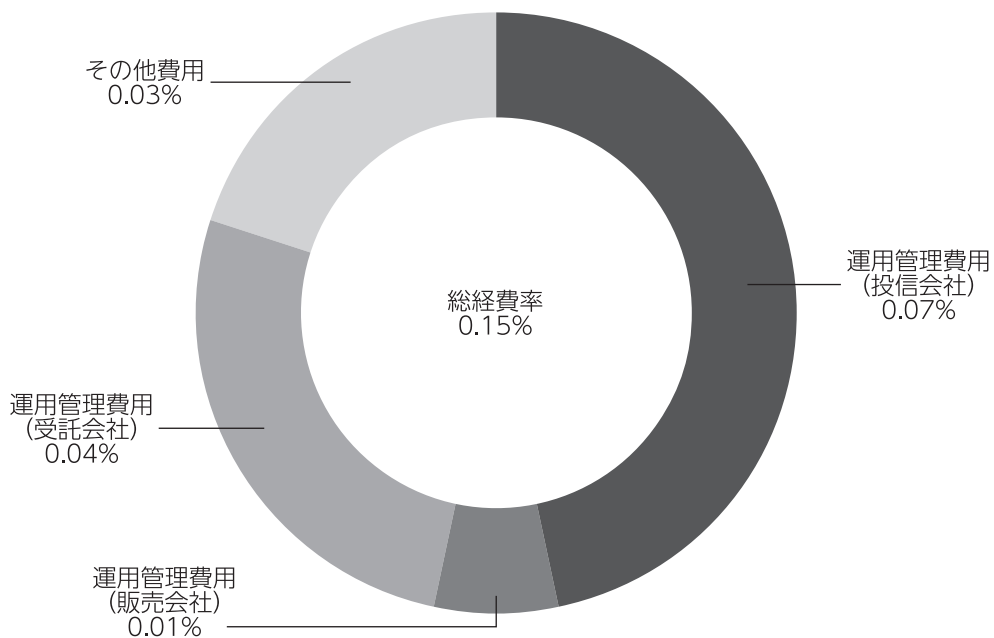
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.15%です。



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

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年5月11日から2022年5月9日まで）

|                       | 設 定     |         | 解 約     |         |
|-----------------------|---------|---------|---------|---------|
|                       | □ 数     | 金 額     | □ 数     | 金 額     |
|                       | 千□      | 千円      | 千□      | 千円      |
| MHAM外国債券インデックスマザーファンド | 54,628  | 77,436  | 573,964 | 808,902 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 280,926 | 571,755 | 36,893  | 75,706  |

## ■利害関係人との取引状況等（2021年5月11日から2022年5月9日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

|                       | 期首（前期末） | 当 期     |       | 末       |
|-----------------------|---------|---------|-------|---------|
|                       | □ 数     | □ 数     | 評 価 額 | 評 価 額   |
|                       | 千□      | 千□      |       | 千円      |
| MHAM外国債券インデックスマザーファンド | 519,336 | -       |       | -       |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | -       | 244,033 |       | 502,025 |

## ■投資信託財産の構成

2022年5月9日現在

| 項 目                     | 当 期     |   | 末     |
|-------------------------|---------|---|-------|
|                         | 評 価 額   | 比 | 率     |
|                         | 千円      |   | %     |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 502,025 |   | 96.3  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 19,476  |   | 3.7   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 521,501 |   | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、178,037,314千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年5月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.78円、1カナダ・ドル=101.08円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1シンガポール・ドル=94.11円、1イギリス・ポンド=160.94円、1イスラエル・シェケル=38.436円、1デンマーク・クローネ=18.50円、1ノルウェー・クローネ=13.71円、1スウェーデン・クローナ=13.10円、1メキシコ・ペソ=6.472円、1オフショア・人民元=19.418円、1マレーシア・リンギット=29.891円、1ポーランド・ズロチ=29.209円、1ユーロ=137.63円です。



## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年5月9日)現在

| 項 目                         | 当 期 末          |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資 産                     | 1,018,595,970円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等             | 1,121,653      |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド (評価額) | 502,025,271    |
| 未 収 入 金                     | 515,449,046    |
| (B) 負 債                     | 518,733,345    |
| 未 払 金                       | 518,401,809    |
| 未 払 信 託 報 酬                 | 322,391        |
| そ の 他 未 払 費 用               | 9,145          |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B)         | 499,862,625    |
| 元 本                         | 528,521,719    |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | △28,659,094    |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 528,521,719口   |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)    | 9,458円         |

(注) 期首における元本額は692,858,095円、当期中における追加設定元本額は68,964,927円、同解約元本額は233,301,303円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年5月11日 至2022年5月9日

| 項 目                   | 当 期           |
|-----------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | △336円         |
| 受 取 利 息               | 51            |
| 支 払 利 息               | △387          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | △49,855,161   |
| 売 買 益                 | 43,634,553    |
| 売 買 損                 | △93,489,714   |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △744,428      |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △50,599,925   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | 10,822,216    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | 11,118,615    |
| (配 当 等 相 当 額)         | (31,727,690)  |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△20,609,075) |
| (G) 合 計 (D+E+F)       | △28,659,094   |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)     | △28,659,094   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | 11,118,615    |
| (配 当 等 相 当 額)         | (31,763,449)  |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△20,644,834) |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 40,394,083    |
| 繰 越 損 益 金             | △80,171,792   |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目                          | 当 期        |
|------------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益              | 8,875,647円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益          | 0          |
| (c) 収 益 調 整 金                | 31,763,449 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金            | 31,518,436 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)  | 72,157,532 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 1,365.27   |
| (g) 分 配 金                    | 0          |
| (h) 1 万 口 当 たり 分 配 金         | 0          |

## ■分配金のお知らせ

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■主要投資対象を「MH AM外国債券インデックスマザーファンド」から「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更しました。

(2022年3月1日)

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2002年12月10日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。                                 |
| 主要投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。<br>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には、制限を設けません。 |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |     | FTSE世界国債インデックス                  |     | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産額    |
|-----------------|--------|-----|---------------------------------|-----|-------|-------|---------|
|                 | 円      | 騰落率 | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）<br>（ベンチマーク） | 騰落率 |       |       |         |
| 15期（2018年2月21日） | 17,876 | 2.9 | ポイント                            | %   | %     | %     | 百万円     |
| 16期（2019年2月21日） | 18,170 | 1.6 | 111,885.82                      | 2.8 | 97.7  | -     | 217,863 |
| 17期（2020年2月21日） | 19,586 | 7.8 | 113,733.36                      | 1.7 | 98.1  | -     | 197,670 |
| 18期（2021年2月22日） | 19,836 | 1.3 | 122,662.63                      | 7.9 | 97.8  | -     | 130,803 |
| 18期（2021年2月22日） | 19,836 | 1.3 | 124,229.95                      | 1.3 | 98.4  | -     | 137,037 |
| 19期（2022年2月21日） | 20,152 | 1.6 | 126,280.23                      | 1.7 | 98.9  | -     | 141,964 |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

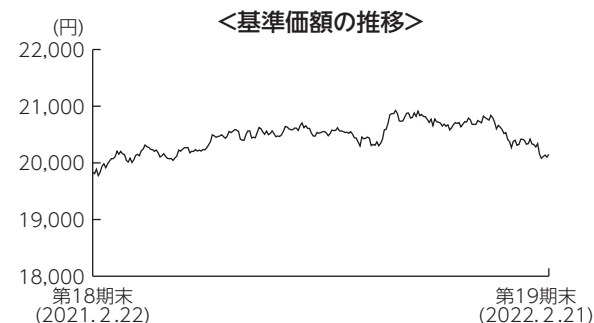
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     |        | F T S E世界国債インデックス<br>( 除く日本、<br>円 ベース、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |        | 債券組入<br>比 率 | 債券先物<br>比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-------------|-------------|
|                          | 騰 落 率       | 騰 落 率  | 騰 落 率  | 騰 落 率  |             |             |
| (期 首)<br>2021 年 2 月 22 日 | 円<br>19,836 | %<br>- | ポイント<br>124,229.95   | %<br>- | %<br>98.4   | %<br>-      |
| 2 月 末                    | 19,776      | △0.3   | 124,359.44   | 0.1    | 99.0        | -           |
| 3 月 末                    | 20,213      | 1.9    | 126,595.03   | 1.9    | 95.3        | -           |
| 4 月 末                    | 20,206      | 1.9    | 126,569.17   | 1.9    | 97.6        | -           |
| 5 月 末                    | 20,477      | 3.2    | 128,227.80   | 3.2    | 98.9        | -           |
| 6 月 末                    | 20,443      | 3.1    | 128,117.08   | 3.1    | 97.7        | -           |
| 7 月 末                    | 20,584      | 3.8    | 128,989.36   | 3.8    | 98.8        | -           |
| 8 月 末                    | 20,579      | 3.7    | 128,937.19   | 3.8    | 98.7        | -           |
| 9 月 末                    | 20,439      | 3.0    | 128,115.00   | 3.1    | 98.8        | -           |
| 10 月 末                   | 20,879      | 5.3    | 130,788.36   | 5.3    | 98.8        | -           |
| 11 月 末                   | 20,647      | 4.1    | 129,217.14   | 4.0    | 98.6        | -           |
| 12 月 末                   | 20,775      | 4.7    | 130,157.13   | 4.8    | 99.3        | -           |
| 2022 年 1 月 末             | 20,418      | 2.9    | 128,015.91   | 3.0    | 99.0        | -           |
| (期 末)<br>2022 年 2 月 21 日 | 20,152      | 1.6    | 126,280.23   | 1.7    | 98.9        | -           |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

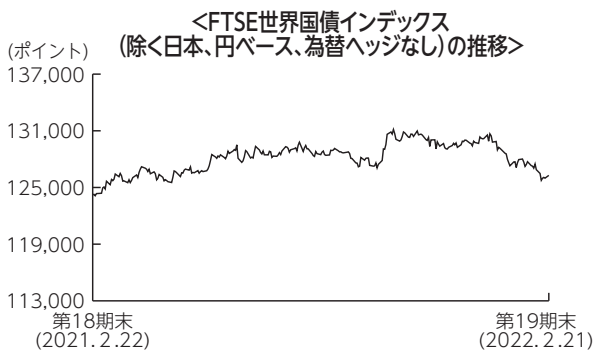


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆やインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもF O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから基準価額は上昇しました。



### 投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）がパンデ

ミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて円安ドル高が進みました。ユーロ／円は、E C Bがパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて円安ユーロ高となりました。

## ポートフォリオについて

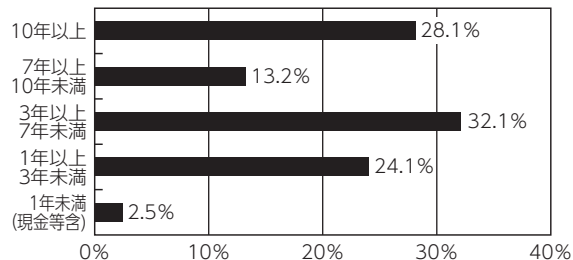
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

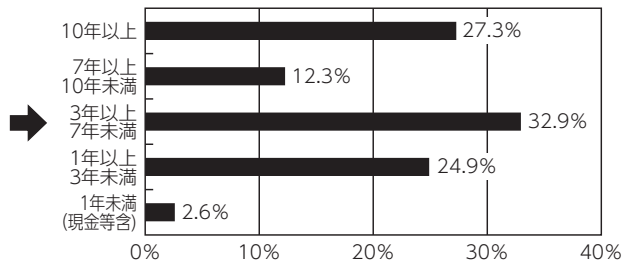
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存別構成比

#### 期首（前期末）



#### 期末



### ○国別構成比

#### 期首（前期末）

| 国         | 当ファンド  | 世界国債インデックス | 差     |
|-----------|--------|------------|-------|
| 北米        |        |            |       |
| 米国        | 42.4%  | 43.3%      | △0.9% |
| カナダ       | 2.0%   | 2.0%       | 0.0%  |
| 計         | 44.3%  | 45.2%      | △0.9% |
| 中南米       |        |            |       |
| メキシコ      | 0.8%   | 0.8%       | 0.0%  |
| 計         | 0.8%   | 0.8%       | 0.0%  |
| 欧州        |        |            |       |
| オーストリア    | 1.5%   | 1.6%       | △0.1% |
| ベルギー      | 2.5%   | 2.6%       | △0.1% |
| フィンランド    | 0.6%   | 0.7%       | 0.0%  |
| フランス      | 10.6%  | 10.7%      | △0.2% |
| ドイツ       | 7.5%   | 7.7%       | △0.2% |
| アイルランド    | 0.8%   | 0.9%       | 0.0%  |
| イタリア      | 9.5%   | 9.8%       | △0.3% |
| オランダ      | 1.8%   | 1.9%       | △0.1% |
| スペイン      | 6.1%   | 6.1%       | 0.0%  |
| ユーロ計      | 40.9%  | 41.9%      | △1.0% |
| デンマーク     | 0.5%   | 0.5%       | 0.0%  |
| スウェーデン    | 0.3%   | 0.3%       | 0.0%  |
| 英国        | 6.6%   | 6.6%       | 0.0%  |
| ポーランド     | 0.6%   | 0.7%       | 0.0%  |
| ノルウェー     | 0.2%   | 0.3%       | 0.0%  |
| 計         | 49.2%  | 50.3%      | △1.1% |
| アジア・オセアニア |        |            |       |
| オーストラリア   | 2.8%   | 2.3%       | 0.5%  |
| シンガポール    | 0.4%   | 0.4%       | 0.0%  |
| マレーシア     | 0.5%   | 0.5%       | 0.0%  |
| 計         | 3.6%   | 3.2%       | 0.4%  |
| 中近東       |        |            |       |
| イスラエル     | 0.4%   | 0.4%       | 0.0%  |
| 計         | 0.4%   | 0.4%       | 0.0%  |
| 現金など      | 1.6%   | -          | -     |
| 合計        | 100.0% | 100.0%     | -     |

#### 期末

| 国         | 当ファンド  | 世界国債インデックス | 差     |
|-----------|--------|------------|-------|
| 北米        |        |            |       |
| 米国        | 47.3%  | 48.0%      | △0.7% |
| カナダ       | 2.0%   | 2.0%       | △0.0% |
| 計         | 49.3%  | 50.0%      | △0.7% |
| 中南米       |        |            |       |
| メキシコ      | 0.7%   | 0.7%       | △0.0% |
| 計         | 0.7%   | 0.7%       | △0.0% |
| 欧州        |        |            |       |
| オーストリア    | 1.4%   | 1.4%       | △0.0% |
| ベルギー      | 2.2%   | 2.2%       | △0.0% |
| フィンランド    | 0.6%   | 0.6%       | △0.0% |
| フランス      | 9.7%   | 9.8%       | △0.1% |
| ドイツ       | 7.2%   | 7.2%       | △0.0% |
| アイルランド    | 0.8%   | 0.8%       | 0.0%  |
| イタリア      | 8.5%   | 8.7%       | △0.2% |
| オランダ      | 1.8%   | 1.9%       | △0.0% |
| スペイン      | 5.7%   | 5.7%       | 0.0%  |
| ユーロ計      | 37.8%  | 38.2%      | △0.4% |
| デンマーク     | 0.4%   | 0.4%       | 0.0%  |
| スウェーデン    | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
| 英国        | 5.8%   | 5.5%       | 0.3%  |
| ポーランド     | 0.5%   | 0.5%       | 0.0%  |
| ノルウェー     | 0.2%   | 0.3%       | △0.0% |
| 計         | 45.0%  | 45.1%      | △0.1% |
| アジア・オセアニア |        |            |       |
| オーストラリア   | 1.5%   | 1.6%       | △0.0% |
| 中国        | 0.9%   | 1.2%       | △0.3% |
| シンガポール    | 0.4%   | 0.4%       | 0.0%  |
| マレーシア     | 0.5%   | 0.5%       | 0.0%  |
| 計         | 3.4%   | 3.7%       | △0.3% |
| 中近東       |        |            |       |
| イスラエル     | 0.4%   | 0.4%       | △0.0% |
| 計         | 0.4%   | 0.4%       | △0.0% |
| 現金など      | 1.1%   | -          | -     |
| 合計        | 100.0% | 100.0%     | -     |

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

## 今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することをめざしたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目                  | 当 期 |         | 項 目 の 概 要                     |
|----------------------|-----|---------|-------------------------------|
|                      | 金 額 | 比 率     |                               |
| (a) そ の 他 費 用        | 3円  | 0.013%  | (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）            | (2) | (0.012) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用        |
| （そ の 他）              | (0) | (0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等          |
| 合 計                  | 3   | 0.013   |                               |
| 期中の平均基準価額は20,455円です。 |     |         |                               |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

公社債

|   |         |        | 買付額                   | 売付額                   |               |
|---|---------|--------|-----------------------|-----------------------|---------------|
| 外 | アメリカ    | 国債証券   | 千アメリカ・ドル<br>268,986   | 千アメリカ・ドル<br>208,086   |               |
|   | カナダ     | 国債証券   | 千カナダ・ドル<br>12,930     | 千カナダ・ドル<br>11,930     |               |
|   | オーストラリア | 国債証券   | 千オーストラリア・ドル<br>9,151  | 千オーストラリア・ドル<br>25,829 |               |
|   | シンガポール  | 国債証券   | 千シンガポール・ドル<br>1,943   | 千シンガポール・ドル<br>1,051   |               |
|   | イギリス    | 国債証券   | 千イギリス・ポンド<br>17,354   | 千イギリス・ポンド<br>23,217   |               |
|   | イスラエル   | 国債証券   | 千イスラエル・シケル<br>2,356   | 千イスラエル・シケル<br>2,830   |               |
|   | デンマーク   | 国債証券   | 千デンマーク・クローネ<br>7,060  | 千デンマーク・クローネ<br>8,562  |               |
|   | ノルウェー   | 国債証券   | 千ノルウェー・クローネ<br>4,563  | 千ノルウェー・クローネ<br>1,066  |               |
|   | スウェーデン  | 国債証券   | 千スウェーデン・クローナ<br>8,059 | 千スウェーデン・クローナ<br>9,098 |               |
|   | メキシコ    | 国債証券   | 千メキシコ・ペソ<br>34,009    | 千メキシコ・ペソ<br>31,722    |               |
|   | 中国      | 国債証券   | 千オフショア・人民元<br>69,942  | 千オフショア・人民元<br>-       |               |
|   | マレーシア   | 国債証券   | 千マレーシア・リンギット<br>8,092 | 千マレーシア・リンギット<br>3,048 |               |
|   | ポーランド   | 国債証券   | 千ポーランド・ズロチ<br>6,845   | 千ポーランド・ズロチ<br>10,987  |               |
| 国 | ユーロ     | アイルランド | 国債証券                  | 千ユーロ<br>3,107         | 千ユーロ<br>3,037 |
|   |         | オランダ   | 国債証券                  | 8,961                 | 7,954         |
|   |         | ベルギー   | 国債証券                  | 8,673                 | 9,501         |
|   |         | フランス   | 国債証券                  | 35,154                | 35,216        |
|   |         | ドイツ    | 国債証券                  | 29,446                | 28,519        |
|   |         | スペイン   | 国債証券                  | 20,859                | 19,722        |
|   |         | イタリア   | 国債証券                  | 34,035                | 34,844        |
|   |         | フィンランド | 国債証券                  | 1,917                 | 1,829         |
|   | オーストリア  | 国債証券   | 5,708                 | 5,408                 |               |

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

## ■利害関係人との取引状況等 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分     | 当 期 末                   |                         |                   |           |                    |           |           |          |
|---------|-------------------------|-------------------------|-------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|----------|
|         | 額 面 金 額                 | 評 価 額                   |                   | 組入比率      | うち B B 格<br>以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|         |                         | 外 貨 建 金 額               | 邦 貨 換 算 金 額       |           |                    | 5 年 以 上   | 2 年 以 上   | 2 年 未 満  |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル<br>584,890     | 千アメリカ・ドル<br>583,959     | 千円<br>67,190,361  | %<br>47.3 | %<br>-             | %<br>21.3 | %<br>16.7 | %<br>9.3 |
| カ ナ ダ   | 千カナダ・ドル<br>30,950       | 千カナダ・ドル<br>31,321       | 千円<br>2,828,620   | 2.0       | -                  | 1.0       | 0.6       | 0.4      |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>26,270   | 千オーストラリア・ドル<br>26,417   | 千円<br>2,185,214   | 1.5       | -                  | 1.1       | 0.4       | 0.1      |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>7,070     | 千シンガポール・ドル<br>7,353     | 千円<br>629,080     | 0.4       | -                  | 0.3       | 0.1       | 0.1      |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>45,350     | 千イギリス・ポンド<br>52,558     | 千円<br>8,228,549   | 5.8       | -                  | 4.4       | 0.8       | 0.6      |
| イスラエル   | 千イスラエル・シケル<br>15,260    | 千イスラエル・シケル<br>16,525    | 千円<br>593,263     | 0.4       | -                  | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>29,720   | 千デンマーク・クローネ<br>34,886   | 千円<br>611,555     | 0.4       | -                  | 0.4       | 0.1       | -        |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>26,720   | 千ノルウェー・クローネ<br>26,440   | 千円<br>339,233     | 0.2       | -                  | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| スウェーデン  | 千スウェーデン・クローナ<br>29,060  | 千スウェーデン・クローナ<br>31,703  | 千円<br>388,054     | 0.3       | -                  | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>182,626     | 千メキシコ・ペソ<br>183,799     | 千円<br>1,043,651   | 0.7       | -                  | 0.4       | 0.2       | 0.1      |
| 中 国     | 千オフショア・人民元<br>69,550    | 千オフショア・人民元<br>70,200    | 千円<br>1,277,451   | 0.9       | -                  | 0.4       | 0.3       | 0.2      |
| マレーシア   | 千マレーシア・リングギット<br>26,830 | 千マレーシア・リングギット<br>27,661 | 千円<br>759,920     | 0.5       | -                  | 0.3       | 0.2       | 0.0      |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>24,380    | 千ポーランド・ズロチ<br>23,028    | 千円<br>662,640     | 0.5       | -                  | 0.2       | 0.2       | 0.1      |
| ユ ー ロ   | 千ユーロ                    | 千ユーロ                    | 千円                |           |                    |           |           |          |
| アイルランド  | 8,040                   | 8,505                   | 1,108,814         | 0.8       | -                  | 0.6       | 0.2       | 0.1      |
| オランダ    | 17,350                  | 19,673                  | 2,564,646         | 1.8       | -                  | 1.2       | 0.4       | 0.2      |
| ベルギー    | 21,000                  | 23,852                  | 3,109,389         | 2.2       | -                  | 1.6       | 0.4       | 0.1      |
| フランス    | 95,460                  | 106,041                 | 13,823,543        | 9.7       | -                  | 6.2       | 2.6       | 0.9      |
| ドイツ     | 69,560                  | 78,033                  | 10,172,441        | 7.2       | -                  | 4.3       | 1.9       | 1.0      |
| スペイン    | 55,960                  | 61,598                  | 8,030,031         | 5.7       | -                  | 3.6       | 1.5       | 0.6      |
| イタリア    | 85,330                  | 92,683                  | 12,082,236        | 8.5       | -                  | 5.0       | 2.4       | 1.0      |
| フィンランド  | 6,020                   | 6,268                   | 817,158           | 0.6       | -                  | 0.3       | 0.2       | 0.1      |
| オーストリア  | 13,495                  | 14,981                  | 1,952,943         | 1.4       | -                  | 0.9       | 0.3       | 0.2      |
| 合 計     | -                       | -                       | 千円<br>140,398,802 | 98.9      | -                  | 53.9      | 30.0      | 15.0     |

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。



(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄                      | 当<br>期 | 種<br>類 | 利<br>率 | 額<br>面<br>金<br>額 | 評 価 額    |         | 末<br>償還年月日 |
|-------------------------|--------|--------|--------|------------------|----------|---------|------------|
|                         |        |        |        |                  | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                         |        |        |        |                  | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| (アメリカ)                  |        |        | %      | 千アメリカ・ドル         | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| US T N/B 2.625 01/31/26 |        | 国債証券   | 2.6250 | 2,180            | 2,246    | 258,512 | 2026/01/31 |
| US T N/B 2.25 01/31/24  |        | 国債証券   | 2.2500 | 350              | 355      | 40,862  | 2024/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/23  |        | 国債証券   | 1.7500 | 4,980            | 5,012    | 576,759 | 2023/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/31/24   |        | 国債証券   | 2.5000 | 3,890            | 3,965    | 456,290 | 2024/01/31 |
| US T N/B 0.125 01/15/24 |        | 国債証券   | 0.1250 | 5,000            | 4,874    | 560,850 | 2024/01/15 |
| US T N/B 1.5 01/31/27   |        | 国債証券   | 1.5000 | 2,490            | 2,452    | 282,145 | 2027/01/31 |
| US T N/B 1.375 01/31/25 |        | 国債証券   | 1.3750 | 3,280            | 3,250    | 373,976 | 2025/01/31 |
| US T N/B 0.75 01/31/28  |        | 国債証券   | 0.7500 | 3,390            | 3,174    | 365,233 | 2028/01/31 |
| US T N/B 0.375 01/31/26 |        | 国債証券   | 0.3750 | 1,500            | 1,418    | 163,164 | 2026/01/31 |
| US T N/B 6.0 02/15/26   |        | 国債証券   | 6.0000 | 840              | 976      | 112,356 | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 |        | 国債証券   | 3.1250 | 680              | 768      | 88,430  | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 |        | 国債証券   | 3.1250 | 1,440            | 1,624    | 186,902 | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46   |        | 国債証券   | 2.5000 | 1,770            | 1,816    | 208,954 | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39   |        | 国債証券   | 3.5000 | 900              | 1,068    | 122,986 | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 |        | 国債証券   | 5.3750 | 700              | 902      | 103,811 | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36   |        | 国債証券   | 4.5000 | 630              | 824      | 94,919  | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41  |        | 国債証券   | 4.7500 | 1,200            | 1,659    | 190,943 | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 |        | 国債証券   | 3.6250 | 1,630            | 1,984    | 228,383 | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49   |        | 国債証券   | 3.0000 | 3,070            | 3,512    | 404,149 | 2049/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 |        | 国債証券   | 4.3750 | 550              | 719      | 82,811  | 2038/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 |        | 国債証券   | 4.6250 | 750              | 1,018    | 117,206 | 2040/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/51 |        | 国債証券   | 1.8750 | 4,770            | 4,360    | 501,670 | 2051/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 |        | 国債証券   | 1.6250 | 2,180            | 2,165    | 249,125 | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45   |        | 国債証券   | 2.5000 | 2,080            | 2,127    | 244,840 | 2045/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47   |        | 国債証券   | 3.0000 | 1,640            | 1,845    | 212,366 | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48   |        | 国債証券   | 3.0000 | 2,540            | 2,886    | 332,094 | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/24  |        | 国債証券   | 2.7500 | 5,320            | 5,450    | 627,135 | 2024/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/25   |        | 国債証券   | 2.0000 | 4,300            | 4,338    | 499,241 | 2025/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 |        | 国債証券   | 2.6250 | 4,110            | 4,301    | 494,897 | 2029/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/28  |        | 国債証券   | 2.7500 | 2,370            | 2,484    | 285,836 | 2028/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/23   |        | 国債証券   | 2.0000 | 4,370            | 4,410    | 507,447 | 2023/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27  |        | 国債証券   | 2.2500 | 3,550            | 3,622    | 416,791 | 2027/02/15 |
| US T N/B 2.125 02/29/24 |        | 国債証券   | 2.1250 | 1,300            | 1,316    | 151,436 | 2024/02/29 |
| US T N/B 1.5 02/28/23   |        | 国債証券   | 1.5000 | 1,000            | 1,003    | 115,513 | 2023/02/28 |
| US T N/B 2.5 02/28/26   |        | 国債証券   | 2.5000 | 2,550            | 2,616    | 301,058 | 2026/02/28 |
| US T N/B 2.75 02/28/25  |        | 国債証券   | 2.7500 | 1,660            | 1,710    | 196,774 | 2025/02/28 |
| US T N/B 2.625 02/28/23 |        | 国債証券   | 2.6250 | 1,800            | 1,827    | 210,279 | 2023/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/15/31 |        | 国債証券   | 1.1250 | 6,860            | 6,409    | 737,420 | 2031/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/41 |        | 国債証券   | 1.8750 | 4,110            | 3,824    | 440,015 | 2041/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/50   |        | 国債証券   | 2.0000 | 3,270            | 3,079    | 354,288 | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.375 02/15/23 |        | 国債証券   | 1.3750 | 4,000            | 4,012    | 461,696 | 2023/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/27 |        | 国債証券   | 1.1250 | 1,100            | 1,063    | 122,319 | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/15/30   |        | 国債証券   | 1.5000 | 2,970            | 2,881    | 331,543 | 2030/02/15 |
| US T N/B 0.125 02/15/24 |        | 国債証券   | 0.1250 | 4,000            | 3,894    | 448,050 | 2024/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/25 |        | 国債証券   | 1.1250 | 1,000            | 983      | 113,136 | 2025/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/29/28 |        | 国債証券   | 1.1250 | 3,020            | 2,889    | 332,523 | 2028/02/29 |
| US T N/B 0.5 02/28/26   |        | 国債証券   | 0.5000 | 2,500            | 2,372    | 273,020 | 2026/02/28 |
| US T N/B 2.125 03/31/24 |        | 国債証券   | 2.1250 | 4,080            | 4,130    | 475,221 | 2024/03/31 |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |         | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|---------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |         | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| US T N/B 1.5 03/31/23   | 国債証券 | 1.5000 | 2,000    | 2,007    | 231,000 | 2023/03/31 |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,150    | 2,209    | 254,220 | 2025/03/31 |
| US T N/B 2.25 03/31/26  | 国債証券 | 2.2500 | 2,260    | 2,297    | 264,403 | 2026/03/31 |
| US T N/B 2.5 03/31/23   | 国債証券 | 2.5000 | 3,020    | 3,065    | 352,693 | 2023/03/31 |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 1,800    | 1,694    | 195,021 | 2027/03/31 |
| US T N/B 0.25 03/15/24  | 国債証券 | 0.2500 | 4,810    | 4,686    | 539,213 | 2024/03/15 |
| US T N/B 0.5 03/31/25   | 国債証券 | 0.5000 | 1,300    | 1,252    | 144,149 | 2025/03/31 |
| US T N/B 1.25 03/31/28  | 国債証券 | 1.2500 | 2,910    | 2,801    | 322,294 | 2028/03/31 |
| US T N/B 0.75 03/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 2,570    | 2,461    | 283,275 | 2026/03/31 |
| US T N/B 0.5 03/15/23   | 国債証券 | 0.5000 | 2,000    | 1,986    | 228,603 | 2023/03/15 |
| US T N/B 1.625 04/30/23 | 国債証券 | 1.6250 | 3,000    | 3,014    | 346,892 | 2023/04/30 |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 1,760    | 1,798    | 206,967 | 2026/04/30 |
| US T N/B 2.75 04/30/23  | 国債証券 | 2.7500 | 2,490    | 2,534    | 291,636 | 2023/04/30 |
| US T N/B 2.25 04/30/24  | 国債証券 | 2.2500 | 3,300    | 3,350    | 385,452 | 2024/04/30 |
| US T N/B 0.25 04/15/23  | 国債証券 | 0.2500 | 2,000    | 1,978    | 227,648 | 2023/04/15 |
| US T N/B 1.25 04/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 3,170    | 3,049    | 350,891 | 2028/04/30 |
| US T N/B 0.375 04/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 5,000    | 4,880    | 561,546 | 2024/04/15 |
| US T N/B 0.5 04/30/27   | 国債証券 | 0.5000 | 2,000    | 1,868    | 215,027 | 2027/04/30 |
| US T N/B 0.75 04/30/26  | 国債証券 | 0.7500 | 3,000    | 2,871    | 330,348 | 2026/04/30 |
| US T N/B 0.375 04/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 2,000    | 1,916    | 220,510 | 2025/04/30 |
| US T N/B 6.25 05/15/30  | 国債証券 | 6.2500 | 710      | 945      | 108,785 | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 800      | 1,058    | 121,762 | 2040/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 1,040    | 1,378    | 158,590 | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42   | 国債証券 | 3.0000 | 980      | 1,087    | 125,135 | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39  | 国債証券 | 4.2500 | 810      | 1,051    | 121,019 | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 1,900    | 2,061    | 237,247 | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/51 | 国債証券 | 2.3750 | 4,300    | 4,403    | 506,624 | 2051/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 1,530    | 1,799    | 207,027 | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45   | 国債証券 | 3.0000 | 500      | 556      | 64,083  | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47   | 国債証券 | 3.0000 | 1,290    | 1,455    | 167,456 | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46   | 国債証券 | 2.5000 | 1,810    | 1,857    | 213,700 | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 1,630    | 1,896    | 218,229 | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 2,100    | 1,727    | 198,775 | 2040/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 国債証券 | 2.8750 | 3,090    | 3,463    | 398,477 | 2049/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/15/38   | 国債証券 | 4.5000 | 540      | 717      | 82,505  | 2038/05/15 |
| US T N/B 2.25 05/15/41  | 国債証券 | 2.2500 | 3,890    | 3,839    | 441,813 | 2041/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/23  | 国債証券 | 1.7500 | 2,620    | 2,636    | 303,364 | 2023/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/24   | 国債証券 | 2.5000 | 4,240    | 4,328    | 497,992 | 2024/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 3,320    | 3,361    | 386,804 | 2025/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 4,430    | 4,683    | 538,845 | 2028/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 2,810    | 2,899    | 333,573 | 2029/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 4,700    | 4,824    | 555,104 | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37   | 国債証券 | 5.0000 | 500      | 692      | 79,692  | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 3,090    | 3,067    | 352,896 | 2026/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 2,900    | 2,913    | 335,277 | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.0 05/31/24   | 国債証券 | 2.0000 | 4,770    | 4,816    | 554,195 | 2024/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/15/50  | 国債証券 | 1.2500 | 3,780    | 2,961    | 340,805 | 2050/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 2,050    | 2,075    | 238,821 | 2026/05/31 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 6,740    | 6,567    | 755,601 | 2031/05/15 |
| US T N/B 2.75 05/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 3,270    | 3,331    | 383,330 | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 2,530    | 2,620    | 301,472 | 2025/05/31 |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |         | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|---------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |         | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| US T N/B 0.5 05/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 1,500    | 1,398    | 160,926 | 2027/05/31 |
| US T N/B 0.125 05/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 3,000    | 2,960    | 340,582 | 2023/05/15 |
| US T N/B 1.25 05/31/28  | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 3,844    | 442,351 | 2028/05/31 |
| US T N/B 0.25 05/15/24  | 国債証券 | 0.2500 | 2,000    | 1,943    | 223,611 | 2024/05/15 |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 4,220    | 3,807    | 438,060 | 2030/05/15 |
| US T N/B 0.75 05/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 3,000    | 2,868    | 330,051 | 2026/05/31 |
| US T N/B 0.25 05/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 4,470    | 4,257    | 489,888 | 2025/05/31 |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 3,460    | 3,461    | 398,325 | 2023/06/30 |
| US T N/B 2.75 06/30/25  | 国債証券 | 2.7500 | 790      | 815      | 93,823  | 2025/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 1,450    | 1,453    | 167,188 | 2026/06/30 |
| US T N/B 2.625 06/30/23 | 国債証券 | 2.6250 | 1,820    | 1,851    | 213,090 | 2023/06/30 |
| US T N/B 1.75 06/30/24  | 国債証券 | 1.7500 | 1,340    | 1,345    | 154,794 | 2024/06/30 |
| US T N/B 0.5 06/30/27   | 国債証券 | 0.5000 | 1,540    | 1,434    | 165,079 | 2027/06/30 |
| US T N/B 1.25 06/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 3,000    | 2,881    | 331,507 | 2028/06/30 |
| US T N/B 0.25 06/15/23  | 国債証券 | 0.2500 | 2,800    | 2,762    | 317,851 | 2023/06/15 |
| US T N/B 0.25 06/30/25  | 国債証券 | 0.2500 | 3,000    | 2,852    | 328,217 | 2025/06/30 |
| US T N/B 0.25 06/15/24  | 国債証券 | 0.2500 | 3,780    | 3,666    | 421,912 | 2024/06/15 |
| US T N/B 0.875 06/30/26 | 国債証券 | 0.8750 | 3,310    | 3,180    | 365,912 | 2026/06/30 |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 1,860    | 1,928    | 221,936 | 2025/07/31 |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 国債証券 | 1.8750 | 2,370    | 2,375    | 273,331 | 2026/07/31 |
| US T N/B 1.75 07/31/24  | 国債証券 | 1.7500 | 3,690    | 3,704    | 426,196 | 2024/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 3,270    | 3,336    | 383,859 | 2023/07/31 |
| US T N/B 0.125 07/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 1,600    | 1,573    | 181,003 | 2023/07/15 |
| US T N/B 0.125 07/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 2,640    | 2,594    | 298,501 | 2023/07/31 |
| US T N/B 1.0 07/31/28   | 国債証券 | 1.0000 | 3,000    | 2,833    | 326,019 | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.375 07/31/27 | 国債証券 | 0.3750 | 3,500    | 3,234    | 372,176 | 2027/07/31 |
| US T N/B 0.25 07/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,000    | 949      | 109,262 | 2025/07/31 |
| US T N/B 0.625 07/31/26 | 国債証券 | 0.6250 | 3,200    | 3,037    | 349,465 | 2026/07/31 |
| US T N/B 6.25 08/15/23  | 国債証券 | 6.2500 | 1,000    | 1,072    | 123,419 | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 国債証券 | 3.7500 | 710      | 871      | 100,296 | 2041/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 1,110    | 1,379    | 158,727 | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 430      | 458      | 52,757  | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 1,750    | 1,982    | 228,144 | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 国債証券 | 4.5000 | 790      | 1,056    | 121,546 | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 1,170    | 1,420    | 163,489 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/51   | 国債証券 | 2.0000 | 3,690    | 3,475    | 399,893 | 2051/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 740      | 809      | 93,126  | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25   | 国債証券 | 2.0000 | 2,680    | 2,700    | 310,769 | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 1,880    | 2,034    | 234,124 | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49  | 国債証券 | 2.2500 | 1,490    | 1,479    | 170,247 | 2049/08/15 |
| US T N/B 2.5 08/15/23   | 国債証券 | 2.5000 | 4,330    | 4,405    | 506,928 | 2023/08/15 |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 3,920    | 3,993    | 459,456 | 2024/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46  | 国債証券 | 2.2500 | 1,710    | 1,675    | 192,809 | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48   | 国債証券 | 3.0000 | 2,710    | 3,085    | 355,027 | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 2,530    | 2,583    | 297,208 | 2027/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26   | 国債証券 | 1.5000 | 3,090    | 3,047    | 350,619 | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 3,730    | 3,948    | 454,270 | 2028/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25  | 国債証券 | 2.7500 | 1,640    | 1,694    | 194,934 | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 3,380    | 3,316    | 381,610 | 2029/08/15 |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 820      | 825      | 94,960  | 2024/08/31 |
| US T N/B 2.75 08/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 2,170    | 2,214    | 254,829 | 2023/08/31 |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |         | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|---------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |         | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| US T N/B 1.75 08/15/41  | 国債証券 | 1.7500 | 3,570    | 3,241    | 372,977 | 2041/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 3,500    | 2,867    | 329,970 | 2040/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 国債証券 | 1.3750 | 4,040    | 3,267    | 375,941 | 2050/08/15 |
| US T N/B 1.25 08/15/31  | 国債証券 | 1.2500 | 7,160    | 6,739    | 775,493 | 2031/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 5,920    | 5,322    | 612,401 | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | 1,100    | 1,079    | 124,173 | 2026/08/31 |
| US T N/B 1.25 08/31/24  | 国債証券 | 1.2500 | 2,440    | 2,417    | 278,180 | 2024/08/31 |
| US T N/B 0.25 08/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,000    | 947      | 109,055 | 2025/08/31 |
| US T N/B 0.375 08/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 3,500    | 3,396    | 390,848 | 2024/08/15 |
| US T N/B 0.125 08/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 2,000    | 1,963    | 225,931 | 2023/08/15 |
| US T N/B 0.125 08/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 530      | 520      | 59,850  | 2023/08/31 |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 国債証券 | 1.1250 | 3,000    | 2,853    | 328,352 | 2028/08/31 |
| US T N/B 0.5 08/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 4,340    | 4,030    | 463,722 | 2027/08/31 |
| US T N/B 0.75 08/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 4,000    | 3,814    | 438,917 | 2026/08/31 |
| US T N/B 3.0 09/30/25   | 国債証券 | 3.0000 | 1,410    | 1,470    | 169,205 | 2025/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 2,930    | 2,966    | 341,339 | 2024/09/30 |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 1,500    | 1,499    | 172,549 | 2023/09/30 |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 840      | 859      | 98,938  | 2023/09/30 |
| US T N/B 0.125 09/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 2,000    | 1,961    | 225,697 | 2023/09/15 |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国債証券 | 0.3750 | 1,050    | 967      | 111,270 | 2027/09/30 |
| US T N/B 0.25 09/30/23  | 国債証券 | 0.2500 | 2,500    | 2,455    | 282,514 | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,900    | 1,883    | 216,718 | 2026/09/30 |
| US T N/B 1.25 09/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 3,000    | 2,875    | 330,846 | 2028/09/30 |
| US T N/B 0.25 09/30/25  | 国債証券 | 0.2500 | 3,000    | 2,840    | 326,815 | 2025/09/30 |
| US T N/B 0.875 09/30/26 | 国債証券 | 0.8750 | 2,370    | 2,270    | 261,294 | 2026/09/30 |
| US T N/B 0.375 09/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 2,000    | 1,937    | 222,946 | 2024/09/15 |
| US T N/B 2.25 10/31/24  | 国債証券 | 2.2500 | 2,000    | 2,031    | 233,787 | 2024/10/31 |
| US T N/B 3.0 10/31/25   | 国債証券 | 3.0000 | 1,920    | 2,002    | 230,442 | 2025/10/31 |
| US T N/B 1.625 10/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 4,500    | 4,514    | 519,388 | 2023/10/31 |
| US T N/B 2.875 10/31/23 | 国債証券 | 2.8750 | 3,690    | 3,779    | 434,853 | 2023/10/31 |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,350    | 1,338    | 153,996 | 2026/10/31 |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 4,000    | 3,862    | 444,455 | 2028/10/31 |
| US T N/B 1.5 10/31/24   | 国債証券 | 1.5000 | 2,200    | 2,191    | 252,123 | 2024/10/31 |
| US T N/B 0.5 10/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 3,000    | 2,778    | 319,655 | 2027/10/31 |
| US T N/B 1.125 10/31/26 | 国債証券 | 1.1250 | 2,000    | 1,937    | 222,892 | 2026/10/31 |
| US T N/B 0.625 10/15/24 | 国債証券 | 0.6250 | 3,500    | 3,410    | 392,359 | 2024/10/15 |
| US T N/B 0.25 10/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 2,000    | 1,890    | 217,463 | 2025/10/31 |
| US T N/B 5.25 11/15/28  | 国債証券 | 5.2500 | 850      | 1,030    | 118,560 | 2028/11/15 |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 900      | 1,108    | 127,573 | 2027/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/44   | 国債証券 | 3.0000 | 1,790    | 1,990    | 229,031 | 2044/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/40  | 国債証券 | 4.2500 | 510      | 663      | 76,330  | 2040/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 1,220    | 1,300    | 149,607 | 2042/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 760      | 857      | 98,608  | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43  | 国債証券 | 3.7500 | 1,360    | 1,682    | 193,639 | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 2,140    | 2,316    | 266,523 | 2047/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 国債証券 | 1.6250 | 4,400    | 3,786    | 435,703 | 2050/11/15 |
| US T N/B 1.875 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 3,700    | 3,389    | 389,951 | 2051/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45   | 国債証券 | 3.0000 | 650      | 726      | 83,611  | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 920      | 1,011    | 116,391 | 2046/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/24  | 国債証券 | 2.2500 | 4,690    | 4,768    | 548,611 | 2024/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 910      | 1,199    | 138,021 | 2039/11/15 |

| 銘柄                      | 当    | 期      |         |          |            | 末          |       |        |
|-------------------------|------|--------|---------|----------|------------|------------|-------|--------|
|                         |      | 種類     | 利率      | 額面金額     | 評価額        |            | 償還年月日 |        |
|                         |      |        |         |          | 外貨建金額      |            |       | 邦貨換算金額 |
| <b>(アメリカ)</b>           |      |        | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル   | 千円         |       |        |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 2,660   | 3,242    | 373,069    | 2048/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 2,770   | 2,827    | 325,339    | 2049/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.25 11/15/25  | 国債証券 | 2.2500 | 4,690   | 4,767    | 548,526    | 2025/11/15 |       |        |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 3,670   | 3,949    | 454,385    | 2028/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.75 11/15/23  | 国債証券 | 2.7500 | 5,520   | 5,642    | 649,272    | 2023/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.0 11/15/26   | 国債証券 | 2.0000 | 2,140   | 2,157    | 248,248    | 2026/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.25 11/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 3,270   | 3,335    | 383,829    | 2027/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.125 11/30/23 | 国債証券 | 2.1250 | 2,000   | 2,023    | 232,852    | 2023/11/30 |       |        |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 国債証券 | 1.3750 | 2,810   | 2,401    | 276,361    | 2040/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.0 11/15/41   | 国債証券 | 2.0000 | 1,770   | 1,678    | 193,091    | 2041/11/15 |       |        |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,810   | 1,794    | 206,452    | 2026/11/30 |       |        |
| US T N/B 1.75 11/15/29  | 国債証券 | 1.7500 | 1,940   | 1,919    | 220,879    | 2029/11/15 |       |        |
| US T N/B 1.375 11/15/31 | 国債証券 | 1.3750 | 3,520   | 3,344    | 384,823    | 2031/11/15 |       |        |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | 0.8750 | 6,000   | 5,497    | 632,515    | 2030/11/15 |       |        |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 国債証券 | 0.6250 | 2,000   | 1,862    | 214,326    | 2027/11/30 |       |        |
| US T N/B 1.25 11/30/26  | 国債証券 | 1.2500 | 2,000   | 1,948    | 224,196    | 2026/11/30 |       |        |
| US T N/B 1.5 11/30/28   | 国債証券 | 1.5000 | 2,000   | 1,946    | 223,971    | 2028/11/30 |       |        |
| US T N/B 1.5 11/30/24   | 国債証券 | 1.5000 | 2,000   | 1,991    | 229,167    | 2024/11/30 |       |        |
| US T N/B 0.375 11/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 2,590   | 2,456    | 282,592    | 2025/11/30 |       |        |
| US T N/B 0.75 11/15/24  | 国債証券 | 0.7500 | 1,490   | 1,454    | 167,340    | 2024/11/15 |       |        |
| US T N/B 2.625 12/31/23 | 国債証券 | 2.6250 | 3,060   | 3,124    | 359,482    | 2023/12/31 |       |        |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,290   | 2,361    | 271,659    | 2025/12/31 |       |        |
| US T N/B 2.25 12/31/24  | 国債証券 | 2.2500 | 3,000   | 3,048    | 350,735    | 2024/12/31 |       |        |
| US T N/B 1.75 12/31/26  | 国債証券 | 1.7500 | 1,740   | 1,735    | 199,641    | 2026/12/31 |       |        |
| US T N/B 0.125 12/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 2,000   | 1,952    | 224,672    | 2023/12/15 |       |        |
| US T N/B 1.25 12/31/26  | 国債証券 | 1.2500 | 1,390   | 1,353    | 155,753    | 2026/12/31 |       |        |
| US T N/B 1.75 12/31/24  | 国債証券 | 1.7500 | 1,600   | 1,603    | 184,484    | 2024/12/31 |       |        |
| US T N/B 1.375 12/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 1,500   | 1,447    | 166,596    | 2028/12/31 |       |        |
| US T N/B 0.375 12/31/25 | 国債証券 | 0.3750 | 3,000   | 2,841    | 326,950    | 2025/12/31 |       |        |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 2,430   | 2,260    | 260,078    | 2027/12/31 |       |        |
| US T N/B 1.0 12/15/24   | 国債証券 | 1.0000 | 3,710   | 3,643    | 419,185    | 2024/12/15 |       |        |
| 小計                      | —    | —      | 584,890 | 583,959  | 67,190,361 | —          |       |        |
| <b>(カナダ)</b>            |      |        | %       | 千カナダ・ドル  | 千カナダ・ドル    | 千円         |       |        |
| CANADA 0.25 02/01/23    | 国債証券 | 0.2500 | 500     | 495      | 44,751     | 2023/02/01 |       |        |
| CANADA 0.75 02/01/24    | 国債証券 | 0.7500 | 200     | 197      | 17,807     | 2024/02/01 |       |        |
| CANADA 2.25 03/01/24    | 国債証券 | 2.2500 | 530     | 537      | 48,581     | 2024/03/01 |       |        |
| CANADA 1.75 03/01/23    | 国債証券 | 1.7500 | 460     | 462      | 41,759     | 2023/03/01 |       |        |
| CANADA 1.25 03/01/25    | 国債証券 | 1.2500 | 700     | 692      | 62,548     | 2025/03/01 |       |        |
| CANADA 0.25 03/01/26    | 国債証券 | 0.2500 | 1,300   | 1,228    | 110,932    | 2026/03/01 |       |        |
| CANADA 1.25 03/01/27    | 国債証券 | 1.2500 | 400     | 390      | 35,242     | 2027/03/01 |       |        |
| CANADA 0.25 04/01/24    | 国債証券 | 0.2500 | 1,500   | 1,461    | 131,967    | 2024/04/01 |       |        |
| CANADA 0.25 05/01/23    | 国債証券 | 0.2500 | 1,000   | 988      | 89,230     | 2023/05/01 |       |        |
| CANADA 1.5 06/01/26     | 国債証券 | 1.5000 | 700     | 695      | 62,790     | 2026/06/01 |       |        |
| CANADA 5.75 06/01/29    | 国債証券 | 5.7500 | 1,000   | 1,271    | 114,826    | 2029/06/01 |       |        |
| CANADA 5.75 06/01/33    | 国債証券 | 5.7500 | 520     | 715      | 64,624     | 2033/06/01 |       |        |
| CANADA 5.0 06/01/37     | 国債証券 | 5.0000 | 390     | 535      | 48,333     | 2037/06/01 |       |        |
| CANADA 2.5 06/01/24     | 国債証券 | 2.5000 | 1,550   | 1,583    | 143,008    | 2024/06/01 |       |        |
| CANADA 4.0 06/01/41     | 国債証券 | 4.0000 | 540     | 695      | 62,770     | 2041/06/01 |       |        |
| CANADA 1.5 06/01/23     | 国債証券 | 1.5000 | 1,210   | 1,212    | 109,543    | 2023/06/01 |       |        |
| CANADA 2.0 06/01/28     | 国債証券 | 2.0000 | 420     | 426      | 38,543     | 2028/06/01 |       |        |
| CANADA 2.25 06/01/25    | 国債証券 | 2.2500 | 900     | 918      | 82,937     | 2025/06/01 |       |        |

| 銘柄                       | 当    |        |             | 期           |           | 末          |
|--------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
|                          | 種類   | 利率     | 額面金額        | 評価額         |           | 償還年月日      |
|                          |      |        |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |
| <b>(カナダ)</b>             |      | %      | 千カナダ・ドル     | 千カナダ・ドル     | 千円        |            |
| CANADA 1.0 06/01/27      | 国債証券 | 1.0000 | 700         | 675         | 60,979    | 2027/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/29     | 国債証券 | 2.2500 | 610         | 630         | 56,956    | 2029/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30     | 国債証券 | 1.2500 | 1,810       | 1,734       | 156,601   | 2030/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/31      | 国債証券 | 1.5000 | 1,970       | 1,907       | 172,277   | 2031/06/01 |
| CANADA 0.25 08/01/23     | 国債証券 | 0.2500 | 700         | 689         | 62,232    | 2023/08/01 |
| CANADA 1.5 09/01/24      | 国債証券 | 1.5000 | 440         | 439         | 39,675    | 2024/09/01 |
| CANADA 2.0 09/01/23      | 国債証券 | 2.0000 | 880         | 888         | 80,238    | 2023/09/01 |
| CANADA 0.5 09/01/25      | 国債証券 | 0.5000 | 1,550       | 1,488       | 134,402   | 2025/09/01 |
| CANADA 1.0 09/01/26      | 国債証券 | 1.0000 | 1,070       | 1,036       | 93,644    | 2026/09/01 |
| CANADA 0.5 11/01/23      | 国債証券 | 0.5000 | 620         | 610         | 55,141    | 2023/11/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45      | 国債証券 | 3.5000 | 610         | 759         | 68,622    | 2045/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/48     | 国債証券 | 2.7500 | 580         | 648         | 58,602    | 2048/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51      | 国債証券 | 2.0000 | 2,430       | 2,348       | 212,098   | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53     | 国債証券 | 1.7500 | 710         | 639         | 57,733    | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64     | 国債証券 | 2.7500 | 350         | 400         | 36,137    | 2064/12/01 |
| CANADA 0.5 12/01/30      | 国債証券 | 0.5000 | 1,500       | 1,338       | 120,867   | 2030/12/01 |
| CANADA 1.5 12/01/31      | 国債証券 | 1.5000 | 600         | 578         | 52,208    | 2031/12/01 |
| 小計                       | —    | —      | 30,950      | 31,321      | 2,828,620 | —          |
| <b>(オーストラリア)</b>         |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円        |            |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47  | 国債証券 | 3.0000 | 760         | 785         | 64,983    | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 190         | 199         | 16,492    | 2025/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 1,480       | 1,528       | 126,464   | 2024/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 1,810       | 1,985       | 164,228   | 2026/04/21 |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23  | 国債証券 | 5.5000 | 1,120       | 1,181       | 97,774    | 2023/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 1,000       | 1,075       | 88,946    | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33  | 国債証券 | 4.5000 | 880         | 1,073       | 88,815    | 2033/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 760         | 879         | 72,734    | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 800         | 810         | 67,006    | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30  | 国債証券 | 2.5000 | 1,550       | 1,587       | 131,338   | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 740         | 743         | 61,485    | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 990         | 900         | 74,452    | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 620         | 672         | 55,650    | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31  | 国債証券 | 1.5000 | 1,300       | 1,221       | 101,046   | 2031/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 530         | 550         | 45,578    | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 930         | 736         | 60,943    | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 0.5 09/21/26  | 国債証券 | 0.5000 | 310         | 291         | 24,079    | 2026/09/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 1,160       | 1,208       | 99,940    | 2028/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 1,630       | 1,697       | 140,408   | 2027/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 1,260       | 1,316       | 108,875   | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/32 | 国債証券 | 1.7500 | 900         | 855         | 70,797    | 2032/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31  | 国債証券 | 1.0000 | 1,600       | 1,427       | 118,110   | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/25 | 国債証券 | 0.2500 | 1,450       | 1,370       | 113,335   | 2025/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 国債証券 | 0.2500 | 940         | 908         | 75,142    | 2024/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30  | 国債証券 | 1.0000 | 1,560       | 1,409       | 116,583   | 2030/12/21 |
| 小計                       | —    | —      | 26,270      | 26,417      | 2,185,214 | —          |
| <b>(シンガポール)</b>          |      | %      | 千シンガポール・ドル  | 千シンガポール・ドル  | 千円        |            |
| SINGAPORE 2.0 02/01/24   | 国債証券 | 2.0000 | 280         | 284         | 24,320    | 2024/02/01 |
| SINGAPORE 1.75 02/01/23  | 国債証券 | 1.7500 | 200         | 201         | 17,243    | 2023/02/01 |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27   | 国債証券 | 3.5000 | 730         | 789         | 67,560    | 2027/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46  | 国債証券 | 2.7500 | 420         | 465         | 39,811    | 2046/03/01 |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50 | 国債証券 | 1.8750 | 440         | 412         | 35,308    | 2050/03/01 |

| 銘柄                         | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額    | 期 間        |             | 償 還 年 月 日  |
|----------------------------|------|--------|------------|------------|-------------|------------|
|                            |      |        |            | 評 価 額      |             |            |
|                            |      |        |            | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| <b>(シンガポール)</b>            |      | %      | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円          |            |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42    | 国債証券 | 2.7500 | 380        | 418        | 35,777      | 2042/04/01 |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28   | 国債証券 | 2.6250 | 380        | 396        | 33,923      | 2028/05/01 |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25   | 国債証券 | 2.3750 | 340        | 350        | 29,947      | 2025/06/01 |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26   | 国債証券 | 2.1250 | 420        | 428        | 36,631      | 2026/06/01 |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29   | 国債証券 | 2.8750 | 470        | 500        | 42,793      | 2029/07/01 |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39   | 国債証券 | 2.3750 | 180        | 185        | 15,907      | 2039/07/01 |
| SINGAPORE 2.75 07/01/23    | 国債証券 | 2.7500 | 700        | 715        | 61,239      | 2023/07/01 |
| SINGAPORE 1.625 07/01/31   | 国債証券 | 1.6250 | 200        | 193        | 16,586      | 2031/07/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36    | 国債証券 | 2.2500 | 480        | 486        | 41,584      | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24     | 国債証券 | 3.0000 | 550        | 572        | 48,948      | 2024/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30   | 国債証券 | 2.8750 | 370        | 395        | 33,869      | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33   | 国債証券 | 3.3750 | 280        | 316        | 27,103      | 2033/09/01 |
| SINGAPORE 1.875 10/01/51   | 国債証券 | 1.8750 | 50         | 47         | 4,041       | 2051/10/01 |
| SINGAPORE 0.5 11/01/25     | 国債証券 | 0.5000 | 200        | 192        | 16,482      | 2025/11/01 |
| 小 計                        | -    | -      | 7,070      | 7,353      | 629,080     | -          |
| <b>(イギリス)</b>              |      | %      | 千イギリス・ポンド  | 千イギリス・ポンド  | 千円          |            |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44  | 国債証券 | 3.2500 | 910        | 1,198      | 187,615     | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45   | 国債証券 | 3.5000 | 1,080      | 1,487      | 232,834     | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60   | 国債証券 | 4.0000 | 770        | 1,369      | 214,476     | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49  | 国債証券 | 1.7500 | 510        | 537        | 84,226      | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 国債証券 | 0.8750 | 760        | 657        | 102,874     | 2046/01/31 |
| UK TREASURY 1.125 01/31/39 | 国債証券 | 1.1250 | 390        | 365        | 57,179      | 2039/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/24 | 国債証券 | 0.1250 | 1,800      | 1,760      | 275,652     | 2024/01/31 |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29   | 国債証券 | 0.5000 | 400        | 378        | 59,298      | 2029/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 国債証券 | 0.1250 | 500        | 468        | 73,305      | 2028/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 1,500      | 1,486      | 232,735     | 2023/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 国債証券 | 0.1250 | 800        | 766        | 119,924     | 2026/01/30 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25   | 国債証券 | 5.0000 | 1,310      | 1,455      | 227,867     | 2025/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36  | 国債証券 | 4.2500 | 890        | 1,197      | 187,505     | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 1.0 04/22/24   | 国債証券 | 1.0000 | 1,470      | 1,462      | 229,020     | 2024/04/22 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32  | 国債証券 | 4.2500 | 1,010      | 1,283      | 200,906     | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 国債証券 | 0.6250 | 750        | 735        | 115,172     | 2025/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47   | 国債証券 | 1.5000 | 1,030      | 1,025      | 160,497     | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/31/51  | 国債証券 | 1.2500 | 390        | 367        | 57,480      | 2051/07/31 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52  | 国債証券 | 3.7500 | 870        | 1,352      | 211,735     | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57  | 国債証券 | 1.7500 | 1,210      | 1,322      | 207,050     | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65   | 国債証券 | 2.5000 | 980        | 1,365      | 213,801     | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68   | 国債証券 | 3.5000 | 960        | 1,692      | 264,929     | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26   | 国債証券 | 1.5000 | 800        | 809        | 126,754     | 2026/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27  | 国債証券 | 1.2500 | 700        | 701        | 109,749     | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 0.75 07/22/23  | 国債証券 | 0.7500 | 960        | 954        | 149,441     | 2023/07/22 |
| UK TREASURY 0.875 07/31/33 | 国債証券 | 0.8750 | 450        | 423        | 66,261      | 2033/07/31 |
| UK TREASURY 0.25 07/31/31  | 国債証券 | 0.2500 | 1,600      | 1,440      | 225,486     | 2031/07/31 |
| UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 国債証券 | 0.6250 | 800        | 711        | 111,373     | 2035/07/31 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39  | 国債証券 | 4.2500 | 720        | 1,022      | 160,094     | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23  | 国債証券 | 2.2500 | 980        | 994        | 155,756     | 2023/09/07 |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24  | 国債証券 | 2.7500 | 480        | 497        | 77,913      | 2024/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25   | 国債証券 | 2.0000 | 790        | 810        | 126,909     | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34   | 国債証券 | 4.5000 | 860        | 1,154      | 180,758     | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37  | 国債証券 | 1.7500 | 1,140      | 1,171      | 183,379     | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | 1.6250 | 540        | 564        | 88,306      | 2054/10/22 |

| 銘柄                              | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額      | 評 価 額                 |             | 償 還 年 月 日  |
|---------------------------------|------|--------|--------------|-----------------------|-------------|------------|
|                                 |      |        |              | 外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額 |             |            |
|                                 |      |        |              | 外 貨 建 金 額             | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| <b>(イギリス)</b>                   |      | %      | 千イギリス・ポンド    | 千イギリス・ポンド             | 千円          |            |
| UK TREASURY 0.5 10/22/61        | 国債証券 | 0.5000 | 970          | 724                   | 113,407     | 2061/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71      | 国債証券 | 1.6250 | 500          | 571                   | 89,527      | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41       | 国債証券 | 1.2500 | 1,040        | 985                   | 154,333     | 2041/10/22 |
| UK TREASURY 0.625 10/22/50      | 国債証券 | 0.6250 | 360          | 289                   | 45,252      | 2050/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28      | 国債証券 | 1.6250 | 930          | 953                   | 149,261     | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29      | 国債証券 | 0.8750 | 910          | 883                   | 138,310     | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/30      | 国債証券 | 0.3750 | 600          | 553                   | 86,710      | 2030/10/22 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/26      | 国債証券 | 0.3750 | 1,130        | 1,083                 | 169,622     | 2026/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28        | 国債証券 | 6.0000 | 560          | 732                   | 114,725     | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38       | 国債証券 | 4.7500 | 880          | 1,302                 | 203,854     | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42        | 国債証券 | 4.5000 | 980          | 1,496                 | 234,327     | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46       | 国債証券 | 4.2500 | 1,000        | 1,557                 | 243,803     | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55       | 国債証券 | 4.2500 | 1,020        | 1,784                 | 279,345     | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27       | 国債証券 | 4.2500 | 780          | 910                   | 142,526     | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40       | 国債証券 | 4.2500 | 860          | 1,240                 | 194,254     | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30       | 国債証券 | 4.7500 | 870          | 1,118                 | 175,105     | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49       | 国債証券 | 4.2500 | 850          | 1,379                 | 215,906     | 2049/12/07 |
| 小計                              | —    | —      | 45,350       | 52,558                | 8,228,549   | —          |
| <b>(イスラエル)</b>                  |      | %      | 千イスラエル・シケル   | 千イスラエル・シケル            | 千円          |            |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42  | 国債証券 | 5.5000 | 1,300        | 1,939                 | 69,626      | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券 | 3.7500 | 1,390        | 1,668                 | 59,882      | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27  | 国債証券 | 2.0000 | 2,610        | 2,729                 | 97,979      | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24 | 国債証券 | 3.7500 | 2,100        | 2,237                 | 80,332      | 2024/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30  | 国債証券 | 1.0000 | 1,350        | 1,299                 | 46,637      | 2030/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23 | 国債証券 | 4.2500 | 2,320        | 2,422                 | 86,951      | 2023/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37  | 国債証券 | 1.5000 | 1,000        | 906                   | 32,543      | 2037/05/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券 | 1.7500 | 2,030        | 2,091                 | 75,096      | 2025/08/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,160        | 1,231                 | 44,214      | 2028/09/28 |
| 小計                              | —    | —      | 15,260       | 16,525                | 593,263     | —          |
| <b>(デンマーク)</b>                  |      | %      | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ           | 千円          |            |
| DENMARK 0.25 11/15/52           | 国債証券 | 0.2500 | 2,020        | 1,812                 | 31,777      | 2052/11/15 |
| DENMARK 4.5 11/15/39            | 国債証券 | 4.5000 | 7,580        | 12,594                | 220,783     | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25           | 国債証券 | 1.7500 | 5,320        | 5,663                 | 99,274      | 2025/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27            | 国債証券 | 0.5000 | 7,130        | 7,244                 | 126,993     | 2027/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/29            | 国債証券 | 0.5000 | 4,370        | 4,426                 | 77,595      | 2029/11/15 |
| DENMARK 0.0 11/15/31            | 国債証券 | 0.0000 | 3,300        | 3,144                 | 55,131      | 2031/11/15 |
| 小計                              | —    | —      | 29,720       | 34,886                | 611,555     | —          |
| <b>(ノルウェー)</b>                  |      | %      | 千ノルウェー・クローネ  | 千ノルウェー・クローネ           | 千円          |            |
| NORWAY 1.5 02/19/26             | 国債証券 | 1.5000 | 3,770        | 3,706                 | 47,558      | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27            | 国債証券 | 1.7500 | 1,900        | 1,878                 | 24,102      | 2027/02/17 |
| NORWAY 3.0 03/14/24             | 国債証券 | 3.0000 | 5,800        | 5,950                 | 76,342      | 2024/03/14 |
| NORWAY 1.75 03/13/25            | 国債証券 | 1.7500 | 3,800        | 3,784                 | 48,551      | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28             | 国債証券 | 2.0000 | 2,070        | 2,064                 | 26,486      | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.0 05/24/23             | 国債証券 | 2.0000 | 1,800        | 1,814                 | 23,276      | 2023/05/24 |
| NORWAY 1.375 08/19/30           | 国債証券 | 1.3750 | 3,730        | 3,529                 | 45,283      | 2030/08/19 |
| NORWAY 1.75 09/06/29            | 国債証券 | 1.7500 | 2,750        | 2,691                 | 34,538      | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31            | 国債証券 | 1.2500 | 1,100        | 1,020                 | 13,095      | 2031/09/17 |
| 小計                              | —    | —      | 26,720       | 26,440                | 339,233     | —          |
| <b>(スウェーデン)</b>                 |      | %      | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ          | 千円          |            |
| SWEDEN 3.5 03/30/39             | 国債証券 | 3.5000 | 3,270        | 4,718                 | 57,750      | 2039/03/30 |
| SWEDEN 0.75 05/12/28            | 国債証券 | 0.7500 | 1,840        | 1,865                 | 22,828      | 2028/05/12 |



| 銘柄                                  | 柄    | 当期      |         |              |              |            | 償還年月日 |
|-------------------------------------|------|---------|---------|--------------|--------------|------------|-------|
|                                     |      | 種類      | 利率      | 額面金額         | 評価額          |            |       |
|                                     |      |         |         |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額     |       |
| <b>(スウェーデン)</b>                     |      |         | %       | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円         |       |
| SWEDEN 2.5 05/12/25                 | 国債証券 | 2.5000  | 7,980   | 8,544        | 104,583      | 2025/05/12 |       |
| SWEDEN 0.125 05/12/31               | 国債証券 | 0.1250  | 2,150   | 2,061        | 25,236       | 2031/05/12 |       |
| SWEDEN 2.25 06/01/32                | 国債証券 | 2.2500  | 2,700   | 3,147        | 38,531       | 2032/06/01 |       |
| SWEDEN 1.5 11/13/23                 | 国債証券 | 1.5000  | 4,700   | 4,821        | 59,017       | 2023/11/13 |       |
| SWEDEN 1.0 11/12/26                 | 国債証券 | 1.0000  | 3,250   | 3,330        | 40,769       | 2026/11/12 |       |
| SWEDEN 0.75 11/12/29                | 国債証券 | 0.7500  | 3,170   | 3,213        | 39,335       | 2029/11/12 |       |
| 小計                                  | —    | —       | 29,060  | 31,703       | 388,054      | —          |       |
| <b>(メキシコ)</b>                       |      |         | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     | 千円         |       |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26         | 国債証券 | 5.7500  | 22,143  | 20,617       | 117,071      | 2026/03/05 |       |
| MEXICAN BONDS 03/09/23              | 国債証券 | 6.7500  | 8,000   | 7,945        | 45,118       | 2023/03/09 |       |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29          | 国債証券 | 8.5000  | 17,109  | 17,831       | 101,253      | 2029/05/31 |       |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31         | 国債証券 | 7.7500  | 17,000  | 16,945       | 96,218       | 2031/05/29 |       |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27          | 国債証券 | 7.5000  | 18,071  | 17,883       | 101,546      | 2027/06/03 |       |
| MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24          | 国債証券 | 8.0000  | 18,000  | 18,103       | 102,793      | 2024/09/05 |       |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42         | 国債証券 | 7.7500  | 11,643  | 11,266       | 63,973       | 2042/11/13 |       |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47          | 国債証券 | 8.0000  | 12,654  | 12,543       | 71,223       | 2047/11/07 |       |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38          | 国債証券 | 8.5000  | 13,125  | 13,738       | 78,010       | 2038/11/18 |       |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36         | 国債証券 | 10.0000 | 5,085   | 6,015        | 34,156       | 2036/11/20 |       |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34         | 国債証券 | 7.7500  | 6,000   | 5,948        | 33,775       | 2034/11/23 |       |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24         | 国債証券 | 10.0000 | 19,796  | 20,900       | 118,678      | 2024/12/05 |       |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23          | 国債証券 | 8.0000  | 14,000  | 14,059       | 79,832       | 2023/12/07 |       |
| 小計                                  | —    | —       | 182,626 | 183,799      | 1,043,651    | —          |       |
| <b>(中国)</b>                         |      |         | %       | 千オフショア・人民元   | 千オフショア・人民元   | 千円         |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 | 国債証券 | 3.7200  | 1,100   | 1,166        | 21,228       | 2051/04/12 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 | 国債証券 | 2.6800  | 6,000   | 5,914        | 107,628      | 2030/05/21 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 | 国債証券 | 2.6900  | 17,000  | 17,130       | 311,720      | 2026/08/12 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24 | 国債証券 | 2.4700  | 5,000   | 5,024        | 91,437       | 2024/09/02 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 | 国債証券 | 3.5300  | 4,950   | 5,121        | 93,188       | 2051/10/18 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 | 国債証券 | 2.9100  | 14,500  | 14,631       | 266,248      | 2028/10/14 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23 | 国債証券 | 2.5600  | 15,000  | 15,083       | 274,470      | 2023/10/21 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 | 国債証券 | 2.8900  | 3,000   | 3,023        | 55,026       | 2031/11/18 |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 | 国債証券 | 3.2800  | 3,000   | 3,104        | 56,500       | 2027/12/03 |       |
| 小計                                  | —    | —       | 69,550  | 70,200       | 1,277,451    | —          |       |
| <b>(マレーシア)</b>                      |      |         | %       | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円         |       |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27             | 国債証券 | 3.8920  | 800     | 817          | 22,469       | 2027/03/15 |       |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23              | 国債証券 | 3.4800  | 1,220   | 1,239        | 34,042       | 2023/03/15 |       |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26             | 国債証券 | 4.3920  | 3,070   | 3,208        | 88,140       | 2026/04/15 |       |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30             | 国債証券 | 4.4980  | 1,800   | 1,898        | 52,164       | 2030/04/15 |       |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33             | 国債証券 | 3.8440  | 1,210   | 1,204        | 33,102       | 2033/04/15 |       |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37             | 国債証券 | 4.7620  | 1,400   | 1,518        | 41,716       | 2037/04/07 |       |
| MALAYSIA 2.632 04/15/31             | 国債証券 | 2.6320  | 1,000   | 917          | 25,192       | 2031/04/15 |       |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28             | 国債証券 | 3.7330  | 2,000   | 2,015        | 55,366       | 2028/06/15 |       |
| MALAYSIA 3.478 06/14/24             | 国債証券 | 3.4780  | 1,000   | 1,016        | 27,921       | 2024/06/14 |       |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24             | 国債証券 | 4.1810  | 2,430   | 2,505        | 68,829       | 2024/07/15 |       |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48             | 国債証券 | 4.9210  | 2,700   | 2,849        | 78,268       | 2048/07/06 |       |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34             | 国債証券 | 3.8280  | 1,700   | 1,666        | 45,788       | 2034/07/05 |       |
| MALAYSIA 3.955 09/15/25             | 国債証券 | 3.9550  | 2,700   | 2,785        | 76,521       | 2025/09/15 |       |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43             | 国債証券 | 4.9350  | 2,000   | 2,153        | 59,172       | 2043/09/30 |       |
| MALAYSIA 3.9 11/30/26               | 国債証券 | 3.9000  | 500     | 513          | 14,096       | 2026/11/30 |       |
| MALAYSIA 3.899 11/16/27             | 国債証券 | 3.8990  | 800     | 819          | 22,508       | 2027/11/16 |       |
| MALAYSIA 4.642 11/07/33             | 国債証券 | 4.6420  | 500     | 532          | 14,619       | 2033/11/07 |       |
| 小計                                  | —    | —       | 26,830  | 27,661       | 759,920      | —          |       |

| 銘柄                        | 当    |        |            | 期          |           |            | 末 |
|---------------------------|------|--------|------------|------------|-----------|------------|---|
|                           | 種類   | 利率     | 額面金額       | 評価額        |           | 償還年月日      |   |
|                           |      |        |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |   |
| <b>(ポーランド)</b>            |      | %      | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |            |   |
| POLAND 5.75 04/25/29      | 国債証券 | 5.7500 | 1,440      | 1,613      | 46,426    | 2029/04/25 |   |
| POLAND 2.75 04/25/28      | 国債証券 | 2.7500 | 2,910      | 2,738      | 78,807    | 2028/04/25 |   |
| POLAND 2.5 04/25/24       | 国債証券 | 2.5000 | 2,290      | 2,240      | 64,471    | 2024/04/25 |   |
| POLAND 0.75 04/25/25      | 国債証券 | 0.7500 | 2,680      | 2,451      | 70,538    | 2025/04/25 |   |
| POLAND 2.5 07/25/26       | 国債証券 | 2.5000 | 2,180      | 2,068      | 59,511    | 2026/07/25 |   |
| POLAND 3.25 07/25/25      | 国債証券 | 3.2500 | 2,380      | 2,343      | 67,436    | 2025/07/25 |   |
| POLAND 2.5 07/25/27       | 国債証券 | 2.5000 | 2,250      | 2,097      | 60,362    | 2027/07/25 |   |
| POLAND 4.0 10/25/23       | 国債証券 | 4.0000 | 2,740      | 2,760      | 79,430    | 2023/10/25 |   |
| POLAND 2.75 10/25/29      | 国債証券 | 2.7500 | 210        | 194        | 5,590     | 2029/10/25 |   |
| POLAND 2.25 10/25/24      | 国債証券 | 2.2500 | 1,000      | 967        | 27,838    | 2024/10/25 |   |
| POLAND 1.25 10/25/30      | 国債証券 | 1.2500 | 2,900      | 2,362      | 67,981    | 2030/10/25 |   |
| POLAND 0.25 10/25/26      | 国債証券 | 0.2500 | 1,400      | 1,190      | 34,246    | 2026/10/25 |   |
| 小計                        | —    | —      | 24,380     | 23,028     | 662,640   | —          |   |
| <b>(ユーロ…アイルランド)</b>       |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |   |
| IRISH 2.0 02/18/45        | 国債証券 | 2.0000 | 600        | 715        | 93,311    | 2045/02/18 |   |
| IRISH 1.35 03/18/31       | 国債証券 | 1.3500 | 270        | 289        | 37,710    | 2031/03/18 |   |
| IRISH 3.4 03/18/24        | 国債証券 | 3.4000 | 320        | 344        | 44,947    | 2024/03/18 |   |
| IRISH 5.4 03/13/25        | 国債証券 | 5.4000 | 710        | 831        | 108,340   | 2025/03/13 |   |
| IRISH 3.9 03/20/23        | 国債証券 | 3.9000 | 570        | 596        | 77,813    | 2023/03/20 |   |
| IRISH 0.55 04/22/41       | 国債証券 | 0.5500 | 220        | 201        | 26,216    | 2041/04/22 |   |
| IRISH 1.5 05/15/50        | 国債証券 | 1.5000 | 420        | 448        | 58,429    | 2050/05/15 |   |
| IRISH 1.3 05/15/33        | 国債証券 | 1.3000 | 340        | 358        | 46,691    | 2033/05/15 |   |
| IRISH 2.4 05/15/30        | 国債証券 | 2.4000 | 630        | 729        | 95,067    | 2030/05/15 |   |
| IRISH 0.9 05/15/28        | 国債証券 | 0.9000 | 390        | 405        | 52,905    | 2028/05/15 |   |
| IRISH 1.1 05/15/29        | 国債証券 | 1.1000 | 520        | 544        | 71,027    | 2029/05/15 |   |
| IRISH 1.0 05/15/26        | 国債証券 | 1.0000 | 640        | 666        | 86,860    | 2026/05/15 |   |
| IRISH 1.7 05/15/37        | 国債証券 | 1.7000 | 390        | 431        | 56,310    | 2037/05/15 |   |
| IRISH 0.4 05/15/35        | 国債証券 | 0.4000 | 350        | 327        | 42,749    | 2035/05/15 |   |
| IRISH 0.2 05/15/27        | 国債証券 | 0.2000 | 560        | 560        | 73,123    | 2027/05/15 |   |
| IRISH 0.0 10/18/31        | 国債証券 | 0.0000 | 660        | 616        | 80,393    | 2031/10/18 |   |
| IRISH 0.2 10/18/30        | 国債証券 | 0.2000 | 450        | 436        | 56,912    | 2030/10/18 |   |
| 小計                        | —    | —      | 8,040      | 8,505      | 1,108,814 | —          |   |
| <b>(ユーロ…オランダ)</b>         |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |   |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,130      | 1,820      | 237,294   | 2042/01/15 |   |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 1,140      | 1,731      | 225,699   | 2047/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/52  | 国債証券 | 0.0000 | 610        | 507        | 66,184    | 2052/01/15 |   |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28  | 国債証券 | 5.5000 | 850        | 1,107      | 144,358   | 2028/01/15 |   |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37  | 国債証券 | 4.0000 | 1,060      | 1,590      | 207,300   | 2037/01/15 |   |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33  | 国債証券 | 2.5000 | 980        | 1,197      | 156,063   | 2033/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/38  | 国債証券 | 0.0000 | 400        | 366        | 47,727    | 2038/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40  | 国債証券 | 0.5000 | 630        | 628        | 81,879    | 2040/01/15 |   |
| NETHERLANDS 01/15/24      | 国債証券 | 0.0000 | 1,310      | 1,321      | 172,313   | 2024/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/29  | 国債証券 | 0.0000 | 270        | 265        | 34,662    | 2029/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/27  | 国債証券 | 0.0000 | 920        | 918        | 119,747   | 2027/01/15 |   |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 450        | 464        | 60,613    | 2023/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26  | 国債証券 | 0.5000 | 1,130      | 1,155      | 150,680   | 2026/07/15 |   |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24  | 国債証券 | 2.0000 | 1,130      | 1,194      | 155,728   | 2024/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 1,280      | 1,298      | 169,317   | 2025/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 980        | 1,019      | 132,861   | 2028/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 1,000      | 1,038      | 135,341   | 2027/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 790        | 792        | 103,283   | 2029/07/15 |   |

| 銘柄                       | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額 | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|--------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|                          |      |        |         | 評 価 額     |             |            |
|                          |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (ユーロ…オランダ)               |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 750     | 732       | 95,503      | 2030/07/15 |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 540     | 522       | 68,087      | 2031/07/15 |
| 小 計                      | —    | —      | 17,350  | 19,673    | 2,564,646   | —          |
| (ユーロ…ベルギー)               |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| BELGIUM 5.5 03/28/28     | 国債証券 | 5.5000 | 1,190   | 1,579     | 205,883     | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41    | 国債証券 | 4.2500 | 1,110   | 1,726     | 225,101     | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26     | 国債証券 | 4.5000 | 430     | 511       | 66,618      | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32     | 国債証券 | 4.0000 | 730     | 975       | 127,215     | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35     | 国債証券 | 5.0000 | 890     | 1,356     | 176,852     | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33    | 国債証券 | 1.2500 | 710     | 757       | 98,749      | 2033/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45    | 国債証券 | 3.7500 | 520     | 802       | 104,603     | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47     | 国債証券 | 1.6000 | 670     | 730       | 95,183      | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50     | 国債証券 | 1.7000 | 670     | 742       | 96,847      | 2050/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57    | 国債証券 | 2.2500 | 350     | 442       | 57,642      | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66    | 国債証券 | 2.1500 | 420     | 528       | 68,887      | 2066/06/22 |
| BELGIUM 0.65 06/22/71    | 国債証券 | 0.6500 | 330     | 239       | 31,190      | 2071/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26     | 国債証券 | 1.0000 | 1,110   | 1,156     | 150,786     | 2026/06/22 |
| BELGIUM 2.6 06/22/24     | 国債証券 | 2.6000 | 1,020   | 1,089     | 142,056     | 2024/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31     | 国債証券 | 1.0000 | 930     | 967       | 126,153     | 2031/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/23    | 国債証券 | 2.2500 | 830     | 860       | 112,180     | 2023/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28     | 国債証券 | 0.8000 | 670     | 692       | 90,232      | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.4 06/22/40     | 国債証券 | 0.4000 | 430     | 384       | 50,166      | 2040/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29     | 国債証券 | 0.9000 | 1,050   | 1,091     | 142,303     | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34     | 国債証券 | 3.0000 | 590     | 745       | 97,225      | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38     | 国債証券 | 1.9000 | 520     | 597       | 77,842      | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25     | 国債証券 | 0.8000 | 1,140   | 1,175     | 153,216     | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27     | 国債証券 | 0.8000 | 840     | 869       | 113,351     | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37    | 国債証券 | 1.4500 | 440     | 473       | 61,703      | 2037/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30     | 国債証券 | 0.1000 | 800     | 774       | 101,002     | 2030/06/22 |
| BELGIUM 0.5 10/22/24     | 国債証券 | 0.5000 | 670     | 684       | 89,179      | 2024/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/31     | 国債証券 | 0.0000 | 770     | 724       | 94,451      | 2031/10/22 |
| BELGIUM 0.2 10/22/23     | 国債証券 | 0.2000 | 660     | 667       | 86,984      | 2023/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/27     | 国債証券 | 0.0000 | 510     | 504       | 65,775      | 2027/10/22 |
| 小 計                      | —    | —      | 21,000  | 23,852    | 3,109,389   | —          |
| (ユーロ…フランス)               |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/23  | 国債証券 | 0.0000 | 900     | 905       | 118,033     | 2023/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27  | 国債証券 | 0.0000 | 900     | 893       | 116,427     | 2027/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26  | 国債証券 | 0.0000 | 2,460   | 2,459     | 320,568     | 2026/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/24  | 国債証券 | 0.0000 | 1,150   | 1,158     | 151,067     | 2024/02/25 |
| FRANCE OAT 03/25/24      | 国債証券 | 0.0000 | 2,520   | 2,538     | 330,929     | 2024/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/25      | 国債証券 | 0.0000 | 2,970   | 2,982     | 388,857     | 2025/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/23      | 国債証券 | 0.0000 | 2,200   | 2,214     | 288,740     | 2023/03/25 |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,030   | 1,139     | 148,583     | 2023/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26  | 国債証券 | 3.5000 | 2,520   | 2,885     | 376,190     | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41  | 国債証券 | 4.5000 | 2,250   | 3,645     | 475,175     | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55  | 国債証券 | 4.0000 | 1,260   | 2,208     | 287,887     | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60  | 国債証券 | 4.0000 | 730     | 1,332     | 173,752     | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29  | 国債証券 | 5.5000 | 2,540   | 3,473     | 452,785     | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 1,550   | 2,325     | 303,111     | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 1,600   | 2,317     | 302,054     | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48  | 国債証券 | 2.0000 | 1,690   | 2,027     | 264,241     | 2048/05/25 |

| 銘柄                         | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額       | 期 間           |               | 償 還 年 月 日  |
|----------------------------|------|--------|---------------|---------------|---------------|------------|
|                            |      |        |               | 評 価 額         |               |            |
|                            |      |        |               | 外 貨 建 金 額     | 邦 貨 換 算 金 額   |            |
| <b>(ユーロ…フランス)</b>          |      |        |               |               |               |            |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50    | 国債証券 | 1.5000 | 千ユーロ<br>2,000 | 千ユーロ<br>2,153 | 千円<br>280,743 | 2050/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52   | 国債証券 | 0.7500 | 1,890         | 1,661         | 216,658       | 2052/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53   | 国債証券 | 0.7500 | 650           | 564           | 73,560        | 2053/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66   | 国債証券 | 1.7500 | 820           | 934           | 121,829       | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72    | 国債証券 | 0.5000 | 600           | 409           | 53,334        | 2072/05/25 |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24   | 国債証券 | 2.2500 | 1,980         | 2,095         | 273,231       | 2024/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30    | 国債証券 | 2.5000 | 3,240         | 3,783         | 493,197       | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28   | 国債証券 | 0.7500 | 3,270         | 3,369         | 439,218       | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31    | 国債証券 | 1.5000 | 3,090         | 3,351         | 436,918       | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25    | 国債証券 | 0.5000 | 2,490         | 2,541         | 331,291       | 2025/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29    | 国債証券 | 0.5000 | 2,220         | 2,240         | 292,119       | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34   | 国債証券 | 1.2500 | 2,540         | 2,676         | 348,849       | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26    | 国債証券 | 0.5000 | 2,770         | 2,823         | 368,124       | 2026/05/25 |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27    | 国債証券 | 1.0000 | 2,460         | 2,568         | 334,893       | 2027/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40    | 国債証券 | 0.5000 | 1,270         | 1,168         | 152,287       | 2040/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23   | 国債証券 | 1.7500 | 2,530         | 2,604         | 339,501       | 2023/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36   | 国債証券 | 1.2500 | 2,590         | 2,716         | 354,108       | 2036/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39   | 国債証券 | 1.7500 | 1,690         | 1,931         | 251,834       | 2039/06/25 |
| FRANCE OAT 0.5 06/25/44    | 国債証券 | 0.5000 | 740           | 658           | 85,778        | 2044/06/25 |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23   | 国債証券 | 4.2500 | 3,130         | 3,379         | 440,558       | 2023/10/25 |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25    | 国債証券 | 6.0000 | 1,800         | 2,207         | 287,769       | 2025/10/25 |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27   | 国債証券 | 2.7500 | 2,840         | 3,255         | 424,434       | 2027/10/25 |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38    | 国債証券 | 4.0000 | 1,630         | 2,424         | 315,993       | 2038/10/25 |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32   | 国債証券 | 5.7500 | 2,100         | 3,213         | 418,890       | 2032/10/25 |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24   | 国債証券 | 1.7500 | 2,380         | 2,511         | 327,439       | 2024/11/25 |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25    | 国債証券 | 1.0000 | 2,220         | 2,306         | 300,662       | 2025/11/25 |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26   | 国債証券 | 0.2500 | 2,150         | 2,164         | 282,208       | 2026/11/25 |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28   | 国債証券 | 0.7500 | 2,420         | 2,490         | 324,648       | 2028/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31    | 国債証券 | 0.0000 | 2,330         | 2,190         | 285,531       | 2031/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30    | 国債証券 | 0.0000 | 2,800         | 2,670         | 348,092       | 2030/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29    | 国債証券 | 0.0000 | 2,550         | 2,465         | 321,428       | 2029/11/25 |
| 小 計                        | —    | —      | 95,460        | 106,041       | 13,823,543    | —          |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>           |      |        |               |               |               |            |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24  | 国債証券 | 6.2500 | 千ユーロ<br>840   | 千ユーロ<br>948   | 千円<br>123,666 | 2024/01/04 |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 1,160         | 1,551         | 202,289       | 2028/01/04 |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30  | 国債証券 | 6.2500 | 710           | 1,060         | 138,228       | 2030/01/04 |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31   | 国債証券 | 5.5000 | 1,240         | 1,840         | 239,989       | 2031/01/04 |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37   | 国債証券 | 4.0000 | 1,640         | 2,539         | 331,104       | 2037/01/04 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25   | 国債証券 | 0.5000 | 1,660         | 1,702         | 221,937       | 2025/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26   | 国債証券 | 0.5000 | 1,810         | 1,860         | 242,473       | 2026/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29  | 国債証券 | 0.2500 | 1,390         | 1,413         | 184,200       | 2029/02/15 |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23   | 国債証券 | 1.5000 | 920           | 939           | 122,528       | 2023/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28   | 国債証券 | 0.5000 | 1,640         | 1,691         | 220,524       | 2028/02/15 |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24  | 国債証券 | 1.7500 | 1,750         | 1,830         | 238,578       | 2024/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27  | 国債証券 | 0.2500 | 1,960         | 1,994         | 260,015       | 2027/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31   | 国債証券 | 0.0000 | 1,660         | 1,640         | 213,861       | 2031/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30   | 国債証券 | 0.0000 | 1,690         | 1,680         | 219,101       | 2030/02/15 |
| BUNDESUBL 04/14/23         | 国債証券 | 0.0000 | 1,030         | 1,037         | 135,296       | 2023/04/14 |
| BUNDESUBL 04/05/24         | 国債証券 | 0.0000 | 1,540         | 1,555         | 202,804       | 2024/04/05 |
| BUNDESUBL 0.0 04/11/25     | 国債証券 | 0.0000 | 1,250         | 1,261         | 164,486       | 2025/04/11 |
| BUNDESUBL 0.0 04/10/26     | 国債証券 | 0.0000 | 1,430         | 1,440         | 187,818       | 2026/04/10 |

| 銘柄                        | 当    |        |        | 期      |            |            | 末 |
|---------------------------|------|--------|--------|--------|------------|------------|---|
|                           | 種類   | 利率     | 額面金額   | 評価額    |            | 償還年月日      |   |
|                           |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |            |   |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>          |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |   |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24  | 国債証券 | 1.5000 | 1,950  | 2,035  | 265,395    | 2024/05/15 |   |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23  | 国債証券 | 1.5000 | 1,650  | 1,693  | 220,794    | 2023/05/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35  | 国債証券 | 0.0000 | 1,200  | 1,150  | 149,983    | 2035/05/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36  | 国債証券 | 0.0000 | 1,350  | 1,282  | 167,216    | 2036/05/15 |   |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27  | 国債証券 | 6.5000 | 710    | 962    | 125,497    | 2027/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,100  | 1,438  | 187,564    | 2028/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 940    | 1,571  | 204,821    | 2039/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 890    | 1,406  | 183,381    | 2042/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44  | 国債証券 | 2.5000 | 1,760  | 2,588  | 337,393    | 2044/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 1,140  | 2,048  | 267,093    | 2040/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 1,660  | 2,590  | 337,716    | 2034/07/04 |   |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46  | 国債証券 | 2.5000 | 1,890  | 2,844  | 370,749    | 2046/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52  | 国債証券 | 0.0000 | 340    | 293    | 38,310     | 2052/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 1,820  | 2,202  | 287,112    | 2048/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25  | 国債証券 | 1.0000 | 1,470  | 1,534  | 200,020    | 2025/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27  | 国債証券 | 0.5000 | 2,000  | 2,061  | 268,687    | 2027/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 08/15/26      | 国債証券 | 0.0000 | 1,680  | 1,691  | 220,559    | 2026/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,810  | 1,840  | 239,894    | 2028/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23  | 国債証券 | 2.0000 | 2,930  | 3,045  | 397,055    | 2023/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24  | 国債証券 | 1.0000 | 1,340  | 1,387  | 180,840    | 2024/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 08/15/29      | 国債証券 | 0.0000 | 1,610  | 1,605  | 209,236    | 2029/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国債証券 | 0.0000 | 1,720  | 1,515  | 197,499    | 2050/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国債証券 | 0.0000 | 700    | 688    | 89,817     | 2031/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国債証券 | 0.0000 | 400    | 354    | 46,263     | 2050/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国債証券 | 0.0000 | 2,000  | 1,983  | 258,522    | 2030/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国債証券 | 0.0000 | 500    | 497    | 64,872     | 2030/08/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国債証券 | 0.0000 | 450    | 444    | 57,879     | 2031/08/15 |   |
| BUNDESUBL 10/18/24        | 国債証券 | 0.0000 | 1,130  | 1,141  | 148,776    | 2024/10/18 |   |
| BUNDESUBL 10/13/23        | 国債証券 | 0.0000 | 1,280  | 1,292  | 168,527    | 2023/10/13 |   |
| BUNDESUBL 0.0 10/09/26    | 国債証券 | 0.0000 | 1,050  | 1,056  | 137,737    | 2026/10/09 |   |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25    | 国債証券 | 0.0000 | 1,400  | 1,412  | 184,079    | 2025/10/10 |   |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25    | 国債証券 | 0.0000 | 670    | 677    | 88,267     | 2025/10/10 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27  | 国債証券 | 0.0000 | 1,200  | 1,202  | 156,812    | 2027/11/15 |   |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28  | 国債証券 | 0.0000 | 500    | 499    | 65,155     | 2028/11/15 |   |
| 小計                        | -    | -      | 69,560 | 78,033 | 10,172,441 | -          |   |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>         |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |   |
| SPAIN 6.0 01/31/29        | 国債証券 | 6.0000 | 1,580  | 2,146  | 279,779    | 2029/01/31 |   |
| SPAIN 4.8 01/31/24        | 国債証券 | 4.8000 | 1,130  | 1,239  | 161,636    | 2024/01/31 |   |
| SPAIN 4.2 01/31/37        | 国債証券 | 4.2000 | 1,100  | 1,516  | 197,750    | 2037/01/31 |   |
| SPAIN 5.4 01/31/23        | 国債証券 | 5.4000 | 1,160  | 1,224  | 159,683    | 2023/01/31 |   |
| SPAIN 0.0 01/31/25        | 国債証券 | 0.0000 | 1,400  | 1,397  | 182,120    | 2025/01/31 |   |
| SPAIN 0.0 01/31/27        | 国債証券 | 0.0000 | 350    | 340    | 44,369     | 2027/01/31 |   |
| SPAIN 0.0 01/31/28        | 国債証券 | 0.0000 | 1,160  | 1,113  | 145,100    | 2028/01/31 |   |
| SPAIN 0.0 01/31/26        | 国債証券 | 0.0000 | 800    | 789    | 102,872    | 2026/01/31 |   |
| SPAIN 1.6 04/30/25        | 国債証券 | 1.6000 | 1,450  | 1,519  | 198,019    | 2025/04/30 |   |
| SPAIN 3.8 04/30/24        | 国債証券 | 3.8000 | 1,190  | 1,293  | 168,562    | 2024/04/30 |   |
| SPAIN 1.5 04/30/27        | 国債証券 | 1.5000 | 1,240  | 1,300  | 169,567    | 2027/04/30 |   |
| SPAIN 1.95 04/30/26       | 国債証券 | 1.9500 | 1,270  | 1,353  | 176,490    | 2026/04/30 |   |
| SPAIN 1.4 04/30/28        | 国債証券 | 1.4000 | 1,440  | 1,504  | 196,136    | 2028/04/30 |   |
| SPAIN 1.45 04/30/29       | 国債証券 | 1.4500 | 1,170  | 1,223  | 159,528    | 2029/04/30 |   |
| SPAIN 0.7 04/30/32        | 国債証券 | 0.7000 | 610    | 580    | 75,615     | 2032/04/30 |   |

| 銘柄                       | 当    |        |        | 期      |           | 末          |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
|                          | 種類   | 利率     | 額面金額   | 評価額    |           | 償還年月日      |
|                          |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| SPAIN 0.5 04/30/30       | 国債証券 | 0.5000 | 1,850  | 1,793  | 233,770   | 2030/04/30 |
| SPAIN 0.1 04/30/31       | 国債証券 | 0.1000 | 1,190  | 1,087  | 141,787   | 2031/04/30 |
| SPAIN 0.0 04/30/23       | 国債証券 | 0.0000 | 990    | 995    | 129,797   | 2023/04/30 |
| SPAIN 0.0 05/31/24       | 国債証券 | 0.0000 | 860    | 860    | 112,236   | 2024/05/31 |
| SPAIN 5.9 07/30/26       | 国債証券 | 5.9000 | 1,370  | 1,703  | 222,091   | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40       | 国債証券 | 4.9000 | 970    | 1,494  | 194,794   | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41       | 国債証券 | 4.7000 | 1,250  | 1,907  | 248,683   | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66      | 国債証券 | 3.4500 | 920    | 1,238  | 161,501   | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25      | 国債証券 | 4.6500 | 1,370  | 1,577  | 205,608   | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30      | 国債証券 | 1.9500 | 1,460  | 1,580  | 206,074   | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32      | 国債証券 | 5.7500 | 1,220  | 1,776  | 231,601   | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33      | 国債証券 | 2.3500 | 1,240  | 1,383  | 180,316   | 2033/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28       | 国債証券 | 1.4000 | 1,310  | 1,367  | 178,225   | 2028/07/30 |
| SPAIN 1.85 07/30/35      | 国債証券 | 1.8500 | 1,200  | 1,268  | 165,354   | 2035/07/30 |
| SPAIN 0.25 07/30/24      | 国債証券 | 0.2500 | 1,240  | 1,249  | 162,917   | 2024/07/30 |
| SPAIN 0.35 07/30/23      | 国債証券 | 0.3500 | 1,420  | 1,434  | 187,009   | 2023/07/30 |
| SPAIN 0.85 07/30/37      | 国債証券 | 0.8500 | 600    | 544    | 70,953    | 2037/07/30 |
| SPAIN 1.0 07/30/42       | 国債証券 | 1.0000 | 130    | 115    | 15,067    | 2042/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/27       | 国債証券 | 0.8000 | 1,200  | 1,211  | 157,965   | 2027/07/30 |
| SPAIN 2.75 10/31/24      | 国債証券 | 2.7500 | 1,540  | 1,655  | 215,832   | 2024/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/28      | 国債証券 | 5.1500 | 1,030  | 1,326  | 172,940   | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44      | 国債証券 | 5.1500 | 910    | 1,514  | 197,484   | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46       | 国債証券 | 2.9000 | 1,060  | 1,310  | 170,797   | 2046/10/31 |
| SPAIN 2.7 10/31/48       | 国債証券 | 2.7000 | 930    | 1,112  | 145,026   | 2048/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/71      | 国債証券 | 1.4500 | 300    | 227    | 29,687    | 2071/10/31 |
| SPAIN 1.0 10/31/50       | 国債証券 | 1.0000 | 1,170  | 950    | 123,969   | 2050/10/31 |
| SPAIN 2.15 10/31/25      | 国債証券 | 2.1500 | 1,380  | 1,475  | 192,408   | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27      | 国債証券 | 1.4500 | 1,500  | 1,570  | 204,667   | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 10/31/26       | 国債証券 | 1.3000 | 1,460  | 1,520  | 198,168   | 2026/10/31 |
| SPAIN 0.6 10/31/29       | 国債証券 | 0.6000 | 1,180  | 1,159  | 151,089   | 2029/10/31 |
| SPAIN 4.4 10/31/23       | 国債証券 | 4.4000 | 1,110  | 1,198  | 156,228   | 2023/10/31 |
| SPAIN 0.5 10/31/31       | 国債証券 | 0.5000 | 1,100  | 1,036  | 135,128   | 2031/10/31 |
| SPAIN 1.2 10/31/40       | 国債証券 | 1.2000 | 1,080  | 1,005  | 131,124   | 2040/10/31 |
| SPAIN 1.25 10/31/30      | 国債証券 | 1.2500 | 1,370  | 1,399  | 182,486   | 2030/10/31 |
| 小計                       | -    | -      | 55,960 | 61,598 | 8,030,031 | -          |
| <b>(ユーロ…イタリア)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券 | 0.8500 | 1,300  | 1,291  | 168,400   | 2027/01/15 |
| ITALY BTPS 0.0 01/15/24  | 国債証券 | 0.0000 | 1,000  | 998    | 130,164   | 2024/01/15 |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,280  | 1,783  | 232,520   | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37  | 国債証券 | 4.0000 | 1,660  | 2,072  | 270,150   | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28  | 国債証券 | 2.0000 | 1,430  | 1,497  | 195,200   | 2028/02/01 |
| ITALY BTPS 0.35 02/01/25 | 国債証券 | 0.3500 | 1,080  | 1,075  | 140,225   | 2025/02/01 |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26  | 国債証券 | 0.5000 | 1,400  | 1,386  | 180,688   | 2026/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47  | 国債証券 | 2.7000 | 1,120  | 1,190  | 155,201   | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 1,020  | 1,227  | 159,980   | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24  | 国債証券 | 4.5000 | 1,390  | 1,512  | 197,148   | 2024/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67  | 国債証券 | 2.8000 | 590    | 597    | 77,858    | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 国債証券 | 2.1500 | 320    | 272    | 35,457    | 2072/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25  | 国債証券 | 5.0000 | 1,790  | 2,031  | 264,838   | 2025/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26  | 国債証券 | 4.5000 | 1,630  | 1,872  | 244,062   | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 1,320  | 1,307  | 170,477   | 2032/03/01 |

| 銘柄                       | 当    |        |       | 期     |         | 末          |
|--------------------------|------|--------|-------|-------|---------|------------|
|                          | 種類   | 利率     | 額面金額  | 評価額   |         | 償還年月日      |
|                          |      |        |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| (ユーロ…イタリア)               |      | %      | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40  | 国債証券 | 3.1000 | 820   | 929   | 121,160 | 2040/03/01 |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 1,010 | 1,168 | 152,264 | 2035/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30  | 国債証券 | 3.5000 | 1,540 | 1,774 | 231,373 | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 国債証券 | 0.9500 | 1,070 | 1,084 | 141,403 | 2023/03/15 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/23 | 国債証券 | 0.9500 | 920   | 932   | 121,560 | 2023/03/01 |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 900   | 839   | 109,392 | 2036/03/01 |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41  | 国債証券 | 1.8000 | 770   | 715   | 93,310  | 2041/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 900   | 771   | 100,534 | 2037/03/01 |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,080 | 1,017 | 132,594 | 2028/03/15 |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45  | 国債証券 | 1.5000 | 590   | 504   | 65,821  | 2045/04/30 |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,110 | 1,093 | 142,518 | 2030/04/01 |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31  | 国債証券 | 0.9000 | 1,000 | 930   | 121,342 | 2031/04/01 |
| ITALY BTPS 0.0 04/15/24  | 国債証券 | 0.0000 | 1,000 | 994   | 129,643 | 2024/04/15 |
| ITALY BTPS 0.0 04/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 990   | 956   | 124,655 | 2026/04/01 |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31  | 国債証券 | 6.0000 | 1,470 | 2,019 | 263,279 | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23  | 国債証券 | 4.5000 | 1,400 | 1,480 | 192,978 | 2023/05/01 |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 810   | 839   | 109,403 | 2024/05/15 |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 国債証券 | 1.4500 | 1,340 | 1,378 | 179,643 | 2025/05/15 |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26  | 国債証券 | 1.6000 | 1,100 | 1,135 | 148,013 | 2026/06/01 |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25  | 国債証券 | 1.5000 | 1,460 | 1,504 | 196,073 | 2025/06/01 |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27  | 国債証券 | 2.2000 | 920   | 974   | 127,019 | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 国債証券 | 0.9500 | 240   | 220   | 28,724  | 2032/06/01 |
| ITALY BTPS 0.6 06/15/23  | 国債証券 | 0.6000 | 500   | 505   | 65,929  | 2023/06/15 |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26  | 国債証券 | 2.1000 | 680   | 716   | 93,373  | 2026/07/15 |
| ITALY BTPS 1.75 07/01/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,200 | 1,239 | 161,638 | 2024/07/01 |
| ITALY BTPS 0.5 07/15/28  | 国債証券 | 0.5000 | 500   | 475   | 61,960  | 2028/07/15 |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 国債証券 | 1.8500 | 900   | 937   | 122,157 | 2025/07/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34  | 国債証券 | 5.0000 | 1,610 | 2,160 | 281,700 | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39  | 国債証券 | 5.0000 | 1,330 | 1,875 | 244,464 | 2039/08/01 |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 1,900 | 2,034 | 265,239 | 2023/08/01 |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 1,040 | 1,092 | 142,411 | 2027/08/01 |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29  | 国債証券 | 3.0000 | 1,330 | 1,478 | 192,718 | 2029/08/01 |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31  | 国債証券 | 0.6000 | 1,610 | 1,450 | 189,092 | 2031/08/01 |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | 0.9500 | 1,170 | 1,107 | 144,315 | 2030/08/01 |
| ITALY BTPS 0.3 08/15/23  | 国債証券 | 0.3000 | 1,000 | 1,006 | 131,207 | 2023/08/15 |
| ITALY BTPS 0.0 08/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 600   | 576   | 75,134  | 2026/08/01 |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 940   | 1,041 | 135,760 | 2038/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 970   | 1,387 | 180,919 | 2044/09/01 |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 990   | 1,153 | 150,425 | 2046/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,680 | 2,044 | 266,502 | 2028/09/01 |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40  | 国債証券 | 5.0000 | 1,390 | 1,982 | 258,409 | 2040/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 970   | 968   | 126,221 | 2050/09/01 |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51  | 国債証券 | 1.7000 | 900   | 761   | 99,299  | 2051/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 1,140 | 1,209 | 157,653 | 2033/09/01 |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 国債証券 | 2.1500 | 400   | 371   | 48,394  | 2052/09/01 |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国債証券 | 3.7500 | 1,210 | 1,313 | 171,238 | 2024/09/01 |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 570   | 731   | 95,390  | 2049/09/01 |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 690   | 707   | 92,242  | 2036/09/01 |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | 0.9500 | 1,430 | 1,417 | 184,755 | 2027/09/15 |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | 0.6500 | 980   | 991   | 129,249 | 2023/10/15 |
| ITALY BTPS 2.45 10/01/23 | 国債証券 | 2.4500 | 930   | 967   | 126,187 | 2023/10/01 |

| 銘柄                       | 当    |        |        | 期      |            | 末          |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|------------|------------|
|                          | 種類   | 利率     | 額面金額   | 評価額    |            | 償還年月日      |
|                          |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |            |
| <b>(ユーロ…イタリア)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23  | 国債証券 | 9.0000 | 1,190  | 1,370  | 178,690    | 2023/11/01 |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | 7.2500 | 350    | 452    | 58,980     | 2026/11/01 |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27  | 国債証券 | 6.5000 | 1,790  | 2,321  | 302,647    | 2027/11/01 |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 2,050  | 2,626  | 342,385    | 2029/11/01 |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国債証券 | 1.4500 | 1,040  | 1,068  | 139,252    | 2024/11/15 |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25  | 国債証券 | 2.5000 | 550    | 586    | 76,490     | 2025/11/15 |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25  | 国債証券 | 2.0000 | 970    | 1,017  | 132,608    | 2025/12/01 |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 1,230  | 1,249  | 162,836    | 2026/12/01 |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24  | 国債証券 | 2.5000 | 1,170  | 1,236  | 161,223    | 2024/12/01 |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28  | 国債証券 | 2.8000 | 1,000  | 1,096  | 142,937    | 2028/12/01 |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 国債証券 | 0.9500 | 1,180  | 1,093  | 142,509    | 2031/12/01 |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 国債証券 | 1.6500 | 1,480  | 1,477  | 192,595    | 2030/12/01 |
| 小計                       | -    | -      | 85,330 | 92,683 | 12,082,236 | -          |
| <b>(ユーロ…フィンランド)</b>      |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| FINLAND 0.125 04/15/52   | 国債証券 | 0.1250 | 220    | 177    | 23,186     | 2052/04/15 |
| FINLAND 2.0 04/15/24     | 国債証券 | 2.0000 | 260    | 273    | 35,684     | 2024/04/15 |
| FINLAND 0.75 04/15/31    | 国債証券 | 0.7500 | 250    | 256    | 33,383     | 2031/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/47   | 国債証券 | 1.3750 | 280    | 318    | 41,553     | 2047/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/26     | 国債証券 | 0.5000 | 490    | 500    | 65,291     | 2026/04/15 |
| FINLAND 1.125 04/15/34   | 国債証券 | 1.1250 | 290    | 306    | 39,982     | 2034/04/15 |
| FINLAND 1.5 04/15/23     | 国債証券 | 1.5000 | 470    | 481    | 62,729     | 2023/04/15 |
| FINLAND 0.125 04/15/36   | 国債証券 | 0.1250 | 260    | 238    | 31,114     | 2036/04/15 |
| FINLAND 4.0 07/04/25     | 国債証券 | 4.0000 | 430    | 491    | 64,026     | 2025/07/04 |
| FINLAND 2.75 07/04/28    | 国債証券 | 2.7500 | 420    | 488    | 63,688     | 2028/07/04 |
| FINLAND 2.625 07/04/42   | 国債証券 | 2.6250 | 250    | 339    | 44,288     | 2042/07/04 |
| FINLAND 0.5 09/15/29     | 国債証券 | 0.5000 | 370    | 374    | 48,819     | 2029/09/15 |
| FINLAND 0.875 09/15/25   | 国債証券 | 0.8750 | 330    | 341    | 44,573     | 2025/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/28     | 国債証券 | 0.5000 | 100    | 101    | 13,230     | 2028/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/27     | 国債証券 | 0.5000 | 500    | 510    | 66,608     | 2027/09/15 |
| FINLAND 09/15/23         | 国債証券 | 0.0000 | 280    | 282    | 36,810     | 2023/09/15 |
| FINLAND 0.25 09/15/40    | 国債証券 | 0.2500 | 230    | 208    | 27,147     | 2040/09/15 |
| FINLAND 0.125 09/15/31   | 国債証券 | 0.1250 | 240    | 230    | 30,093     | 2031/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/30     | 国債証券 | 0.0000 | 170    | 163    | 21,288     | 2030/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/24     | 国債証券 | 0.0000 | 180    | 181    | 23,654     | 2024/09/15 |
| 小計                       | -    | -      | 6,020  | 6,268  | 817,158    | -          |
| <b>(ユーロ…オーストリア)</b>      |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62     | 国債証券 | 3.8000 | 210    | 398    | 51,885     | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47     | 国債証券 | 1.5000 | 430    | 490    | 63,891     | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29     | 国債証券 | 0.5000 | 770    | 778    | 101,527    | 2029/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28    | 国債証券 | 0.7500 | 775    | 799    | 104,275    | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/31     | 国債証券 | 0.0000 | 530    | 505    | 65,876     | 2031/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30     | 国債証券 | 0.0000 | 690    | 666    | 86,824     | 2030/02/20 |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26    | 国債証券 | 4.8500 | 740    | 890    | 116,106    | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37    | 国債証券 | 4.1500 | 890    | 1,328  | 173,218    | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51    | 国債証券 | 0.7500 | 290    | 274    | 35,831     | 2051/03/20 |
| AUSTRIA 0.7 04/20/71     | 国債証券 | 0.7000 | 250    | 203    | 26,524     | 2071/04/20 |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27     | 国債証券 | 0.5000 | 650    | 664    | 86,564     | 2027/04/20 |
| AUSTRIA 0.0 04/20/23     | 国債証券 | 0.0000 | 200    | 201    | 26,239     | 2023/04/20 |
| AUSTRIA 0.0 04/20/25     | 国債証券 | 0.0000 | 70     | 70     | 9,164      | 2025/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34     | 国債証券 | 2.4000 | 680    | 821    | 107,048    | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20    | 国債証券 | 0.8500 | 250    | 183    | 23,878     | 2120/06/30 |



| 銘柄                    | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額 | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|-----------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|                       |      |        |         | 評 価 額     |             |            |
|                       |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (ユーロ…オーストリア)          |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 470     | 695       | 90,658      | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 670     | 894       | 116,617     | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23      | 国債証券 | 0.0000 | 650     | 654       | 85,320      | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/24      | 国債証券 | 0.0000 | 800     | 806       | 105,126     | 2024/07/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17  | 国債証券 | 2.1000 | 350     | 469       | 61,196      | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 国債証券 | 1.6500 | 450     | 473       | 61,744      | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 | 480     | 495       | 64,647      | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25  | 国債証券 | 1.2000 | 640     | 670       | 87,454      | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 0.25 10/20/36 | 国債証券 | 0.2500 | 140     | 128       | 16,772      | 2036/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23 | 国債証券 | 1.7500 | 780     | 808       | 105,434     | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/40  | 国債証券 | 0.0000 | 300     | 254       | 33,233      | 2040/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/28  | 国債証券 | 0.0000 | 190     | 186       | 24,248      | 2028/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86  | 国債証券 | 1.5000 | 150     | 165       | 21,628      | 2086/11/02 |
| 小 計                   | —    | —      | 13,495  | 14,981    | 1,952,943   | —          |
| 合 計                   | —    | —      | —       | —         | 140,398,802 | —          |

## ■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

| 項 目                     | 当 期         | 末     |
|-------------------------|-------------|-------|
|                         | 評 価 額       | 比 率   |
| 公 社 債                   | 千円          | %     |
| 公 社 債                   | 140,398,802 | 98.9  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,603,315   | 1.1   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 142,002,117 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、141,683,656千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.06円、1カナダ・ドル=90.31円、1オーストラリア・ドル=82.72円、1シンガポール・ドル=85.55円、1イギリス・ポンド=156.56円、1イスラエル・シェケル=35.899円、1デンマーク・クローネ=17.53円、1ノルウェー・クローネ=12.83円、1スウェーデン・クローナ=12.24円、1メキシコ・ペソ=5.678円、1オフショア・人民元=18.197円、1マレーシア・リンギット=27.471円、1ポーランド・ズロチ=28.774円、1ユーロ=130.36円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

| 項 目                      | 当 期 末            |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産                  | 142,002,117,999円 |
| コ ー ル ・ 口 ー ン 等          | 794,768,295      |
| 公 社 債(評価額)               | 140,398,802,240  |
| 未 収 利 息                  | 769,298,727      |
| 前 払 費 用                  | 39,248,737       |
| (B) 負 債                  | 37,199,000       |
| 未 払 解 約                  | 37,199,000       |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)     | 141,964,918,999  |
| 元 本                      | 70,448,298,510   |
| 次 期 繰 越 損 益              | 71,516,620,489   |
| (D) 受 益 権 総 口 数          | 70,448,298,510口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 20,152円          |

|                               |                 |   |                 |
|-------------------------------|-----------------|---|-----------------|
| (注1) 期首元本額                    | 69,085,269,493円 | DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                   | 154,405,852円    |
| 追加設定元本額                       | 27,244,251,872円 | 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>                       | 340,795,660円    |
| 一部解約元本額                       | 25,881,222,855円 | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                      | 412,429,256円    |
| (注2) 期末における元本の内訳              |                 | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                      | 180,716,406円    |
| DIAM外国債券パッシブ・ファンド             | 7,932,936,286円  | 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>                      | 87,293,544円     |
| MITOラップ型ファンド(安定型)             | 10,339,634円     | DIAMパッシブ資産分散ファンド                          | 1,181,097,770円  |
| MITOラップ型ファンド(中立型)             | 40,206,625円     | インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)     | 515,001円        |
| MITOラップ型ファンド(積極型)             | 116,655,366円    | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)     | 358,315円        |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型)          | 57,288,539円     | マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)        | 100,794,148円    |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型)          | 34,587,798円     | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)     | 418,167円        |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型)          | 22,681,845円     | インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)     | 546,045円        |
| たわらノーロード 先進国債券                | 13,393,825,381円 | インカム重視マルチアセット運用ファンドI   2021-04(適格機関投資家限定) | 30,957,907円     |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>         | 237,469,433円    | マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06         | 461,773,967円    |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型)         | 1,697,389,145円  | インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)     | 294,771円        |
| たわらノーロード バランス(堅実型)            | 48,164,130円     | DIAM海苔フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)     | 5,739,805,045円  |
| たわらノーロード バランス(標準型)            | 234,951,241円    | DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)               | 2,636,710,982円  |
| たわらノーロード バランス(積極型)            | 48,864,225円     | 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)                   | 2,562,881,929円  |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)   | 6,482,910円      | 先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)                  | 5,405,812,637円  |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)   | 328,688,088円    | DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)               | 53,529,486円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 382,425,252円    | インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)            | 645,235円        |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)   | 74,160,647円     | DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)         | 421,372,128円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)   | 2,643,196円      | DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)         | 250,634,953円    |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型)         | 364,777円        | DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)           | 17,641,800円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)         | 3,078,910円      | DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)           | 41,091,423円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)       | 26,244,851円     | DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)           | 8,714,858円      |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)         | 2,149,968円      | DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)           | 681,339円        |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)         | 2,109,913円      | DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)             | 16,361,009円     |
| DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>      | 6,296,983,167円  | DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)             | 48,455,016円     |
| One DC 先進国債券インデックスファンド        | 579,039,841円    | DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)               | 1,982,846,491円  |
| Oneグローバルバランス                  | 6,106,309円      | DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)             | 1,578,600,509円  |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型       | 711,700,267円    | DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)               | 2,769,411,536円  |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型    | 2,226,508,317円  | DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)          | 118,777,739円    |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型       | 2,403,942,419円  | DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)         | 155,311,687円    |
| DIAM DCバランス30インデックスファンド       | 398,546,899円    | DIAMアクサグローバルバランスファンド30VA(適格機関投資家限定)       | 1,842,758,601円  |
| DIAM DCバランス50インデックスファンド       | 832,352,900円    | DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)           | 419,588,655円    |
| DIAM DCバランス70インデックスファンド       | 708,824,350円    | DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)             | 3,247,697円      |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)          | 14,028,565円     | DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)          | 357,842,695円    |
| マネックス資産設計ファンド(育成型)            | 469,729,710円    | DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)          | 352,697,590円    |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション        | 33,691,463円     | DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)          | 479,890,739円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)    | 134,924,668円    | DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)                 | 57,398,790円     |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)    | 124,156,154円    | 期末元本合計                                    | 70,448,298,510円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)    | 214,713,670円    |   |                 |
| フルーズコントロール                    | 314,234,233円    |   |                 |

## ■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

| 項   | 目            | 当               | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益        | 2,669,252,055   | 円 |
|     | 受取利息         | 2,669,419,651   |   |
|     | 支払利息         | △167,596        |   |
| (B) | 有価証券売買損益     | △631,639,253    |   |
|     | 売却益          | 7,707,170,489   |   |
|     | 売却損          | △8,338,809,742  |   |
| (C) | その他の費用       | △18,689,995     |   |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 2,018,922,807   |   |
| (E) | 前期繰越損益金      | 67,952,264,861  |   |
| (F) | 解約差損益金       | △26,936,052,307 |   |
| (G) | 追加信託差損益金     | 28,481,485,128  |   |
| (H) | 計(D+E+F+G)   | 71,516,620,489  |   |
|     | 次期繰越損益金(H)   | 71,516,620,489  |   |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。