

## 運用報告書（全体版）

第16期＜決算日2024年5月8日＞

### たわらノーロード 外国債券 （為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞

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   | 2008年6月3日から無期限です。                                                                                                                       |                                               |
| 運用方針   | F T S E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、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）の動きに連動する投資成果を目指します。                                   |                                               |
| 主要投資対象 | たわらノーロード<br>外国債券（為替ヘッジなし）<br>＜ラップ専用＞                                                                                                    | 外国債券パッシブ・ファンド・マ<br>ザーファンド受益証券を主要投資<br>対象とします。 |
|        | 外 国 債 券<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド                                                                                                        | 海外の公社債を主要投資対象とし<br>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。<br>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。                                                                               |                                               |
| 組入制限   | たわらノーロード<br>外国債券（為替ヘッジなし）<br>＜ラップ専用＞                                                                                                    | 外貨建資産への実質投資割合には<br>制限を設けません。                  |
|        | 外 国 債 券<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド                                                                                                        | 外貨建資産への投資には、制限を<br>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。 |                                               |

（旧ファンド名称：MHAM外国債券インデックスファンド（ファンドラップ））

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、「たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞」は、2024年5月8日に第16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

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

# たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞

## ■最近5期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |            |            | F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) |            | 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          |
| 12期(2020年5月8日)  | 12,545  | 0          | 3.3        | 13,668.94                                 | 3.4        | 97.1        | —           | 754          |
| 13期(2021年5月10日) | 13,392  | 0          | 6.8        | 14,618.86                                 | 6.9        | 98.4        | —           | 3,168        |
| 14期(2022年5月9日)  | 13,572  | 0          | 1.3        | 14,924.08                                 | 2.1        | 93.7        | —           | 5,445        |
| 15期(2023年5月8日)  | 13,831  | 0          | 1.9        | 15,181.14                                 | 1.7        | 99.1        | —           | 4,918        |
| 16期(2024年5月8日)  | 15,775  | 0          | 14.1       | 17,377.04                                 | 14.5       | 98.6        | —           | 8,668        |

- (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（現地ベース）の値を用いており、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（小数点第3位を四捨五入）（以下同じ）。
- (注4) ベンチマークは設定日（2008年6月3日）を10,000として指数化しております（以下同じ）。
- (注5) ベンチマークは、2022年2月28日までは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）、2022年3月1日以降は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）のデータを使用しています（以下同じ）。
- (注6) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E Fixed Income L L Cにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。F T S E Fixed Income L L C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、F T S E Fixed Income L L C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F T S E Fixed Income L L Cに帰属します（以下同じ）。
- (注7) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

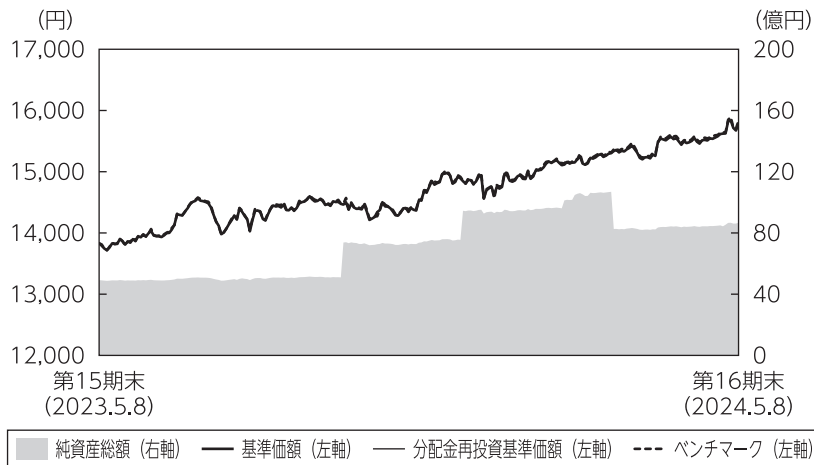
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 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、円ベース、為替ヘッジなし) |       | 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       | %     |                                           | %     | %           | %           |
| 2023年5月8日 | 13,831  | —     | 15,181.14                                 | —     | 99.1        | —           |
| 5月末       | 13,969  | 1.0   | 15,342.55                                 | 1.1   | 98.8        | —           |
| 6月末       | 14,527  | 5.0   | 15,972.65                                 | 5.2   | 98.7        | —           |
| 7月末       | 14,212  | 2.8   | 15,619.65                                 | 2.9   | 98.7        | —           |
| 8月末       | 14,599  | 5.6   | 16,041.49                                 | 5.7   | 98.9        | —           |
| 9月末       | 14,385  | 4.0   | 15,802.44                                 | 4.1   | 98.6        | —           |
| 10月末      | 14,366  | 3.9   | 15,792.47                                 | 4.0   | 98.7        | —           |
| 11月末      | 14,868  | 7.5   | 16,342.76                                 | 7.7   | 98.5        | —           |
| 12月末      | 14,885  | 7.6   | 16,378.89                                 | 7.9   | 98.5        | —           |
| 2024年1月末  | 15,148  | 9.5   | 16,646.57                                 | 9.7   | 99.4        | —           |
| 2月末       | 15,342  | 10.9  | 16,870.89                                 | 11.1  | 98.5        | —           |
| 3月末       | 15,532  | 12.3  | 17,097.86                                 | 12.6  | 98.3        | —           |
| 4月末       | 15,824  | 14.4  | 17,395.23                                 | 14.6  | 98.5        | —           |
| (期 末)     |         |       |                                           |       |             |             |
| 2024年5月8日 | 15,775  | 14.1  | 17,377.04                                 | 14.5  | 98.6        | —           |

- (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（2023年5月9日から2024年5月8日まで）

### 基準価額等の推移



第16期首：13,831円  
第16期末：15,775円  
(既払分配金0円)  
騰落率：14.1%  
(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

インフレ率が高水準で推移する中で、各中央銀行が高い金利を維持したことから米国国債、ドイツ国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。米ドル／円相場はF R B（米連邦準備理事会）の高い金利を維持したこと、日銀が金融緩和を継続したことを受けて円安米ドル高になりました。債券価格の下落は基準価額の下落要因となりましたが、円安米ドル高の影響を受けて基準価額は上昇しました。

## 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、インフレ率が高水準で推移する中でF R Bが高い金利を維持したことを受けて利回りは上昇しました。その後、早期の利下げ観測から利回りは上昇幅を縮小しました。ドイツ国債についても米国国債の金利上昇やE C B（欧州中央銀行）が高い金利を維持したことを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では米ドル／円相場は円安米ドル高に、ユーロ／円相場は円安ユーロ高となりました。

米国が金融引き締めが継続している一方で、日銀が緩和的な金融政策を堅持していることなどを背景に円安米ドル高に推移しました。

ユーロ／円相場についても、同様に中央銀行の金融政策の違いから円安ユーロ高となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

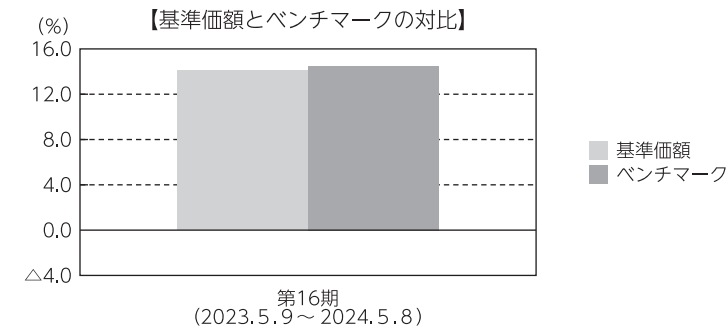
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

### ●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0.4%下回りました。この差異は、ファンドとベンチマークの採用時価が異なること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                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2023年5月9日<br>～2024年5月8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  | 6,923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・マザーファンドを高位に組み入れます。
- 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16期                      |         | 項目の概要                                            |
|-----------|---------------------------|---------|--------------------------------------------------|
|           | (2023年5月9日<br>～2024年5月8日) |         |                                                  |
|           | 金額                        | 比率      |                                                  |
| (a) 信託報酬  | 10円                       | 0.066%  | (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14,719円です。 |
| （投信会社）    | （ 5 ）                     | (0.033) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価         |
| （販売会社）    | （ 2 ）                     | (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种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| （受託会社）    | （ 3 ）                     | (0.022) | 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                         | 0.021   | (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 ）                     | (0.017) | 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）    | （ 1 ）                     | (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 ）                     | (0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等                             |
| 合計        | 13                        | 0.087   |                                                  |

(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。

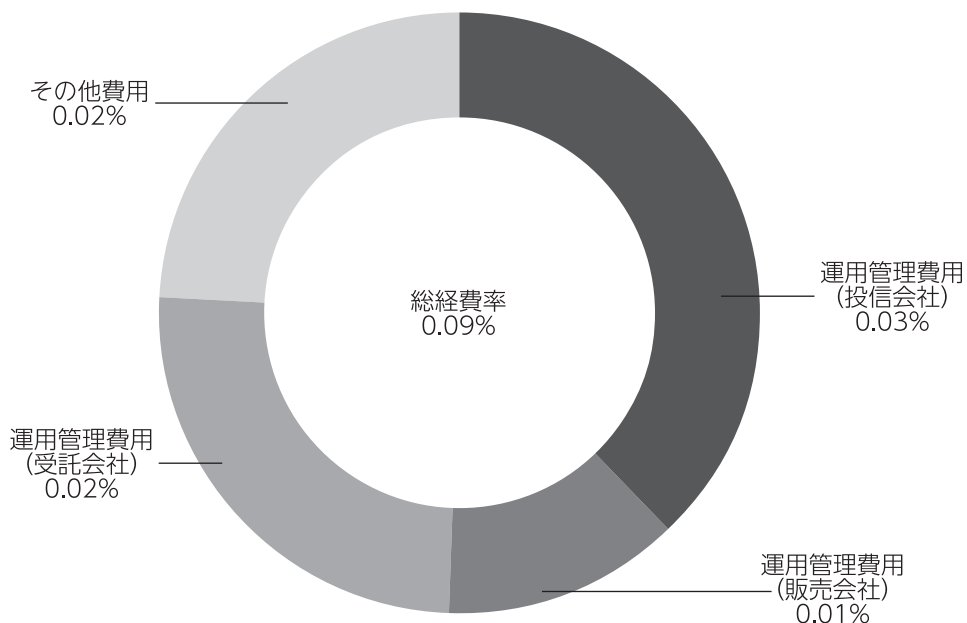
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.09%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（2023年5月9日から2024年5月8日まで）

|                       | 設 定             |                 | 解 約             |                 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                       | □ 数             | 金 額             | □ 数             | 金 額             |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 千口<br>2,590,727 | 千円<br>5,811,945 | 千口<br>1,315,474 | 千円<br>3,033,251 |

■利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2024年5月8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           |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 千口<br>2,343,386 | 千口<br>3,618,639 | 千円<br>8,668,089 |

■投資信託財産の構成

2024年5月8日現在

| 項 目                                       | 当 期 末           |           |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------|
|                                           | 評 価 額           | 比 率       |
| 外 国 債 券 パ ッ シ ブ ・ フ ァ ン ド ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | 千円<br>8,668,089 | %<br>99.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他                   | 19,485          | 0.2       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額                           | 8,687,574       | 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、256,080,120千円、98.6％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、2024年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝154.95円、1カナダ・ドル＝112.81円、1オーストラリア・ドル＝102.03円、1シンガポール・ドル＝114.35円、1ニュージーランド・ドル＝92.86円、1イギリス・ポンド＝193.66円、1イスラエル・シェケル＝41.888円、1デンマーク・クローネ＝22.32円、1ノルウェー・クローネ＝14.17円、1スウェーデン・クローナ＝14.24円、1メキシコ・ペソ＝9.164円、1オフショア・人民元＝21.436円、1マレーシア・リンギット＝32.66円、1ポーランド・ズロチ＝38.621円、1ユーロ＝166.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月8日)現在

| 項 目                         | 当 期 末          |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資 産                     | 8,687,574,875円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等             | 18,969,853     |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド (評価額) | 8,668,089,022  |
| 未 収 入 金                     | 516,000        |
| (B) 負 債                     | 19,344,866     |
| 未 払 解 約 金                   | 16,224,827     |
| 未 払 信 託 報 酬                 | 2,957,926      |
| そ の 他 未 払 費 用               | 162,113        |
| (C) 純 資 産 総 額 (A－B)         | 8,668,230,009  |
| 元 本                         | 5,494,847,946  |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 3,173,382,063  |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 5,494,847,946口 |
| 1 万口当たり基準価額 (C／D)           | 15,775円        |

(注) 期首における元本額は3,555,942,236円、当期中における追加設定元本額は4,388,468,291円、同解約元本額は2,449,562,581円です。

■損益の状況

当期 自2023年5月9日 至2024年5月8日

| 項 目                   | 当 期             |
|-----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | △2円             |
| 受 取 利 息               | 1,344           |
| 支 払 利 息               | △1,346          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | 757,844,423     |
| 売 買 損 益               | 961,763,276     |
| 売 買 損 益               | △203,918,853    |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △5,084,685      |
| (D) 当 期 損 益 金 (A＋B＋C) | 752,759,736     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | 114,988,816     |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | 2,305,633,511   |
| (配 当 等 相 当 額)         | (2,931,313,443) |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△625,679,932)  |
| (G) 合 計 (D＋E＋F)       | 3,173,382,063   |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G)     | 3,173,382,063   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | 2,305,633,511   |
| (配 当 等 相 当 額)         | (2,936,819,962) |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△631,186,451)  |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 867,748,552     |

(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         | 179,864,551円  |
| (b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益 | 572,895,185   |
| (c) 収 益 調 整 金                     | 2,936,819,962 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金                 | 114,988,816   |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額 (a＋b＋c＋d)       | 3,804,568,514 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額     | 6,923.88      |
| (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

■ファンド名称を「MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)」から「たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>」に変更しました。

(2023年8月8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21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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21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、「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）」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   |           | F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |           | 債券組入率 | 債券先物率 | 純 資 産 額 |
|------------------|-----------|-----------|-----------------------------------------------------------|-----------|-------|-------|---------|
|                  | 期 中 騰 落 率 | 期 中 騰 落 率 | 期 中 騰 落 率                                                 | 期 中 騰 落 率 |       |       |         |
|                  | 円         | %         | ポイント                                                      | %         | %     | %     | 百万円     |
| 17期 (2020年2月21日) | 19,586    | 7.8       | 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 |
| 20期 (2023年2月21日) | 20,182    | 0.1       | 126,494.96                                                | 0.2       | 99.0  | —     | 186,822 |
| 21期 (2024年2月21日) | 23,220    | 15.1      | 145,648.68                                                | 15.1      | 98.7  | —     | 260,393 |

(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）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) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E F i x e d I n c o m e L L C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、F T S E F i x e d I n c o m e L L C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F T S E F i x e d I n c o m e L L Cに帰属します（以下同じ）。

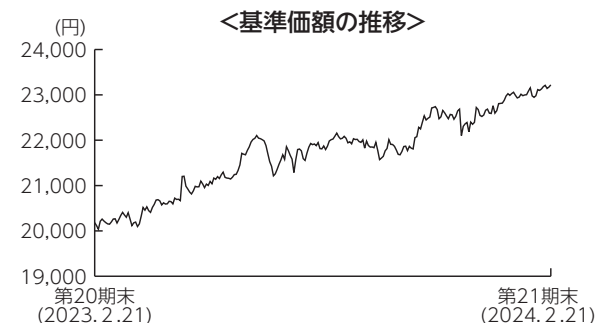
(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年<br>月<br>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 率<br>比 | 債 券 先 物 率<br>比 |
|----------------------------|-------------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------|----------------|
|                            |             | 騰 落 率  |                                                                                     | 騰 落 率  |                |                |
| ( 期 首 )<br>2023 年 2 月 21 日 | 円<br>20,182 | %<br>— | ポイント<br>126,494.96                                                                  | %<br>— | %<br>99.0      | %<br>—         |
| 2 月 末                      | 20,261      | 0.4    | 126,903.56                                                                          | 0.3    | 98.9           | —              |
| 3 月 末                      | 20,517      | 1.7    | 128,532.24                                                                          | 1.6    | 98.7           | —              |
| 4 月 末                      | 20,668      | 2.4    | 129,370.99                                                                          | 2.3    | 98.6           | —              |
| 5 月 末                      | 21,198      | 5.0    | 132,828.99                                                                          | 5.0    | 98.8           | —              |
| 6 月 末                      | 22,045      | 9.2    | 138,284.08                                                                          | 9.3    | 98.7           | —              |
| 7 月 末                      | 21,569      | 6.9    | 135,227.94                                                                          | 6.9    | 98.7           | —              |
| 8 月 末                      | 22,157      | 9.8    | 138,880.03                                                                          | 9.8    | 98.9           | —              |
| 9 月 末                      | 21,834      | 8.2    | 136,810.50                                                                          | 8.2    | 98.6           | —              |
| 10 月 末                     | 21,807      | 8.1    | 136,724.14                                                                          | 8.1    | 98.7           | —              |
| 11 月 末                     | 22,569      | 11.8   | 141,488.31                                                                          | 11.9   | 98.5           | —              |
| 12 月 末                     | 22,596      | 12.0   | 141,801.08                                                                          | 12.1   | 98.5           | —              |
| 2024 年 1 月 末               | 22,998      | 14.0   | 144,118.59                                                                          | 13.9   | 99.4           | —              |
| ( 期 末 )<br>2024 年 2 月 21 日 | 23,220      | 15.1   | 145,648.68                                                                          | 15.1   | 98.7           | —              |

(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（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

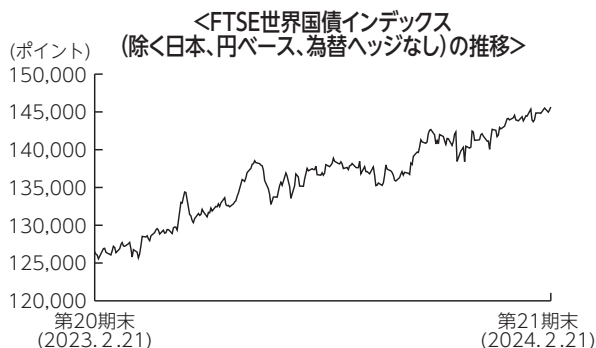


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め of 長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され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、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め of 長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め of 長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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 R Bが金融引き締めを継続する中、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

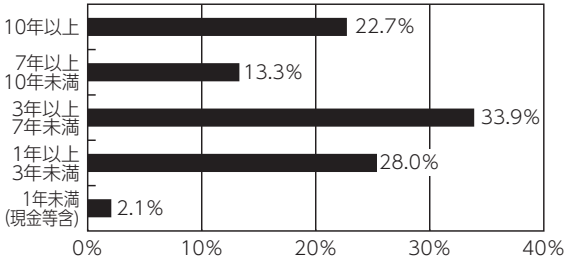
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

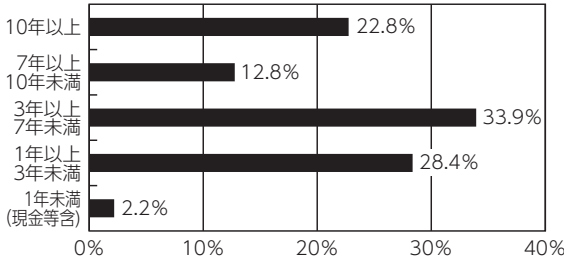
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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       | 49.5%  | 50.0%      | △0.5% |
|           | カナダ      | 2.0%   | 2.1%       | △0.0% |
|           | 計        | 51.6%  | 52.0%      | △0.5% |
| 中南米       | メキシコ     | 0.9%   | 0.9%       | △0.0% |
|           | 計        | 0.9%   | 0.9%       | △0.0% |
| 欧州        | オーストリア   | 1.2%   | 1.2%       | △0.0% |
|           | ベルギー     | 1.9%   | 1.9%       | △0.0% |
|           | フィンランド   | 0.5%   | 0.5%       | △0.0% |
|           | フランス     | 8.4%   | 8.4%       | 0.0%  |
|           | ドイツ      | 6.5%   | 6.4%       | 0.0%  |
|           | アイルランド   | 0.6%   | 0.6%       | △0.0% |
|           | イタリア     | 7.5%   | 7.6%       | △0.1% |
|           | オランダ     | 1.5%   | 1.5%       | △0.0% |
|           | スペイン     | 5.0%   | 5.0%       | △0.0% |
|           | ユーロ計     | 33.1%  | 33.2%      | △0.1% |
|           | デンマーク    | 0.3%   | 0.3%       | 0.0%  |
|           | スウェーデン   | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 英国       | 4.8%   | 4.7%       | 0.1%  |
| アジア・オセアニア | ポーランド    | 0.4%   | 0.5%       | △0.0% |
|           | ノルウェー    | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 計        | 39.0%  | 39.1%      | △0.1% |
|           | オーストラリア  | 1.6%   | 1.6%       | △0.0% |
|           | ニュージーランド | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 中国       | 4.4%   | 4.8%       | △0.4% |
| 中近東       | シンガポール   | 0.5%   | 0.4%       | 0.0%  |
|           | マレーシア    | 0.6%   | 0.6%       | △0.0% |
|           | 計        | 7.2%   | 7.6%       | △0.4% |
|           | イスラエル    | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
|           | 計        | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
|           | 現金など     | 1.0%   | —          | —     |
| 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       | 46.7%  | 47.2%      | △0.5% |
|           | カナダ      | 2.0%   | 2.0%       | △0.0% |
|           | 計        | 48.7%  | 49.2%      | △0.5% |
| 中南米       | メキシコ     | 0.8%   | 0.9%       | △0.0% |
|           | 計        | 0.8%   | 0.9%       | △0.0% |
| 欧州        | オーストリア   | 1.2%   | 1.2%       | △0.0% |
|           | ベルギー     | 1.7%   | 1.8%       | △0.0% |
|           | フィンランド   | 0.5%   | 0.5%       | △0.0% |
|           | フランス     | 8.0%   | 8.1%       | △0.1% |
|           | ドイツ      | 6.3%   | 6.3%       | △0.0% |
|           | アイルランド   | 0.6%   | 0.6%       | △0.0% |
|           | イタリア     | 7.3%   | 7.3%       | △0.1% |
|           | オランダ     | 1.5%   | 1.5%       | △0.0% |
|           | スペイン     | 4.8%   | 4.9%       | △0.1% |
|           | ユーロ計     | 31.8%  | 32.1%      | △0.3% |
|           | デンマーク    | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
|           | スウェーデン   | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 英国       | 5.2%   | 5.2%       | △0.1% |
| アジア・オセアニア | ポーランド    | 0.5%   | 0.5%       | △0.0% |
|           | ノルウェー    | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 計        | 38.1%  | 38.5%      | △0.4% |
|           | オーストラリア  | 1.3%   | 1.4%       | △0.0% |
|           | ニュージーランド | 0.2%   | 0.2%       | △0.0% |
|           | 中国       | 8.3%   | 8.5%       | △0.2% |
| 中近東       | シンガポール   | 0.4%   | 0.4%       | △0.0% |
|           | マレーシア    | 0.5%   | 0.5%       | △0.0% |
|           | 計        | 10.7%  | 11.0%      | △0.3% |
|           | イスラエル    | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
|           | 計        | 0.3%   | 0.3%       | △0.0% |
|           | 現金など     | 1.3%   | —          | —     |
| 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15.1%上昇しました。  
当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

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  | 0.015%  | (a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保 管 費 用)            | (3) | (0.014) |                                                                                 |
| (そ の 他)              | (0) | (0.001) |                                                                                 |
| 合 計                  | 3   | 0.015   |                                                                                 |
| 期中の平均基準価額は21,728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（2023年2月22日から2024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>459,048    | 千アメリカ・ドル<br>331,987   |
|   | カナダ      | 国債証券    | 千カナダ・ドル<br>25,463      | 千カナダ・ドル<br>17,904     |
|   | オーストラリア  | 国債証券    | 千オーストラリア・ドル<br>16,897  | 千オーストラリア・ドル<br>13,157 |
|   | シンガポール   | 国債証券    | 千シンガポール・ドル<br>3,224    | 千シンガポール・ドル<br>2,464   |
|   | ニュージーランド | 国債証券    | 千ニュージーランド・ドル<br>2,597  | 千ニュージーランド・ドル<br>989   |
|   | イギリス     | 国債証券    | 千イギリス・ポンド<br>40,138    | 千イギリス・ポンド<br>22,621   |
|   | イスラエル    | 国債証券    | 千イスラエル・シュケル<br>7,410   | 千イスラエル・シュケル<br>3,549  |
|   | デンマーク    | 国債証券    | 千デンマーク・クローネ<br>11,286  | 千デンマーク・クローネ<br>12,347 |
|   | ノルウェー    | 国債証券    | 千ノルウェー・クローネ<br>13,227  | 千ノルウェー・クローネ<br>10,083 |
|   | スウェーデン   | 国債証券    | 千スウェーデン・クローナ<br>9,524  | 千スウェーデン・クローナ<br>2,541 |
|   | メキシコ     | 国債証券    | 千メキシコ・ペソ<br>113,030    | 千メキシコ・ペソ<br>81,670    |
|   | 中国       | 国債証券    | 千オフショア・人民元<br>730,187  | 千オフショア・人民元<br>137,577 |
|   | マレーシア    | 国債証券    | 千マレーシア・リンギット<br>11,910 | 千マレーシア・リンギット<br>7,301 |
|   | ポーランド    | 国債証券    | 千ポーランド・ズロチ<br>16,614   | 千ポーランド・ズロチ<br>10,609  |
| 国 | ユーロ圏     | アイルランド  | 千ユーロ<br>3,525          | 千ユーロ<br>2,887         |
|   |          | オランダ    | 11,284                 | 8,015                 |
|   |          | ベルギー    | 12,412                 | 9,503                 |
|   |          | フランス    | 70,879                 | 54,149                |
|   |          | ドイツ     | 54,900                 | 40,085                |
|   |          | スペイン    | 40,842                 | 30,090                |
|   |          | イタリア    | 62,054                 | 47,199                |
|   |          | フィンランド  | 3,929                  | 2,451                 |
|   |          | オーストラリア | 10,493                 | 7,197                 |

（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（2023年2月22日から2024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>916,450     | 千アメリカ・ドル<br>810,479     | 千円<br>121,701,636 | %<br>46.7 | %<br>－             | %<br>19.6         | %<br>19.4 | %<br>7.8 |
| カ   ナ   ダ             | 千カナダ・ドル<br>50,260       | 千カナダ・ドル<br>46,076       | 千円<br>5,115,401   | 2.0       | －                  | 1.1               | 0.5       | 0.4      |
| オーストラリア               | 千オーストラリア・ドル<br>40,065   | 千オーストラリア・ドル<br>35,489   | 千円<br>3,492,489   | 1.3       | －                  | 0.9               | 0.3       | 0.1      |
| シンガポール                | 千シンガポール・ドル<br>9,855     | 千シンガポール・ドル<br>9,323     | 千円<br>1,041,728   | 0.4       | －                  | 0.3               | 0.1       | 0.0      |
| ニュージーランド              | 千ニュージーランド・ドル<br>7,570   | 千ニュージーランド・ドル<br>6,419   | 千円<br>594,617     | 0.2       | －                  | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| イ   ギ   リ   ス         | 千イギリス・ポンド<br>86,324     | 千イギリス・ポンド<br>70,878     | 千円<br>13,437,202  | 5.2       | －                  | 3.5               | 1.1       | 0.6      |
| イ   ス   ラ   エ   ル     | 千イスラエル・シェケル<br>22,320   | 千イスラエル・シェケル<br>19,889   | 千円<br>810,730     | 0.3       | －                  | 0.2               | 0.1       | 0.1      |
| デ   ン   マ   ー   ク     | 千デンマーク・クローネ<br>32,720   | 千デンマーク・クローネ<br>30,676   | 千円<br>668,129     | 0.3       | －                  | 0.2               | 0.0       | 0.0      |
| ノ   ル   ウ   ェ   ー     | 千ノルウェー・クローネ<br>32,620   | 千ノルウェー・クローネ<br>29,940   | 千円<br>429,040     | 0.2       | －                  | 0.1               | 0.0       | 0.0      |
| ス   ウ   ェ   ー   デ   ン | 千スウェーデン・クローナ<br>37,140  | 千スウェーデン・クローナ<br>35,693  | 千円<br>517,914     | 0.2       | －                  | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| メ   キ   シ   コ         | 千メキシコ・ペソ<br>273,005     | 千メキシコ・ペソ<br>250,053     | 千円<br>2,201,447   | 0.8       | －                  | 0.5               | 0.3       | 0.0      |
| 中   国                 | 千オフショア・人民元<br>1,000,520 | 千オフショア・人民元<br>1,032,940 | 千円<br>21,528,239  | 8.3       | －                  | 3.7               | 3.7       | 0.8      |
| マ   レ   ー   シ   ア     | 千マレーシア・リンギット<br>38,060  | 千マレーシア・リンギット<br>38,987  | 千円<br>1,219,734   | 0.5       | －                  | 0.3               | 0.1       | 0.0      |
| ポ   ー   ラ   ン   ド     | 千ポーランド・ズロチ<br>39,150    | 千ポーランド・ズロチ<br>35,744    | 千円<br>1,344,336   | 0.5       | －                  | 0.2               | 0.3       | 0.1      |
| ユ   ー   ロ             | 千ユーロ                    | 千ユーロ                    | 千円                |           |                    |                   |           |          |
| アイルランド                | 10,200                  | 9,105                   | 1,478,204         | 0.6       | －                  | 0.4               | 0.1       | 0.0      |
| オ   ラ   ン   ダ         | 25,700                  | 23,264                  | 3,776,775         | 1.5       | －                  | 0.8               | 0.5       | 0.1      |
| ベ   ル   ギ   ー         | 30,390                  | 27,580                  | 4,477,411         | 1.7       | －                  | 1.2               | 0.5       | 0.1      |
| フ   ラ   ン   ス         | 141,120                 | 128,977                 | 20,938,250        | 8.0       | －                  | 4.8               | 2.6       | 0.6      |
| ド   イ   ツ             | 108,580                 | 100,614                 | 16,333,748        | 6.3       | －                  | 3.3               | 2.1       | 0.8      |
| ス   ペ   イ   ン         | 82,390                  | 77,154                  | 12,525,285        | 4.8       | －                  | 2.7               | 1.6       | 0.6      |
| イ   タ   リ   ア         | 122,640                 | 116,425                 | 18,900,577        | 7.3       | －                  | 4.1               | 2.5       | 0.7      |
| フィンランド                | 9,630                   | 8,170                   | 1,326,408         | 0.5       | －                  | 0.3               | 0.1       | 0.1      |
| オーストリア                | 21,230                  | 18,965                  | 3,078,798         | 1.2       | －                  | 0.6               | 0.5       | 0.1      |
| 合   計                 | －                       | －                       | 千円<br>256,938,107 | 98.7      | －                  | 48.9              | 36.6      | 13.1     |

(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                      | 柄 | 当 |   |   | 期 |        | 未 |       |   |       |   |   |   |           |   |   |   |   |   |   |   |   |            |
|-------------------------|---|---|---|---|---|--------|---|-------|---|-------|---|---|---|-----------|---|---|---|---|---|---|---|---|------------|
|                         |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額      | 面 | 金     | 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 2.625 01/31/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 |   | 2,460 |   | 2,371 |   |   |   | 356,089   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/01/31 |
| US T N/B 1.5 01/31/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 |   | 5,740 |   | 5,288 |   |   |   | 794,126   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 |   | 4,500 |   | 4,000 |   |   |   | 600,691   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2029/01/31 |
| US T N/B 1.375 01/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 |   | 750   |   | 725   |   |   |   | 108,912   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/01/31 |
| US T N/B 0.75 01/31/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 |   | 4,380 |   | 3,819 |   |   |   | 573,587   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/01/31 |
| US T N/B 4.125 01/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1250 |   | 1,800 |   | 1,785 |   |   |   | 268,146   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 |   | 3,400 |   | 3,261 |   |   |   | 489,813   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/01/31 |
| US T N/B 0.375 01/31/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3750 |   | 5,700 |   | 5,256 |   |   |   | 789,361   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 |   | 2,380 |   | 2,310 |   |   |   | 346,875   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/01/31 |
| US T N/B 4.0 01/15/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 |   | 3,000 |   | 2,968 |   |   |   | 445,728   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/01/15 |
| US T N/B 3.875 01/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 |   | 4,300 |   | 4,243 |   |   |   | 637,175   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/01/15 |
| US T N/B 6.0 02/15/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.0000 |   | 2,400 |   | 2,464 |   |   |   | 370,083   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 |   | 1,360 |   | 1,120 |   |   |   | 168,216   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 |   | 1,540 |   | 1,255 |   |   |   | 188,501   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 |   | 1,370 |   | 973   |   |   |   | 146,217   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 |   | 1,000 |   | 903   |   |   |   | 135,633   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.3750 |   | 1,860 |   | 1,992 |   |   |   | 299,197   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 |   | 500   |   | 515   |   |   |   | 77,347    |   |   |   |   |   |   |   |   | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 |   | 1,230 |   | 1,267 |   |   |   | 190,255   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250 |   | 1,630 |   | 1,424 |   |   |   | 213,888   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 |   | 4,610 |   | 3,530 |   |   |   | 530,129   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2049/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/52  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 |   | 5,000 |   | 3,219 |   |   |   | 483,415   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2052/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750 |   | 600   |   | 603   |   |   |   | 90,611    |   |   |   |   |   |   |   |   | 2038/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/53 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250 |   | 3,800 |   | 3,277 |   |   |   | 492,149   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2053/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6250 |   | 1,690 |   | 1,723 |   |   |   | 258,845   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2040/02/15 |
| US T N/B 2.375 02/15/42 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 |   | 3,610 |   | 2,636 |   |   |   | 395,854   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2042/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/51 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 |   | 5,780 |   | 3,405 |   |   |   | 511,431   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2051/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 |   | 6,090 |   | 5,751 |   |   |   | 863,678   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 |   | 2,810 |   | 2,020 |   |   |   | 303,350   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2045/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 |   | 2,360 |   | 1,825 |   |   |   | 274,185   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 |   | 2,650 |   | 2,037 |   |   |   | 306,020   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 |   | 2,040 |   | 1,981 |   |   |   | 297,545   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 |   | 4,830 |   | 4,477 |   |   |   | 672,407   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2029/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 |   | 4,540 |   | 4,283 |   |   |   | 643,206   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 |   | 3,780 |   | 3,556 |   |   |   | 534,113   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/28/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 |   | 2,280 |   | 2,189 |   |   |   | 328,837   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/02/28 |
| US T N/B 2.75 02/28/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 |   | 1,960 |   | 1,917 |   |   |   | 287,912   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/15/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250 |   | 9,690 |   | 7,896 |   |   |   | 1,185,695 |   |   |   |   |   |   |   |   | 2031/02/15 |
| US T N/B 3.875 02/15/43 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 |   | 3,500 |   | 3,186 |   |   |   | 478,547   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2043/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/41 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 |   | 5,100 |   | 3,485 |   |   |   | 523,327   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2041/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/50   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 |   | 4,420 |   | 2,712 |   |   |   | 407,376   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/32 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 |   | 8,280 |   | 6,939 |   |   |   | 1,041,964 |   |   |   |   |   |   |   |   | 2032/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/33   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 |   | 7,900 |   | 7,436 |   |   |   | 1,116,617 |   |   |   |   |   |   |   |   | 2033/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250 |   | 1,100 |   | 1,000 |   |   |   | 150,171   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/15/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 |   | 4,830 |   | 4,128 |   |   |   | 619,966   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/28/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 |   | 5,210 |   | 4,844 |   |   |   | 727,417   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/28/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250 |   | 2,980 |   | 2,867 |   |   |   | 430,577   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/29/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250 |   | 4,690 |   | 4,143 |   |   |   | 622,257   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/02/29 |

| 銘                       | 柄 | 当 |   |   | 期 |          | 末     |          |         |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |            |   |
|-------------------------|---|---|---|---|---|----------|-------|----------|---------|----|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|------------|---|
|                         |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額        | 面     | 金        | 額       | 外  | 貨 | 建 | 金 | 額 | 邦 | 貨 | 換 | 算 | 金 | 額 | 償 | 還 | 年 | 月          | 日 |
|                         |   |   |   |   |   |          |       |          |         |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |            |   |
| (アメリカ)                  |   |   |   |   | % | 千アメリカ・ドル |       | 千アメリカ・ドル |         | 千円 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |            |   |
| US T N/B 1.875 02/28/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750   | 4,700 | 4,196    | 630,186 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2029/02/28 |   |
| US T N/B 0.5 02/28/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000   | 5,170 | 4,766    | 715,767 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/02/28 |   |
| US T N/B 1.5 02/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000   | 4,550 | 4,397    | 660,307 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/02/15 |   |
| US T N/B 4.0 02/28/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000   | 3,000 | 2,955    | 443,775 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/02/28 |   |
| US T N/B 4.0 02/29/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000   | 3,200 | 3,163    | 474,993 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/02/29 |   |
| US T N/B 4.0 02/15/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000   | 4,000 | 3,956    | 594,070 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/02/15 |   |
| US T N/B 2.625 03/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250   | 1,790 | 1,746    | 262,297 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/03/31 |   |
| US T N/B 2.25 03/31/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500   | 3,300 | 3,150    | 473,093 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/03/31 |   |
| US T N/B 0.625 03/31/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6250   | 3,200 | 2,856    | 428,894 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/03/31 |   |
| US T N/B 0.5 03/31/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000   | 2,860 | 2,726    | 409,343 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/03/31 |   |
| US T N/B 1.25 03/31/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500   | 4,610 | 4,084    | 613,360 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/03/31 |   |
| US T N/B 0.75 03/31/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500   | 5,720 | 5,290    | 794,463 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/03/31 |   |
| US T N/B 2.375 03/31/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750   | 4,000 | 3,655    | 548,928 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2029/03/31 |   |
| US T N/B 2.5 03/31/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000   | 4,000 | 3,786    | 568,508 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/03/31 |   |
| US T N/B 3.625 03/31/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250   | 3,300 | 3,183    | 478,087 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/03/31 |   |
| US T N/B 1.75 03/15/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500   | 4,000 | 3,868    | 580,908 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/03/15 |   |
| US T N/B 3.625 03/31/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250   | 3,800 | 3,703    | 556,131 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/03/31 |   |
| US T N/B 4.625 03/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6250   | 3,630 | 3,634    | 545,751 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/03/15 |   |
| US T N/B 3.875 03/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750   | 1,050 | 1,038    | 155,949 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/03/31 |   |
| US T N/B 2.875 04/30/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 2,000 | 1,954    | 293,521 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/04/30 |   |
| US T N/B 2.375 04/30/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750   | 2,060 | 1,968    | 295,603 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/04/30 |   |
| US T N/B 1.25 04/30/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500   | 5,100 | 4,508    | 677,014 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/04/30 |   |
| US T N/B 0.5 04/30/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000   | 2,370 | 2,100    | 315,397 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/04/30 |   |
| US T N/B 2.875 04/30/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 3,800 | 3,555    | 533,875 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2029/04/30 |   |
| US T N/B 0.75 04/30/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500   | 6,000 | 5,533    | 830,889 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/04/30 |   |
| US T N/B 3.5 04/30/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000   | 3,100 | 3,005    | 451,331 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/04/30 |   |
| US T N/B 0.375 04/30/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3750   | 2,560 | 2,428    | 364,723 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/04/30 |   |
| US T N/B 2.75 04/30/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 6,000 | 5,713    | 857,953 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2027/04/30 |   |
| US T N/B 3.5 04/30/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000   | 3,000 | 2,873    | 431,413 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/04/30 |   |
| US T N/B 3.75 04/15/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500   | 6,000 | 5,904    | 886,600 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2026/04/15 |   |
| US T N/B 2.625 04/15/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250   | 3,000 | 2,925    | 439,288 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/04/15 |   |
| US T N/B 6.25 05/15/30  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500   | 759   | 839      | 126,116 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2030/05/15 |   |
| US T N/B 4.375 05/15/40 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750   | 1,210 | 1,197    | 179,777 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2040/05/15 |   |
| US T N/B 4.375 05/15/41 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750   | 1,630 | 1,601    | 240,549 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2041/05/15 |   |
| US T N/B 3.0 05/15/42   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000   | 1,080 | 869      | 130,615 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2042/05/15 |   |
| US T N/B 4.25 05/15/39  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500   | 950   | 933      | 140,155 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2039/05/15 |   |
| US T N/B 2.875 05/15/43 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 2,290 | 1,790    | 268,860 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2043/05/15 |   |
| US T N/B 2.375 05/15/51 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750   | 5,560 | 3,696    | 555,136 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2051/05/15 |   |
| US T N/B 3.375 05/15/44 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3750   | 1,430 | 1,201    | 180,401 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2044/05/15 |   |
| US T N/B 3.0 05/15/45   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000   | 1,290 | 1,011    | 151,893 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2045/05/15 |   |
| US T N/B 3.0 05/15/47   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000   | 1,620 | 1,251    | 187,879 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2047/05/15 |   |
| US T N/B 2.875 05/15/52 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 4,510 | 3,346    | 502,453 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2052/05/15 |   |
| US T N/B 2.5 05/15/46   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000   | 1,730 | 1,226    | 184,132 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2046/05/15 |   |
| US T N/B 3.125 05/15/48 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250   | 2,830 | 2,224    | 334,027 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2048/05/15 |   |
| US T N/B 1.125 05/15/40 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250   | 3,300 | 2,015    | 302,659 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2040/05/15 |   |
| US T N/B 2.875 05/15/49 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 4,600 | 3,435    | 515,839 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2049/05/15 |   |
| US T N/B 3.625 05/15/53 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250   | 3,510 | 3,029    | 454,981 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2053/05/15 |   |
| US T N/B 4.5 05/15/38   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000   | 600   | 609      | 91,556  |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2038/05/15 |   |
| US T N/B 2.25 05/15/41  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500   | 4,420 | 3,201    | 480,734 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2041/05/15 |   |
| US T N/B 2.125 05/15/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250   | 3,950 | 3,823    | 574,086 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2025/05/15 |   |
| US T N/B 2.875 05/15/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 4,860 | 4,594    | 689,924 |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | 2028/05/15 |   |

| 銘                       | 柄 | 当 |   |   | 期 |          | 末     |          |       |           |            |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-------------------------|---|---|---|---|---|----------|-------|----------|-------|-----------|------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
|                         |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額        | 面     | 金        | 額     | 外         | 貨          | 建 | 金 | 額 | 邦 | 貨 | 換 | 算 | 金 | 額 | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 |
|                         |   |   |   |   |   |          |       |          |       |           |            |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| (アメリカ)                  |   |   |   |   | % | 千アメリカ・ドル |       | 千アメリカ・ドル |       | 千円        |            |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.375 05/15/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750   | 3,770 | 3,770    | 3,439 | 516,436   | 2029/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.375 05/15/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750   | 4,430 | 4,430    | 4,166 | 625,673   | 2027/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 5.0 05/15/37   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000   | 755   | 755      | 810   | 121,723   | 2037/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.625 05/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250   | 5,170 | 5,170    | 4,856 | 729,232   | 2026/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.25 05/15/50  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500   | 8,380 | 8,380    | 4,185 | 628,531   | 2050/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.125 05/31/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250   | 2,250 | 2,250    | 2,135 | 320,676   | 2026/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.625 05/15/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250   | 8,740 | 8,740    | 7,316 | 1,098,697 | 2031/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.875 05/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 1,570 | 1,570    | 1,532 | 230,147   | 2025/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.25 05/15/42  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500   | 3,760 | 3,760    | 3,143 | 472,092   | 2042/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.875 05/15/43 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750   | 800   | 800      | 728   | 109,316   | 2043/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.875 05/15/32 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 8,050 | 8,050    | 7,264 | 1,090,860 | 2032/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.375 05/15/33 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3750   | 7,500 | 7,500    | 6,979 | 1,048,025 | 2033/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.5 05/31/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000   | 2,980 | 2,980    | 2,632 | 395,230   | 2027/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.25 05/31/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500   | 4,140 | 4,140    | 3,652 | 548,447   | 2028/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.625 05/15/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6250   | 7,050 | 7,050    | 5,653 | 848,990   | 2030/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.625 05/31/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250   | 4,910 | 4,910    | 4,651 | 698,405   | 2027/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.75 05/31/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 3,300 | 3,300    | 3,065 | 460,240   | 2029/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.75 05/31/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500   | 5,630 | 5,630    | 5,177 | 777,521   | 2026/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.625 05/31/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250   | 2,500 | 2,500    | 2,435 | 365,721   | 2028/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.25 05/31/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500   | 1,690 | 1,690    | 1,595 | 239,555   | 2025/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.75 05/31/30  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500   | 3,500 | 3,500    | 3,397 | 510,121   | 2030/05/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.625 05/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.6250   | 3,500 | 3,500    | 3,434 | 515,746   | 2026/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.75 05/15/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 2,200 | 2,200    | 2,145 | 322,144   | 2025/05/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.75 06/30/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 1,040 | 1,040    | 1,012 | 152,073   | 2025/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.875 06/30/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750   | 2,880 | 2,880    | 2,715 | 407,729   | 2026/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.5 06/30/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000   | 2,780 | 2,780    | 2,448 | 367,718   | 2027/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.25 06/30/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500   | 3,710 | 3,710    | 3,265 | 490,340   | 2028/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.25 06/30/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500   | 3,500 | 3,500    | 3,293 | 494,529   | 2025/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.25 06/30/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500   | 4,200 | 4,200    | 4,057 | 609,214   | 2027/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.875 06/30/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8750   | 4,510 | 4,510    | 4,152 | 623,586   | 2026/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.25 06/30/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500   | 3,500 | 3,500    | 3,329 | 500,000   | 2029/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.875 06/15/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 2,420 | 2,420    | 2,361 | 354,536   | 2025/06/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 4.0 06/30/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000   | 2,000 | 2,000    | 1,977 | 296,906   | 2028/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 4.125 06/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1250   | 4,700 | 4,700    | 4,661 | 700,031   | 2026/06/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.75 06/30/30  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500   | 5,700 | 5,700    | 5,531 | 830,535   | 2030/06/30 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.875 07/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750   | 2,200 | 2,200    | 2,143 | 321,828   | 2025/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.875 07/31/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750   | 2,500 | 2,500    | 2,352 | 353,183   | 2026/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 1.0 07/31/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000   | 9,270 | 9,270    | 8,049 | 1,208,687 | 2028/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.375 07/31/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3750   | 3,780 | 3,780    | 3,304 | 496,221   | 2027/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 4.0 07/31/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000   | 2,500 | 2,500    | 2,459 | 369,343   | 2030/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.25 07/31/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500   | 3,800 | 3,800    | 3,563 | 535,067   | 2025/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.625 07/31/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250   | 3,070 | 3,070    | 2,827 | 424,508   | 2029/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 4.125 07/31/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1250   | 2,500 | 2,500    | 2,484 | 373,061   | 2028/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 0.625 07/31/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6250   | 5,100 | 5,100    | 4,651 | 698,507   | 2026/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.75 07/31/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 3,820 | 3,820    | 3,625 | 544,426   | 2027/07/31 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.0 07/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000   | 3,200 | 3,200    | 3,124 | 469,137   | 2025/07/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 4.5 07/15/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000   | 4,100 | 4,100    | 4,102 | 615,956   | 2026/07/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.75 08/15/41  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500   | 1,220 | 1,220    | 1,105 | 165,966   | 2041/08/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.875 08/15/40 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750   | 1,290 | 1,290    | 1,198 | 179,897   | 2040/08/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 2.75 08/15/42  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500   | 1,240 | 1,240    | 957   | 143,852   | 2042/08/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| US T N/B 3.125 08/15/44 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250   | 2,090 | 2,090    | 1,684 | 252,930   | 2044/08/15 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |

| 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 |            |
| (アメリカ)                  |         | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,480    | 1,492     | 224,181     | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国 債 証 券 | 3.6250 | 1,470    | 1,287     | 193,397     | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/51   | 国 債 証 券 | 2.0000 | 5,810    | 3,522     | 528,927     | 2051/08/15 |
| US T N/B 4.125 08/15/53 | 国 債 証 券 | 4.1250 | 1,600    | 1,512     | 227,173     | 2053/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国 債 証 券 | 2.8750 | 1,770    | 1,355     | 203,495     | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25   | 国 債 証 券 | 2.0000 | 3,550    | 3,411     | 512,338     | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47  | 国 債 証 券 | 2.7500 | 2,230    | 1,640     | 246,263     | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49  | 国 債 証 券 | 2.2500 | 4,140    | 2,705     | 406,314     | 2049/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/52   | 国 債 証 券 | 3.0000 | 5,540    | 4,220     | 633,695     | 2052/08/15 |
| US T N/B 4.375 08/15/43 | 国 債 証 券 | 4.3750 | 2,000    | 1,948     | 292,647     | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46  | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,270    | 1,526     | 229,150     | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48   | 国 債 証 券 | 3.0000 | 3,810    | 2,922     | 438,881     | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27  | 国 債 証 券 | 2.2500 | 4,240    | 3,955     | 593,938     | 2027/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 7,030    | 6,545     | 982,844     | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国 債 証 券 | 2.8750 | 5,030    | 4,742     | 712,199     | 2028/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25  | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,830    | 1,777     | 266,844     | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国 債 証 券 | 1.6250 | 3,360    | 2,938     | 441,214     | 2029/08/15 |
| US T N/B 3.375 08/15/42 | 国 債 証 券 | 3.3750 | 2,920    | 2,482     | 372,739     | 2042/08/15 |
| US T N/B 1.75 08/15/41  | 国 債 証 券 | 1.7500 | 5,310    | 3,510     | 527,153     | 2041/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国 債 証 券 | 1.1250 | 4,060    | 2,456     | 368,814     | 2040/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 国 債 証 券 | 1.3750 | 6,870    | 3,546     | 532,522     | 2050/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/32  | 国 債 証 券 | 2.7500 | 7,840    | 6,984     | 1,048,768   | 2032/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/33 | 国 債 証 券 | 3.8750 | 8,000    | 7,742     | 1,162,613   | 2033/08/15 |
| US T N/B 1.25 08/15/31  | 国 債 証 券 | 1.2500 | 8,960    | 7,241     | 1,087,383   | 2031/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国 債 証 券 | 0.6250 | 7,740    | 6,153     | 923,979     | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,800    | 2,596     | 389,899     | 2026/08/31 |
| US T N/B 0.25 08/31/25  | 国 債 証 券 | 0.2500 | 3,590    | 3,354     | 503,781     | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 国 債 証 券 | 1.1250 | 3,730    | 3,249     | 488,017     | 2028/08/31 |
| US T N/B 0.5 08/31/27   | 国 債 証 券 | 0.5000 | 3,060    | 2,680     | 402,439     | 2027/08/31 |
| US T N/B 0.75 08/31/26  | 国 債 証 券 | 0.7500 | 4,950    | 4,517     | 678,384     | 2026/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/15/25 | 国 債 証 券 | 3.1250 | 3,030    | 2,960     | 444,578     | 2025/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/31/29 | 国 債 証 券 | 3.1250 | 3,110    | 2,935     | 440,838     | 2029/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/31/27 | 国 債 証 券 | 3.1250 | 3,940    | 3,783     | 568,138     | 2027/08/31 |
| US T N/B 4.375 08/15/26 | 国 債 証 券 | 4.3750 | 4,000    | 3,991     | 599,431     | 2026/08/15 |
| US T N/B 3.0 09/30/25   | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,750    | 1,703     | 255,861     | 2025/09/30 |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国 債 証 券 | 0.3750 | 3,810    | 3,312     | 497,388     | 2027/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/30/30 | 国 債 証 券 | 4.6250 | 3,000    | 3,057     | 459,067     | 2030/09/30 |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国 債 証 券 | 1.6250 | 1,550    | 1,444     | 216,919     | 2026/09/30 |
| US T N/B 1.25 09/30/28  | 国 債 証 券 | 1.2500 | 4,980    | 4,354     | 653,898     | 2028/09/30 |
| US T N/B 0.25 09/30/25  | 国 債 証 券 | 0.2500 | 3,720    | 3,465     | 520,399     | 2025/09/30 |
| US T N/B 4.125 09/30/27 | 国 債 証 券 | 4.1250 | 3,220    | 3,197     | 480,106     | 2027/09/30 |
| US T N/B 0.875 09/30/26 | 国 債 証 券 | 0.8750 | 5,510    | 5,036     | 756,246     | 2026/09/30 |
| US T N/B 3.5 09/15/25   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 3,000    | 2,944     | 442,183     | 2025/09/15 |
| US T N/B 3.875 09/30/29 | 国 債 証 券 | 3.8750 | 4,550    | 4,459     | 669,563     | 2029/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/15/26 | 国 債 証 券 | 4.6250 | 3,500    | 3,514     | 527,756     | 2026/09/15 |
| US T N/B 3.0 10/31/25   | 国 債 証 券 | 3.0000 | 2,270    | 2,208     | 331,602     | 2025/10/31 |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国 債 証 券 | 1.6250 | 2,410    | 2,240     | 336,454     | 2026/10/31 |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 国 債 証 券 | 1.3750 | 4,710    | 4,134     | 620,794     | 2028/10/31 |
| US T N/B 0.5 10/31/27   | 国 債 証 券 | 0.5000 | 3,660    | 3,187     | 478,590     | 2027/10/31 |
| US T N/B 1.125 10/31/26 | 国 債 証 券 | 1.1250 | 4,490    | 4,118     | 618,411     | 2026/10/31 |
| US T N/B 4.0 10/31/29   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,700    | 2,662     | 399,730     | 2029/10/31 |

| 銘                       | 柄 | 当 |   |   | 期 |        | 末 |       |   |   |   |   |   |       |   |   |   |   |   |   |   |           |   |   |   |  |            |  |
|-------------------------|---|---|---|---|---|--------|---|-------|---|---|---|---|---|-------|---|---|---|---|---|---|---|-----------|---|---|---|--|------------|--|
|                         |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額      | 面 | 金     | 額 | 外 | 貨 | 建 | 金 | 額     | 邦 | 貨 | 換 | 算 | 金 | 額 | 償 | 還         | 年 | 月 | 日 |  |            |  |
|                         |   |   |   |   |   |        |   |       |   |   |   |   |   |       |   |   |   |   |   |   |   |           |   |   |   |  |            |  |
| (アメリカ)                  |   |   |   |   | % | 千      | ア | メ     | リ | カ | ・ | ド | ル | 千     | ア | メ | リ | カ | ・ | ド | ル | 千         | 円 |   |   |  |            |  |
| US T N/B 4.125 10/31/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1250 |   | 3,340 |   |   |   |   |   | 3,315 |   |   |   |   |   |   |   | 497,919   |   |   |   |  | 2027/10/31 |  |
| US T N/B 0.25 10/31/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 |   | 4,000 |   |   |   |   |   | 3,714 |   |   |   |   |   |   |   | 557,809   |   |   |   |  | 2025/10/31 |  |
| US T N/B 4.625 10/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6250 |   | 3,400 |   |   |   |   |   | 3,415 |   |   |   |   |   |   |   | 512,877   |   |   |   |  | 2026/10/15 |  |
| US T N/B 4.25 10/15/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 |   | 4,000 |   |   |   |   |   | 3,972 |   |   |   |   |   |   |   | 596,451   |   |   |   |  | 2025/10/15 |  |
| US T N/B 5.25 11/15/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.2500 |   | 1,350 |   |   |   |   |   | 1,406 |   |   |   |   |   |   |   | 211,165   |   |   |   |  | 2028/11/15 |  |
| US T N/B 6.125 11/15/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.1250 |   | 2,200 |   |   |   |   |   | 2,334 |   |   |   |   |   |   |   | 350,598   |   |   |   |  | 2027/11/15 |  |
| US T N/B 3.0 11/15/44   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 |   | 1,960 |   |   |   |   |   | 1,543 |   |   |   |   |   |   |   | 231,777   |   |   |   |  | 2044/11/15 |  |
| US T N/B 4.25 11/15/40  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 |   | 1,300 |   |   |   |   |   | 1,261 |   |   |   |   |   |   |   | 189,496   |   |   |   |  | 2040/11/15 |  |
| US T N/B 2.75 11/15/42  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 |   | 1,556 |   |   |   |   |   | 1,197 |   |   |   |   |   |   |   | 179,882   |   |   |   |  | 2042/11/15 |  |
| US T N/B 3.125 11/15/41 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 |   | 1,020 |   |   |   |   |   | 843   |   |   |   |   |   |   |   | 126,592   |   |   |   |  | 2041/11/15 |  |
| US T N/B 3.75 11/15/43  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 |   | 1,460 |   |   |   |   |   | 1,300 |   |   |   |   |   |   |   | 195,336   |   |   |   |  | 2043/11/15 |  |
| US T N/B 2.75 11/15/47  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 |   | 2,250 |   |   |   |   |   | 1,652 |   |   |   |   |   |   |   | 248,089   |   |   |   |  | 2047/11/15 |  |
| US T N/B 1.625 11/15/50 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 |   | 5,280 |   |   |   |   |   | 2,917 |   |   |   |   |   |   |   | 438,077   |   |   |   |  | 2050/11/15 |  |
| US T N/B 1.875 11/15/51 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 |   | 5,370 |   |   |   |   |   | 3,146 |   |   |   |   |   |   |   | 472,444   |   |   |   |  | 2051/11/15 |  |
| US T N/B 4.0 11/15/52   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 |   | 4,860 |   |   |   |   |   | 4,492 |   |   |   |   |   |   |   | 674,588   |   |   |   |  | 2052/11/15 |  |
| US T N/B 3.0 11/15/45   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 |   | 460   |   |   |   |   |   | 359   |   |   |   |   |   |   |   | 53,947    |   |   |   |  | 2045/11/15 |  |
| US T N/B 2.875 11/15/46 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 |   | 1,080 |   |   |   |   |   | 818   |   |   |   |   |   |   |   | 122,902   |   |   |   |  | 2046/11/15 |  |
| US T N/B 4.375 11/15/39 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750 |   | 1,000 |   |   |   |   |   | 992   |   |   |   |   |   |   |   | 149,086   |   |   |   |  | 2039/11/15 |  |
| US T N/B 3.375 11/15/48 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3750 |   | 3,450 |   |   |   |   |   | 2,834 |   |   |   |   |   |   |   | 425,581   |   |   |   |  | 2048/11/15 |  |
| US T N/B 2.375 11/15/49 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 |   | 3,690 |   |   |   |   |   | 2,478 |   |   |   |   |   |   |   | 372,127   |   |   |   |  | 2049/11/15 |  |
| US T N/B 2.25 11/15/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 |   | 5,120 |   |   |   |   |   | 4,916 |   |   |   |   |   |   |   | 738,276   |   |   |   |  | 2025/11/15 |  |
| US T N/B 3.125 11/15/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 |   | 5,480 |   |   |   |   |   | 5,213 |   |   |   |   |   |   |   | 782,857   |   |   |   |  | 2028/11/15 |  |
| US T N/B 2.0 11/15/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 |   | 7,830 |   |   |   |   |   | 7,347 |   |   |   |   |   |   |   | 1,103,278 |   |   |   |  | 2026/11/15 |  |
| US T N/B 2.25 11/15/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 |   | 3,270 |   |   |   |   |   | 3,038 |   |   |   |   |   |   |   | 456,239   |   |   |   |  | 2027/11/15 |  |
| US T N/B 2.875 11/30/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 |   | 3,360 |   |   |   |   |   | 3,259 |   |   |   |   |   |   |   | 489,371   |   |   |   |  | 2025/11/30 |  |
| US T N/B 4.0 11/15/42   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 |   | 3,120 |   |   |   |   |   | 2,895 |   |   |   |   |   |   |   | 434,789   |   |   |   |  | 2042/11/15 |  |
| US T N/B 1.375 11/15/40 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 |   | 4,320 |   |   |   |   |   | 2,717 |   |   |   |   |   |   |   | 408,105   |   |   |   |  | 2040/11/15 |  |
| US T N/B 4.75 11/15/43  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 |   | 500   |   |   |   |   |   | 512   |   |   |   |   |   |   |   | 76,927    |   |   |   |  | 2043/11/15 |  |
| US T N/B 2.0 11/15/41   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 |   | 4,250 |   |   |   |   |   | 2,923 |   |   |   |   |   |   |   | 438,985   |   |   |   |  | 2041/11/15 |  |
| US T N/B 1.625 11/30/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 |   | 1,810 |   |   |   |   |   | 1,680 |   |   |   |   |   |   |   | 252,318   |   |   |   |  | 2026/11/30 |  |
| US T N/B 4.125 11/15/32 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1250 |   | 7,600 |   |   |   |   |   | 7,507 |   |   |   |   |   |   |   | 1,127,285 |   |   |   |  | 2032/11/15 |  |
| US T N/B 1.75 11/15/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 |   | 2,850 |   |   |   |   |   | 2,497 |   |   |   |   |   |   |   | 375,063   |   |   |   |  | 2029/11/15 |  |
| US T N/B 4.5 11/15/33   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 |   | 2,000 |   |   |   |   |   | 2,033 |   |   |   |   |   |   |   | 305,294   |   |   |   |  | 2033/11/15 |  |
| US T N/B 1.375 11/15/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 |   | 8,590 |   |   |   |   |   | 6,959 |   |   |   |   |   |   |   | 1,044,999 |   |   |   |  | 2031/11/15 |  |
| US T N/B 0.875 11/15/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8750 |   | 9,480 |   |   |   |   |   | 7,624 |   |   |   |   |   |   |   | 1,144,902 |   |   |   |  | 2030/11/15 |  |
| US T N/B 0.625 11/30/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6250 |   | 3,900 |   |   |   |   |   | 3,403 |   |   |   |   |   |   |   | 511,082   |   |   |   |  | 2027/11/30 |  |
| US T N/B 1.25 11/30/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 |   | 4,700 |   |   |   |   |   | 4,317 |   |   |   |   |   |   |   | 648,244   |   |   |   |  | 2026/11/30 |  |
| US T N/B 1.5 11/30/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 |   | 5,000 |   |   |   |   |   | 4,406 |   |   |   |   |   |   |   | 661,701   |   |   |   |  | 2028/11/30 |  |
| US T N/B 0.375 11/30/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3750 |   | 5,190 |   |   |   |   |   | 4,815 |   |   |   |   |   |   |   | 723,118   |   |   |   |  | 2025/11/30 |  |
| US T N/B 3.875 11/30/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 |   | 2,800 |   |   |   |   |   | 2,742 |   |   |   |   |   |   |   | 411,825   |   |   |   |  | 2029/11/30 |  |
| US T N/B 3.875 11/30/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 |   | 3,300 |   |   |   |   |   | 3,248 |   |   |   |   |   |   |   | 487,727   |   |   |   |  | 2027/11/30 |  |
| US T N/B 4.5 11/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 |   | 3,570 |   |   |   |   |   | 3,559 |   |   |   |   |   |   |   | 534,542   |   |   |   |  | 2025/11/15 |  |
| US T N/B 4.625 11/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6250 |   | 3,900 |   |   |   |   |   | 3,919 |   |   |   |   |   |   |   | 588,620   |   |   |   |  | 2026/11/15 |  |
| US T N/B 2.625 12/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 |   | 3,000 |   |   |   |   |   | 2,894 |   |   |   |   |   |   |   | 434,704   |   |   |   |  | 2025/12/31 |  |
| US T N/B 1.75 12/31/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 |   | 2,110 |   |   |   |   |   | 1,962 |   |   |   |   |   |   |   | 294,640   |   |   |   |  | 2026/12/31 |  |
| US T N/B 1.25 12/31/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 |   | 3,890 |   |   |   |   |   | 3,566 |   |   |   |   |   |   |   | 535,578   |   |   |   |  | 2026/12/31 |  |
| US T N/B 1.375 12/31/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 |   | 4,600 |   |   |   |   |   | 4,022 |   |   |   |   |   |   |   | 603,948   |   |   |   |  | 2028/12/31 |  |
| US T N/B 0.375 12/31/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3750 |   | 4,000 |   |   |   |   |   | 3,701 |   |   |   |   |   |   |   | 555,861   |   |   |   |  | 2025/12/31 |  |
| US T N/B 3.875 12/31/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 |   | 2,800 |   |   |   |   |   | 2,741 |   |   |   |   |   |   |   | 411,628   |   |   |   |  | 2029/12/31 |  |
| US T N/B 0.625 12/31/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6250 |   | 4,020 |   |   |   |   |   | 3,497 |   |   |   |   |   |   |   | 525,216   |   |   |   |  | 2027/12/31 |  |
| US T N/B 4.375 12/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750 |   | 4,800 |   |   |   |   |   | 4,796 |   |   |   |   |   |   |   | 720,289   |   |   |   |  | 2026/12/15 |  |

| 銘                        | 柄 | 当 |   |   | 期 |             | 末           |             |         |            |   |   |       |
|--------------------------|---|---|---|---|---|-------------|-------------|-------------|---------|------------|---|---|-------|
|                          |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額           | 面           | 金           | 額       | 評          | 価 | 額 | 償還年月日 |
|                          |   |   |   |   |   |             |             |             |         |            |   |   |       |
| (アメリカ)                   |   |   |   |   | % | 千アメリカ・ドル    | 千アメリカ・ドル    | 千円          |         |            |   |   |       |
| US T N/B 4.0 12/15/25    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000      | 4,140       | 4,093       | 614,692 | 2025/12/15 |   |   |       |
| US T N/B 3.875 12/31/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750      | 4,600       | 4,527       | 679,794 | 2027/12/31 |   |   |       |
| 小計                       |   | — |   | — |   | 916,450     | 810,479     | 121,701,636 | —       |            |   |   |       |
| (カナダ)                    |   |   |   |   | % | 千カナダ・ドル     | 千カナダ・ドル     | 千円          |         |            |   |   |       |
| CANADA 3.75 02/01/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500      | 1,160       | 1,150       | 127,675 | 2025/02/01 |   |   |       |
| CANADA 1.25 03/01/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500      | 700         | 676         | 75,148  | 2025/03/01 |   |   |       |
| CANADA 0.25 03/01/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500      | 1,410       | 1,306       | 145,062 | 2026/03/01 |   |   |       |
| CANADA 1.25 03/01/27     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500      | 910         | 844         | 93,769  | 2027/03/01 |   |   |       |
| CANADA 3.5 03/01/28      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000      | 1,630       | 1,619       | 179,792 | 2028/03/01 |   |   |       |
| CANADA 3.0 04/01/26      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000      | 1,400       | 1,370       | 152,122 | 2026/04/01 |   |   |       |
| CANADA 1.5 04/01/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000      | 1,100       | 1,063       | 118,083 | 2025/04/01 |   |   |       |
| CANADA 1.5 06/01/26      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000      | 1,700       | 1,608       | 178,594 | 2026/06/01 |   |   |       |
| CANADA 5.75 06/01/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500      | 740         | 818         | 90,862  | 2029/06/01 |   |   |       |
| CANADA 5.75 06/01/33     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500      | 610         | 716         | 79,595  | 2033/06/01 |   |   |       |
| CANADA 5.0 06/01/37      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000      | 630         | 728         | 80,894  | 2037/06/01 |   |   |       |
| CANADA 4.0 06/01/41      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000      | 740         | 790         | 87,730  | 2041/06/01 |   |   |       |
| CANADA 2.0 06/01/28      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000      | 930         | 871         | 96,783  | 2028/06/01 |   |   |       |
| CANADA 2.25 06/01/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500      | 1,320       | 1,283       | 142,538 | 2025/06/01 |   |   |       |
| CANADA 1.0 06/01/27      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000      | 550         | 504         | 56,015  | 2027/06/01 |   |   |       |
| CANADA 2.25 06/01/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500      | 530         | 498         | 55,311  | 2029/06/01 |   |   |       |
| CANADA 1.25 06/01/30     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500      | 2,350       | 2,051       | 227,786 | 2030/06/01 |   |   |       |
| CANADA 2.75 06/01/33     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 1,180       | 1,109       | 123,221 | 2033/06/01 |   |   |       |
| CANADA 1.5 06/01/31      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000      | 2,470       | 2,151       | 238,845 | 2031/06/01 |   |   |       |
| CANADA 2.0 06/01/32      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000      | 1,590       | 1,417       | 157,375 | 2032/06/01 |   |   |       |
| CANADA 3.5 08/01/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000      | 400         | 394         | 43,835  | 2025/08/01 |   |   |       |
| CANADA 0.5 09/01/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000      | 2,310       | 2,180       | 242,092 | 2025/09/01 |   |   |       |
| CANADA 2.75 09/01/27     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 1,050       | 1,015       | 112,775 | 2027/09/01 |   |   |       |
| CANADA 1.0 09/01/26      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000      | 2,670       | 2,484       | 275,819 | 2026/09/01 |   |   |       |
| CANADA 3.25 09/01/28     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500      | 1,200       | 1,181       | 131,149 | 2028/09/01 |   |   |       |
| CANADA 3.0 10/01/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000      | 1,660       | 1,625       | 180,456 | 2025/10/01 |   |   |       |
| CANADA 3.5 12/01/45      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000      | 800         | 806         | 89,588  | 2045/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.75 12/01/48     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 850         | 756         | 83,977  | 2048/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.0 12/01/51      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000      | 3,460       | 2,590       | 287,617 | 2051/12/01 |   |   |       |
| CANADA 1.75 12/01/53     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500      | 2,180       | 1,515       | 168,246 | 2053/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.75 12/01/64     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 390         | 339         | 37,706  | 2064/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.75 12/01/55     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 300         | 263         | 29,268  | 2055/12/01 |   |   |       |
| CANADA 3.25 12/01/33     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500      | 2,100       | 2,056       | 228,316 | 2033/12/01 |   |   |       |
| CANADA 0.5 12/01/30      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000      | 2,600       | 2,132       | 236,789 | 2030/12/01 |   |   |       |
| CANADA 1.5 12/01/31      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000      | 2,420       | 2,089       | 231,956 | 2031/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.5 12/01/32      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000      | 1,520       | 1,403       | 155,853 | 2032/12/01 |   |   |       |
| CANADA 2.25 12/01/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500      | 700         | 655         | 72,741  | 2029/12/01 |   |   |       |
| 小計                       |   | — |   | — |   | 50,260      | 46,076      | 5,115,401   | —       |            |   |   |       |
| (オーストラリア)                |   |   |   |   | % | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円          |         |            |   |   |       |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000      | 1,090       | 849         | 83,589  | 2047/03/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500      | 1,100       | 1,090       | 107,360 | 2025/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500      | 1,540       | 1,585       | 156,040 | 2027/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500      | 1,600       | 1,615       | 158,958 | 2026/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500      | 1,400       | 1,362       | 134,035 | 2029/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000      | 1,660       | 1,702       | 167,580 | 2033/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500      | 830         | 783         | 77,150  | 2037/04/21 |   |   |       |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500      | 1,780       | 1,674       | 164,777 | 2028/05/21 |   |   |       |

| 銘                         | 柄 | 当 |   |   | 期      |        | 末           |        |             |           |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
|---------------------------|---|---|---|---|--------|--------|-------------|--------|-------------|-----------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|--|--|
|                           |   | 種 | 類 | 利 | 率      | 額      | 面           | 金      | 額           | 外         | 貨 | 建 | 金 | 額 | 邦 | 貨 | 換 | 算 | 金 | 額 | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 |  |  |
|                           |   |   |   |   |        |        |             |        |             |           |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| (オーストラリア)                 |   |   |   |   | %      | 千      | オーストラリア・ドル  | 千      | オーストラリア・ドル  | 千         | 円 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 1,660  |             | 1,529  |             | 150,519   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 960    |             | 762    |             | 75,080    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 2,130  |             | 1,706  |             | 167,951   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34  | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 1,800  |             | 1,734  |             | 170,694   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39  | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | 820    |             | 716    |             | 70,462    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 2,010  |             | 1,689  |             | 166,222   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 650    |             | 563    |             | 55,483    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 2,520  |             | 1,420  |             | 139,792   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 0.5 09/21/26   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 2,615  |             | 2,408  |             | 237,000   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 450    |             | 429    |             | 42,287    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 1,430  |             | 1,380  |             | 135,820   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 1,400  |             | 1,319  |             | 129,819   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 1,670  |             | 1,513  |             | 148,951   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/32  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 1,850  |             | 1,527  |             | 150,297   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 2,470  |             | 1,969  |             | 193,799   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/25  | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 1,460  |             | 1,372  |             | 135,065   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 1,670  |             | 1,374  |             | 135,234   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 1,500  |             | 1,407  |             | 138,513   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| 小                         | 計 | — | — | — | —      | 40,065 |             | 35,489 |             | 3,492,489 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| (シンガポール)                  |   |   |   |   | %      | 千      | シンガポール・ドル   | 千      | シンガポール・ドル   | 千         | 円 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27    | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 800    |             | 810    |             | 90,501    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 460    |             | 441    |             | 49,339    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 | 840    |             | 672    |             | 75,082    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 660    |             | 636    |             | 71,104    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 | 340    |             | 334    |             | 37,399    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 | 780    |             | 769    |             | 85,999    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250 | 590    |             | 576    |             | 64,404    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 640    |             | 635    |             | 70,970    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 | 190    |             | 174    |             | 19,487    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 1.625 07/01/31  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 | 840    |             | 760    |             | 84,946    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 3.0 08/01/72    | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 125    |             | 127    |             | 14,224    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 | 890    |             | 816    |             | 91,260    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 620    |             | 613    |             | 68,510    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33  | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3750 | 580    |             | 594    |             | 66,424    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 2.875 09/01/27  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 200    |             | 198    |             | 22,223    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 1.875 10/01/51  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 | 510    |             | 409    |             | 45,725    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 1.25 11/01/26   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 510    |             | 485    |             | 54,281    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| SINGAPORE 0.5 11/01/25    | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 280    |             | 267    |             | 29,842    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| 小                         | 計 | — | — | — | —      | 9,855  |             | 9,323  |             | 1,041,728 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| (ニュージーランド)                |   |   |   |   | %      | 千      | ニュージーランド・ドル | 千      | ニュージーランド・ドル | 千         | 円 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 4.5 04/15/27  | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 800    |             | 793    |             | 73,529    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33  | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 450    |             | 406    |             | 37,662    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 810    |             | 635    |             | 58,902    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 670    |             | 650    |             | 60,235    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29  | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 750    |             | 693    |             | 64,206    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 540    |             | 355    |             | 32,892    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 400    |             | 247    |             | 22,932    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31  | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 880    |             | 706    |             | 65,439    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 4.25 05/15/34 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 130    |             | 123    |             | 11,456    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32  | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 910    |             | 739    |             | 68,519    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 650    |             | 540    |             | 50,074    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |  |  |

| 銘<br>柄                     | 種<br>類 | 利<br>率 | 額<br>面<br>金<br>額 | 期<br>評<br>価<br>額 |         | 未<br>償<br>還<br>年<br>月<br>日 |
|----------------------------|--------|--------|------------------|------------------|---------|----------------------------|
|                            |        |        |                  | 外貨建金額 邦貨換算金額     |         |                            |
|                            |        |        |                  |                  |         |                            |
| (ニュージーランド)                 |        | %      | 千ニュージーランド・ドル     | 千ニュージーランド・ドル     | 千円      |                            |
| NEW ZEALAND 0.5 05/15/26   | 国債証券   | 0.5000 | 580              | 526              | 48,766  | 2026/05/15                 |
| 小計                         | —      | —      | 7,570            | 6,419            | 594,617 | —                          |
| (イギリス)                     |        | %      | 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 | 1,640            | 1,356            | 257,233 | 2044/01/22                 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45   | 国債証券   | 3.5000 | 1,550            | 1,324            | 251,087 | 2045/01/22                 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60   | 国債証券   | 4.0000 | 900              | 816              | 154,822 | 2060/01/22                 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49  | 国債証券   | 1.7500 | 1,130            | 658              | 124,799 | 2049/01/22                 |
| UK TREASURY 3.75 01/29/38  | 国債証券   | 3.7500 | 1,650            | 1,543            | 292,668 | 2038/01/29                 |
| UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 国債証券   | 0.8750 | 1,350            | 664              | 125,901 | 2046/01/31                 |
| UK TREASURY 1.125 01/31/39 | 国債証券   | 1.1250 | 2,110            | 1,354            | 256,764 | 2039/01/31                 |
| UK TREASURY 4.625 01/31/34 | 国債証券   | 4.6250 | 400              | 416              | 78,930  | 2034/01/31                 |
| UK TREASURY 1.0 01/31/32   | 国債証券   | 1.0000 | 2,470            | 1,970            | 373,512 | 2032/01/31                 |
| UK TREASURY 3.25 01/31/33  | 国債証券   | 3.2500 | 2,500            | 2,351            | 445,707 | 2033/01/31                 |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29   | 国債証券   | 0.5000 | 1,880            | 1,590            | 301,513 | 2029/01/31                 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 国債証券   | 0.1250 | 1,340            | 1,152            | 218,484 | 2028/01/31                 |
| UK TREASURY 0.25 01/31/25  | 国債証券   | 0.2500 | 1,700            | 1,630            | 309,123 | 2025/01/31                 |
| UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 国債証券   | 0.1250 | 1,750            | 1,617            | 306,579 | 2026/01/30                 |
| UK TREASURY 4.125 01/29/27 | 国債証券   | 4.1250 | 2,340            | 2,334            | 442,643 | 2027/01/29                 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25   | 国債証券   | 5.0000 | 1,485            | 1,488            | 282,244 | 2025/03/07                 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36  | 国債証券   | 4.2500 | 1,300            | 1,302            | 246,995 | 2036/03/07                 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32  | 国債証券   | 4.2500 | 1,770            | 1,804            | 342,006 | 2032/06/07                 |
| UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 国債証券   | 0.6250 | 1,060            | 1,008            | 191,181 | 2025/06/07                 |
| UK TREASURY 4.5 06/07/28   | 国債証券   | 4.5000 | 1,750            | 1,779            | 337,300 | 2028/06/07                 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47   | 国債証券   | 1.5000 | 1,200            | 671              | 127,395 | 2047/07/22                 |
| UK TREASURY 1.25 07/31/51  | 国債証券   | 1.2500 | 1,730            | 839              | 159,095 | 2051/07/31                 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52  | 国債証券   | 3.7500 | 970              | 841              | 159,613 | 2052/07/22                 |
| UK TREASURY 1.5 07/31/53   | 国債証券   | 1.5000 | 1,210            | 612              | 116,163 | 2053/07/31                 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57  | 国債証券   | 1.7500 | 1,260            | 664              | 125,977 | 2057/07/22                 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65   | 国債証券   | 2.5000 | 1,250            | 790              | 149,810 | 2065/07/22                 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68   | 国債証券   | 3.5000 | 1,480            | 1,209            | 229,224 | 2068/07/22                 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26   | 国債証券   | 1.5000 | 1,900            | 1,785            | 338,431 | 2026/07/22                 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27  | 国債証券   | 1.2500 | 1,100            | 1,002            | 190,046 | 2027/07/22                 |
| UK TREASURY 0.875 07/31/33 | 国債証券   | 0.8750 | 2,100            | 1,577            | 299,050 | 2033/07/31                 |
| UK TREASURY 0.25 07/31/31  | 国債証券   | 0.2500 | 2,240            | 1,707            | 323,797 | 2031/07/31                 |
| UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 国債証券   | 0.6250 | 1,650            | 1,119            | 212,208 | 2035/07/31                 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39  | 国債証券   | 4.2500 | 1,060            | 1,037            | 196,777 | 2039/09/07                 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25   | 国債証券   | 2.0000 | 1,110            | 1,069            | 202,679 | 2025/09/07                 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34   | 国債証券   | 4.5000 | 1,200            | 1,235            | 234,298 | 2034/09/07                 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37  | 国債証券   | 1.7500 | 1,890            | 1,394            | 264,361 | 2037/09/07                 |
| UK TREASURY 3.75 10/22/53  | 国債証券   | 3.7500 | 1,800            | 1,553            | 294,531 | 2053/10/22                 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券   | 1.6250 | 1,270            | 659              | 124,953 | 2054/10/22                 |
| UK TREASURY 0.5 10/22/61   | 国債証券   | 0.5000 | 1,880            | 553              | 105,010 | 2061/10/22                 |
| UK TREASURY 4.0 10/22/63   | 国債証券   | 4.0000 | 820              | 741              | 140,616 | 2063/10/22                 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券   | 1.6250 | 830              | 380              | 72,117  | 2071/10/22                 |
| UK TREASURY 1.125 10/22/73 | 国債証券   | 1.1250 | 740              | 267              | 50,729  | 2073/10/22                 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41  | 国債証券   | 1.2500 | 1,750            | 1,062            | 201,452 | 2041/10/22                 |
| UK TREASURY 0.625 10/22/50 | 国債証券   | 0.6250 | 1,640            | 653              | 123,948 | 2050/10/22                 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券   | 1.6250 | 1,030            | 929              | 176,235 | 2028/10/22                 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券   | 0.8750 | 1,430            | 1,211            | 229,594 | 2029/10/22                 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/30 | 国債証券   | 0.3750 | 1,390            | 1,103            | 209,195 | 2030/10/22                 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/26 | 国債証券   | 0.3750 | 2,430            | 2,199            | 417,048 | 2026/10/22                 |

| 銘<br>柄                          | 種<br>類 | 利<br>率 | 額<br>面<br>金<br>額      | 期<br>評<br>価<br>額      |               | 末          |
|---------------------------------|--------|--------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------|
|                                 |        |        |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額        | 償還年月日      |
|                                 |        |        |                       |                       |               |            |
| (イギリス)                          |        |        |                       |                       |               |            |
| UK TREASURY 3.5 10/22/25        | 国債証券   | 3.5000 | 千イギリス・ポンド<br>1,500    | 千イギリス・ポンド<br>1,475    | 千円<br>279,692 | 2025/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28        | 国債証券   | 6.0000 | 980                   | 1,066                 | 202,208       | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38       | 国債証券   | 4.7500 | 1,380                 | 1,433                 | 271,745       | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42        | 国債証券   | 4.5000 | 1,745                 | 1,738                 | 329,574       | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46       | 国債証券   | 4.2500 | 1,280                 | 1,217                 | 230,757       | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55       | 国債証券   | 4.2500 | 1,112                 | 1,051                 | 199,340       | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27       | 国債証券   | 4.2500 | 1,310                 | 1,318                 | 249,993       | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40       | 国債証券   | 4.2500 | 1,770                 | 1,722                 | 326,463       | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30       | 国債証券   | 4.7500 | 1,495                 | 1,566                 | 297,060       | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49       | 国債証券   | 4.2500 | 1,317                 | 1,247                 | 236,498       | 2049/12/07 |
| 小計                              | —      | —      | 86,324                | 70,878                | 13,437,202    | —          |
| (イスラエル)                         |        |        |                       |                       |               |            |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42  | 国債証券   | 5.5000 | 千イスラエル・シェケル<br>1,410  | 千イスラエル・シェケル<br>1,557  | 千円<br>63,474  | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26  | 国債証券   | 0.5000 | 1,430                 | 1,340                 | 54,621        | 2026/02/27 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券   | 3.7500 | 1,810                 | 1,561                 | 63,652        | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27  | 国債証券   | 2.0000 | 1,660                 | 1,573                 | 64,133        | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30  | 国債証券   | 1.0000 | 2,860                 | 2,401                 | 97,869        | 2030/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32  | 国債証券   | 1.3000 | 2,300                 | 1,845                 | 75,210        | 2032/04/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25  | 国債証券   | 0.5000 | 1,890                 | 1,819                 | 74,162        | 2025/04/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37  | 国債証券   | 1.5000 | 2,420                 | 1,697                 | 69,175        | 2037/05/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券   | 1.7500 | 2,000                 | 1,941                 | 79,122        | 2025/08/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 国債証券   | 2.2500 | 2,360                 | 2,199                 | 89,634        | 2028/09/28 |
| ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26 | 国債証券   | 6.2500 | 1,220                 | 1,294                 | 52,768        | 2026/10/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 11/29/52      | 国債証券   | 2.8000 | 960                   | 660                   | 26,904        | 2052/11/29 |
| 小計                              | —      | —      | 22,320                | 19,889                | 810,730       | —          |
| (デンマーク)                         |        |        |                       |                       |               |            |
| DENMARK 0.25 11/15/52           | 国債証券   | 0.2500 | 千デンマーク・クローネ<br>4,560  | 千デンマーク・クローネ<br>2,443  | 千円<br>53,218  | 2052/11/15 |
| DENMARK 4.5 11/15/39            | 国債証券   | 4.5000 | 7,650                 | 9,509                 | 207,116       | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25           | 国債証券   | 1.7500 | 3,740                 | 3,675                 | 80,049        | 2025/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27            | 国債証券   | 0.5000 | 4,850                 | 4,516                 | 98,367        | 2027/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/29            | 国債証券   | 0.5000 | 5,140                 | 4,627                 | 100,786       | 2029/11/15 |
| DENMARK 0.0 11/15/31            | 国債証券   | 0.0000 | 5,080                 | 4,236                 | 92,261        | 2031/11/15 |
| DENMARK 2.25 11/15/33           | 国債証券   | 2.2500 | 1,700                 | 1,667                 | 36,328        | 2033/11/15 |
| 小計                              | —      | —      | 32,720                | 30,676                | 668,129       | —          |
| (ノルウェー)                         |        |        |                       |                       |               |            |
| NORWAY 1.5 02/19/26             | 国債証券   | 1.5000 | 千ノルウェー・クローネ<br>6,710  | 千ノルウェー・クローネ<br>6,386  | 千円<br>91,511  | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27            | 国債証券   | 1.7500 | 5,100                 | 4,792                 | 68,683        | 2027/02/17 |
| NORWAY 1.75 03/13/25            | 国債証券   | 1.7500 | 1,130                 | 1,099                 | 15,759        | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28             | 国債証券   | 2.0000 | 2,070                 | 1,924                 | 27,576        | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.125 05/18/32           | 国債証券   | 2.1250 | 2,030                 | 1,788                 | 25,630        | 2032/05/18 |
| NORWAY 1.375 08/19/30           | 国債証券   | 1.3750 | 4,610                 | 3,978                 | 57,006        | 2030/08/19 |
| NORWAY 3.0 08/15/33             | 国債証券   | 3.0000 | 2,900                 | 2,715                 | 38,916        | 2033/08/15 |
| NORWAY 1.75 09/06/29            | 国債証券   | 1.7500 | 2,920                 | 2,627                 | 37,652        | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31            | 国債証券   | 1.2500 | 2,950                 | 2,460                 | 35,254        | 2031/09/17 |
| NORWAY 3.5 10/06/42             | 国債証券   | 3.5000 | 2,200                 | 2,166                 | 31,049        | 2042/10/06 |
| 小計                              | —      | —      | 32,620                | 29,940                | 429,040       | —          |
| (スウェーデン)                        |        |        |                       |                       |               |            |
| SWEDEN 3.5 03/30/39             | 国債証券   | 3.5000 | 千スウェーデン・クローナ<br>3,990 | 千スウェーデン・クローナ<br>4,443 | 千円<br>64,482  | 2039/03/30 |
| SWEDEN 0.75 05/12/28            | 国債証券   | 0.7500 | 3,390                 | 3,159                 | 45,848        | 2028/05/12 |
| SWEDEN 2.5 05/12/25             | 国債証券   | 2.5000 | 5,920                 | 5,870                 | 85,174        | 2025/05/12 |
| SWEDEN 0.125 05/12/31           | 国債証券   | 0.1250 | 4,920                 | 4,191                 | 60,812        | 2031/05/12 |

| 銘                          | 柄             | 当 |   |   | 期 |             | 末           |           |           |   |   |   |       |            |
|----------------------------|---------------|---|---|---|---|-------------|-------------|-----------|-----------|---|---|---|-------|------------|
|                            |               | 種 | 類 | 利 | 率 | 額           | 面           | 金         | 額         | 評 | 価 | 額 | 償還年月日 |            |
|                            |               |   |   |   |   |             |             |           |           |   |   |   |       |            |
| (スウェーデン)                   |               |   |   |   | % | 千スウェーデン・クロナ | 千スウェーデン・クロナ | 千円        |           |   |   |   |       |            |
| SWEDEN 2.25                | 06/01/32      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500      | 4,050       | 4,004     | 58,106    |   |   |   |       | 2032/06/01 |
| SWEDEN 1.0                 | 11/12/26      | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000      | 8,210       | 7,852     | 113,945   |   |   |   |       | 2026/11/12 |
| SWEDEN 0.75                | 11/12/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500      | 3,960       | 3,622     | 52,565    |   |   |   |       | 2029/11/12 |
| SWEDEN 1.75                | 11/11/33      | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500      | 2,700       | 2,548     | 36,979    |   |   |   |       | 2033/11/11 |
| 小計                         |               | — |   | — |   | 37,140      | 35,693      | 517,914   | —         |   |   |   |       |            |
| (メキシコ)                     |               |   |   |   | % | 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      | 36,282      | 33,436    | 294,374   |   |   |   |       | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS              | 03/04/27      | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000      | 25,080      | 22,431    | 197,487   |   |   |   |       | 2027/03/04 |
| MEXICAN BONDS              | 03/06/25      | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000      | 3,680       | 3,495     | 30,777    |   |   |   |       | 2025/03/06 |
| MEXICAN BONDS              | 03/01/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.5000      | 9,500       | 9,173     | 80,763    |   |   |   |       | 2029/03/01 |
| MEXICAN BONDS 8.5          | 05/31/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.5000      | 24,159      | 23,435    | 206,327   |   |   |   |       | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75         | 05/29/31      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.7500      | 30,148      | 27,780    | 244,579   |   |   |   |       | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS              | 05/26/33      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.5000      | 19,290      | 17,202    | 151,446   |   |   |   |       | 2033/05/26 |
| MEXICAN BONDS 7.5          | 06/03/27      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.5000      | 28,146      | 26,588    | 234,081   |   |   |   |       | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS              | 07/31/53      | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.0000      | 13,290      | 11,397    | 100,340   |   |   |   |       | 2053/07/31 |
| MEXICAN BONDS              | 09/03/26      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.0000      | 8,000       | 7,502     | 66,049    |   |   |   |       | 2026/09/03 |
| MEXICAN BONDS 7.75         | 11/13/42      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.7500      | 24,707      | 21,151    | 186,219   |   |   |   |       | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0          | 11/07/47      | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.0000      | 19,561      | 17,001    | 149,680   |   |   |   |       | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5          | 11/18/38      | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.5000      | 15,642      | 14,631    | 128,813   |   |   |   |       | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS              | 10.0 11/20/36 | 国 | 債 | 証 | 券 | 10.0000     | 5,485       | 5,803     | 51,092    |   |   |   |       | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75         | 11/23/34      | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.7500      | 10,035      | 9,020     | 79,413    |   |   |   |       | 2034/11/23 |
| 小計                         |               | — |   | — |   | 273,005     | 250,053     | 2,201,447 | —         |   |   |   |       |            |
| (中国)                       |               |   |   |   | % | 千オフショア・人民元  | 千オフショア・人民元  | 千円        |           |   |   |   |       |            |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 | 02/17/32      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 15,500      | 15,832    | 329,979   |   |   |   |       | 2032/02/17 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 | 02/25/33      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8800      | 11,200      | 11,589    | 241,546   |   |   |   |       | 2033/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 | 02/24/25      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2600      | 40,500      | 40,634    | 846,893   |   |   |   |       | 2025/02/24 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 | 03/16/50      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3900      | 19,100      | 21,625    | 450,709   |   |   |   |       | 2050/03/16 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8  | 03/24/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000      | 11,000      | 11,253    | 234,531   |   |   |   |       | 2029/03/24 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 | 03/11/26      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0300      | 54,000      | 55,050    | 1,147,353 |   |   |   |       | 2026/03/11 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8  | 03/25/30      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000      | 10,000      | 10,231    | 213,231   |   |   |   |       | 2030/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 | 04/15/52      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3200      | 15,820      | 17,880    | 372,661   |   |   |   |       | 2052/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 | 04/12/51      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7200      | 7,600       | 9,140     | 190,494   |   |   |   |       | 2051/04/12 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 | 04/15/53      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1900      | 8,500       | 9,524     | 198,515   |   |   |   |       | 2053/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 | 04/15/27      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.4800      | 25,100      | 25,320    | 527,716   |   |   |   |       | 2027/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 | 05/27/31      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0200      | 18,500      | 19,263    | 401,475   |   |   |   |       | 2031/05/27 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 | 05/15/32      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7600      | 9,000       | 9,195     | 191,659   |   |   |   |       | 2032/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 | 05/25/33      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6700      | 14,500      | 14,741    | 307,229   |   |   |   |       | 2033/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 | 05/13/28      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0100      | 54,000      | 55,641    | 1,159,653 |   |   |   |       | 2028/05/13 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 | 05/23/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2900      | 4,000       | 4,205     | 87,647    |   |   |   |       | 2029/05/23 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 | 05/21/30      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6800      | 64,600      | 65,640    | 1,368,063 |   |   |   |       | 2030/05/21 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.3  | 05/15/26      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3000      | 39,500      | 39,609    | 825,527   |   |   |   |       | 2026/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 | 05/25/25      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2400      | 8,490       | 8,500     | 177,163   |   |   |   |       | 2025/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 | 06/04/27      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8500      | 23,500      | 23,977    | 499,730   |   |   |   |       | 2027/06/04 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 | 06/15/29      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500      | 22,000      | 22,447    | 467,837   |   |   |   |       | 2029/06/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 | 06/06/26      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500      | 18,450      | 18,952    | 395,004   |   |   |   |       | 2026/06/06 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 | 06/25/30      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6200      | 10,000      | 10,119    | 210,916   |   |   |   |       | 2030/06/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 | 07/22/49      | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8600      | 5,800       | 7,059     | 147,125   |   |   |   |       | 2049/07/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.4  | 07/15/28      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.4000      | 25,000      | 25,102    | 523,181   |   |   |   |       | 2028/07/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.5  | 07/25/27      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000      | 20,410      | 20,567    | 428,669   |   |   |   |       | 2027/07/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 | 08/15/32      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6900      | 21,000      | 21,379    | 445,593   |   |   |   |       | 2032/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 | 08/25/25      | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1800      | 20,000      | 20,016    | 417,187   |   |   |   |       | 2025/08/25 |

| 銘                                   | 柄 | 当 |   |   | 期 |           |        | 末 |   |           |   |            |       |            |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
|-------------------------------------|---|---|---|---|---|-----------|--------|---|---|-----------|---|------------|-------|------------|---|----|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|---|---|--|
|                                     |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額         | 面      | 金 | 額 | 評         | 価 | 額          | 償還年月日 |            |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
|                                     |   |   |   |   |   |           |        |   |   |           |   |            |       |            |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| (中国)                                |   |   |   |   | % | 千         | オ      | フ | シ | ョ         | ・ | 人          | 民     | 元          | 千 | オ  | フ | シ | ョ | ・ | 人 | 民 | 元 | 千 | 円 |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6900    | 60,600 |   |   | 61,382    |   | 1,279,310  |       | 2026/08/12 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5900    | 5,000  |   |   | 5,262     |   | 109,681    |       | 2027/08/03 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1800    | 42,000 |   |   | 41,999    |   | 875,345    |       | 2026/08/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8100    | 17,500 |   |   | 21,268    |   | 443,269    |       | 2050/09/14 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6000    | 18,300 |   |   | 18,441    |   | 384,348    |       | 2032/09/01 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6000    | 3,000  |   |   | 3,034     |   | 63,243     |       | 2030/09/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6200    | 18,000 |   |   | 18,257    |   | 380,521    |       | 2029/09/25 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1200    | 9,500  |   |   | 10,348    |   | 215,677    |       | 2052/10/25 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5300    | 12,450 |   |   | 14,536    |   | 302,960    |       | 2051/10/18 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0800    | 10,300 |   |   | 12,842    |   | 267,651    |       | 2048/10/22 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.9100    | 29,100 |   |   | 29,934    |   | 623,887    |       | 2028/10/14 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.4400    | 21,000 |   |   | 21,134    |   | 440,477    |       | 2027/10/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000    | 31,300 |   |   | 32,050    |   | 667,976    |       | 2032/11/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8900    | 15,100 |   |   | 15,568    |   | 324,466    |       | 2031/11/18 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2700    | 3,000  |   |   | 3,166     |   | 65,990     |       | 2030/11/19 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1300    | 8,000  |   |   | 8,341     |   | 173,843    |       | 2029/11/21 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2800    | 31,800 |   |   | 31,878    |   | 664,392    |       | 2025/11/25 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3900    | 22,000 |   |   | 22,131    |   | 461,263    |       | 2026/11/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5400    | 3,000  |   |   | 3,021     |   | 62,981     |       | 2030/12/25 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7900    | 24,000 |   |   | 24,550    |   | 511,670    |       | 2029/12/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2800    | 18,500 |   |   | 19,287    |   | 401,976    |       | 2027/12/03 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| 小                                   | 計 | — | — | — | — | 1,000,520 |        |   |   | 1,032,940 |   | 21,528,239 |       | —          |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| (マレーシア)                             |   |   |   |   | % | 千         | マ      | レ | ー | シ         | ャ | ・          | リ     | ン          | ギ | ット | 千 | マ | レ | ー | シ | ャ | ・ | リ | ン | ギ | ット | 千 | 円 |  |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8920    | 1,000  |   |   | 1,011     |   | 31,652     |       | 2027/03/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.457 03/31/53             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.4570    | 2,000  |   |   | 2,077     |   | 64,985     |       | 2053/03/31 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.736 03/15/46             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7360    | 300    |   |   | 324       |   | 10,155     |       | 2046/03/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3920    | 1,050  |   |   | 1,070     |   | 33,485     |       | 2026/04/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.4980    | 1,200  |   |   | 1,250     |   | 39,132     |       | 2030/04/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8440    | 1,660  |   |   | 1,655     |   | 51,799     |       | 2033/04/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7620    | 1,700  |   |   | 1,835     |   | 57,423     |       | 2037/04/07 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 2.632 04/15/31             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6320    | 1,100  |   |   | 1,020     |   | 31,914     |       | 2031/04/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.504 04/30/29             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5040    | 2,950  |   |   | 3,068     |   | 96,012     |       | 2029/04/30 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5020    | 650    |   |   | 650       |   | 20,346     |       | 2027/05/31 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.757 05/22/40             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7570    | 1,500  |   |   | 1,447     |   | 45,274     |       | 2040/05/22 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.254 05/31/35             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2540    | 1,400  |   |   | 1,437     |   | 44,977     |       | 2035/05/31 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7330    | 2,000  |   |   | 2,008     |   | 62,822     |       | 2028/06/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.232 06/30/31             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2320    | 670    |   |   | 687       |   | 21,501     |       | 2031/06/30 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.065 06/15/50             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0650    | 1,700  |   |   | 1,664     |   | 52,076     |       | 2050/06/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.9210    | 1,990  |   |   | 2,203     |   | 68,947     |       | 2048/07/06 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.906 07/15/26             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.9060    | 1,920  |   |   | 1,942     |   | 60,766     |       | 2026/07/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8280    | 1,820  |   |   | 1,811     |   | 56,668     |       | 2034/07/05 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.582 07/15/32             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5820    | 1,400  |   |   | 1,372     |   | 42,924     |       | 2032/07/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.885 08/15/29             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8850    | 700    |   |   | 707       |   | 22,148     |       | 2029/08/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.955 09/15/25             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.9550    | 1,950  |   |   | 1,964     |   | 61,467     |       | 2025/09/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.9350    | 1,600  |   |   | 1,767     |   | 55,286     |       | 2043/09/30 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.696 10/15/42             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6960    | 960    |   |   | 1,035     |   | 32,410     |       | 2042/10/15 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.9 11/30/26               |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.9000    | 1,660  |   |   | 1,679     |   | 52,550     |       | 2026/11/30 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 3.899 11/16/27             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8990    | 1,730  |   |   | 1,752     |   | 54,811     |       | 2027/11/16 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| MALAYSIA 4.642 11/07/33             |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6420    | 1,450  |   |   | 1,540     |   | 48,191     |       | 2033/11/07 |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |
| 小                                   | 計 | — | — | — | — | 38,060    |        |   |   | 38,987    |   | 1,219,734  |       | —          |   |    |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |    |   |   |  |

| 銘                | 柄        | 当 |   |   | 期 |            |            | 末         |   |         |   |            |   |
|------------------|----------|---|---|---|---|------------|------------|-----------|---|---------|---|------------|---|
|                  |          | 種 | 類 | 利 | 率 | 額          | 面          | 金         | 額 | 償還年月日   |   |            |   |
|                  |          |   |   |   |   |            |            |           |   |         | 外 | 貨          | 建 |
| (ポーランド)          |          |   |   |   | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ |           |   | 千円      |   |            |   |
| POLAND 5.75      | 04/25/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500     | 3,190      | 3,265     |   | 122,805 |   | 2029/04/25 |   |
| POLAND 2.75      | 04/25/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500     | 3,460      | 3,162     |   | 118,954 |   | 2028/04/25 |   |
| POLAND 1.75      | 04/25/32 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500     | 5,440      | 4,178     |   | 157,143 |   | 2032/04/25 |   |
| POLAND 0.75      | 04/25/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500     | 4,170      | 3,973     |   | 149,430 |   | 2025/04/25 |   |
| POLAND 3.75      | 05/25/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500     | 3,650      | 3,511     |   | 132,070 |   | 2027/05/25 |   |
| POLAND 2.5       | 07/25/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000     | 3,290      | 3,104     |   | 116,759 |   | 2026/07/25 |   |
| POLAND 3.25      | 07/25/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500     | 1,590      | 1,551     |   | 58,339  |   | 2025/07/25 |   |
| POLAND 2.5       | 07/25/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000     | 2,360      | 2,175     |   | 81,802  |   | 2027/07/25 |   |
| POLAND 7.5       | 07/25/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.5000     | 3,400      | 3,709     |   | 139,526 |   | 2028/07/25 |   |
| POLAND 2.75      | 10/25/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500     | 2,000      | 1,767     |   | 66,476  |   | 2029/10/25 |   |
| POLAND 1.25      | 10/25/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500     | 4,720      | 3,684     |   | 138,558 |   | 2030/10/25 |   |
| POLAND 0.25      | 10/25/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500     | 1,880      | 1,661     |   | 62,470  |   | 2026/10/25 |   |
| 小                | 計        | — | — | — | — | 39,150     | 35,744     | 1,344,336 |   | —       |   | —          |   |
| (ユーロ…アイルランド)     |          |   |   |   | % | 千ユーロ       | 千ユーロ       |           |   | 千円      |   |            |   |
| IRISH 2.0        | 02/18/45 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000     | 840        | 708       |   | 115,032 |   | 2045/02/18 |   |
| IRISH 1.35       | 03/18/31 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3500     | 660        | 608       |   | 98,854  |   | 2031/03/18 |   |
| IRISH 5.4        | 03/13/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.4000     | 590        | 602       |   | 97,848  |   | 2025/03/13 |   |
| IRISH 0.55       | 04/22/41 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5500     | 250        | 169       |   | 27,533  |   | 2041/04/22 |   |
| IRISH 1.5        | 05/15/50 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000     | 650        | 472       |   | 76,713  |   | 2050/05/15 |   |
| IRISH 1.3        | 05/15/33 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3000     | 290        | 257       |   | 41,861  |   | 2033/05/15 |   |
| IRISH 2.4        | 05/15/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.4000     | 960        | 951       |   | 154,412 |   | 2030/05/15 |   |
| IRISH 0.9        | 05/15/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.9000     | 710        | 664       |   | 107,847 |   | 2028/05/15 |   |
| IRISH 1.1        | 05/15/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1000     | 730        | 678       |   | 110,182 |   | 2029/05/15 |   |
| IRISH 1.0        | 05/15/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000     | 1,120      | 1,079     |   | 175,166 |   | 2026/05/15 |   |
| IRISH 1.7        | 05/15/37 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7000     | 780        | 678       |   | 110,181 |   | 2037/05/15 |   |
| IRISH 0.4        | 05/15/35 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.4000     | 370        | 286       |   | 46,572  |   | 2035/05/15 |   |
| IRISH 0.2        | 05/15/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2000     | 420        | 389       |   | 63,203  |   | 2027/05/15 |   |
| IRISH 3.0        | 10/18/43 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000     | 210        | 211       |   | 34,264  |   | 2043/10/18 |   |
| IRISH 0.0        | 10/18/31 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 670        | 550       |   | 89,393  |   | 2031/10/18 |   |
| IRISH 0.35       | 10/18/32 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3500     | 600        | 495       |   | 80,386  |   | 2032/10/18 |   |
| IRISH 0.2        | 10/18/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2000     | 350        | 300       |   | 48,749  |   | 2030/10/18 |   |
| 小                | 計        | — | — | — | — | 10,200     | 9,105      | 1,478,204 |   | —       |   | —          |   |
| (ユーロ…オランダ)       |          |   |   |   | % | 千ユーロ       | 千ユーロ       |           |   | 千円      |   |            |   |
| NETHERLANDS 3.75 | 01/15/42 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500     | 1,320      | 1,495     |   | 242,756 |   | 2042/01/15 |   |
| NETHERLANDS 2.75 | 01/15/47 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500     | 1,710      | 1,708     |   | 277,407 |   | 2047/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 01/15/52 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 1,430      | 688       |   | 111,827 |   | 2052/01/15 |   |
| NETHERLANDS 5.5  | 01/15/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000     | 1,090      | 1,202     |   | 195,264 |   | 2028/01/15 |   |
| NETHERLANDS 4.0  | 01/15/37 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000     | 1,320      | 1,489     |   | 241,846 |   | 2037/01/15 |   |
| NETHERLANDS 2.5  | 01/15/33 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000     | 1,310      | 1,301     |   | 211,215 |   | 2033/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 01/15/38 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 990        | 675       |   | 109,626 |   | 2038/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.5  | 01/15/40 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000     | 1,310      | 929       |   | 150,963 |   | 2040/01/15 |   |
| NETHERLANDS 2.0  | 01/15/54 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000     | 660        | 563       |   | 91,466  |   | 2054/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 01/15/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 1,030      | 911       |   | 147,947 |   | 2029/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 01/15/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 1,280      | 1,187     |   | 192,795 |   | 2027/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 01/15/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 2,180      | 2,065     |   | 335,374 |   | 2026/01/15 |   |
| NETHERLANDS 0.5  | 07/15/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000     | 1,820      | 1,727     |   | 280,449 |   | 2026/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.75 | 07/15/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500     | 1,480      | 1,371     |   | 222,591 |   | 2028/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.75 | 07/15/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500     | 1,460      | 1,374     |   | 223,123 |   | 2027/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.25 | 07/15/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500     | 1,360      | 1,206     |   | 195,842 |   | 2029/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 07/15/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 700        | 596       |   | 96,847  |   | 2030/07/15 |   |
| NETHERLANDS 0.0  | 07/15/31 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000     | 1,900      | 1,577     |   | 256,126 |   | 2031/07/15 |   |

| 銘                        | 柄 | 当 |   |   | 期 |        | 末      |           |         |       |            |
|--------------------------|---|---|---|---|---|--------|--------|-----------|---------|-------|------------|
|                          |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額      | 面      | 金         | 額       | 償還年月日 |            |
|                          |   |   |   |   |   |        |        |           |         |       | 外          |
| (ユーロ…オランダ)               |   |   |   |   | % | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |         |       |            |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/33 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 350    | 346       | 56,179  |       | 2033/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/32 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,000  | 844       | 137,122 |       | 2032/07/15 |
| 小計                       |   | — |   | — |   | 25,700 | 23,264 | 3,776,775 | —       |       |            |
| (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 | 1,600  | 1,776     | 288,389 |       | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 1,280  | 1,450     | 235,491 |       | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 1,070  | 1,105     | 179,418 |       | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 930    | 1,013     | 164,453 |       | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 1,570  | 1,867     | 303,248 |       | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 1,110  | 973       | 158,033 |       | 2033/04/22 |
| BELGIUM 2.75 04/22/39    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 320    | 304       | 49,401  |       | 2039/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 640    | 683       | 110,954 |       | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6000 | 920    | 664       | 107,920 |       | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7000 | 960    | 686       | 111,405 |       | 2050/06/22 |
| BELGIUM 1.4 06/22/53     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4000 | 1,390  | 889       | 144,352 |       | 2053/06/22 |
| BELGIUM 3.3 06/22/54     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3000 | 270    | 264       | 43,005  |       | 2054/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 | 390    | 304       | 49,363  |       | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1500 | 450    | 336       | 54,614  |       | 2066/06/22 |
| BELGIUM 0.65 06/22/71    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6500 | 870    | 366       | 59,536  |       | 2071/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 1,460  | 1,401     | 227,450 |       | 2026/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 1,570  | 1,393     | 226,228 |       | 2031/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | 940    | 867       | 140,834 |       | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.4 06/22/40     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.4000 | 930    | 600       | 97,519  |       | 2040/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.9000 | 1,350  | 1,235     | 200,622 |       | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 580    | 584       | 94,898  |       | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.9000 | 610    | 523       | 84,915  |       | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | 1,380  | 1,337     | 217,178 |       | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | 1,210  | 1,138     | 184,787 |       | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4500 | 780    | 641       | 104,095 |       | 2037/06/22 |
| BELGIUM 3.45 06/22/43    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 240    | 245       | 39,829  |       | 2043/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1000 | 1,200  | 1,022     | 166,015 |       | 2030/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/33     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 1,200  | 1,213     | 197,039 |       | 2033/06/22 |
| BELGIUM 0.35 06/22/32    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.3500 | 1,050  | 861       | 139,842 |       | 2032/06/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/31     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,040  | 845       | 137,314 |       | 2031/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/27     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,080  | 980       | 159,248 |       | 2027/10/22 |
| 小計                       |   | — |   | — |   | 30,390 | 27,580 | 4,477,411 | —       |       |            |
| (ユーロ…フランス)               |   |   |   |   | % | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |         |       |            |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 3,700  | 3,413     | 554,081 |       | 2027/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 3,530  | 3,335     | 541,536 |       | 2026/02/25 |
| FRANCE OAT 0.75 02/25/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 3,780  | 3,509     | 569,691 |       | 2028/02/25 |
| FRANCE OAT 2.75 02/25/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 3,100  | 3,112     | 505,345 |       | 2029/02/25 |
| FRANCE OAT 03/25/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,570  | 1,515     | 245,982 |       | 2025/03/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 3,850  | 3,903     | 633,708 |       | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 2,690  | 3,164     | 513,653 |       | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,530  | 1,728     | 280,656 |       | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,460  | 1,673     | 271,725 |       | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | 3,100  | 3,518     | 571,247 |       | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 | 2,330  | 2,729     | 443,077 |       | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | 2,540  | 2,541     | 412,649 |       | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 1,950  | 1,539     | 249,906 |       | 2048/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 3,720  | 2,568     | 416,982 |       | 2050/05/25 |

| 銘                          | 柄 | 当 |   |   | 期 |         | 末     |         |       |            |         |   |            |
|----------------------------|---|---|---|---|---|---------|-------|---------|-------|------------|---------|---|------------|
|                            |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額       | 面     | 金       | 額     | 償還年月日      |         |   |            |
|                            |   |   |   |   |   |         |       |         |       |            | 外       | 貨 | 建          |
| (ユーロ…フランス)                 |   |   |   |   | % |         | 千ユーロ  |         | 千ユーロ  |            | 千円      |   |            |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500  | 3,470 |         | 1,878 |            | 305,020 |   | 2052/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500  | 3,660 |         | 1,938 |            | 314,732 |   | 2053/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500  | 940   |         | 636   |            | 103,318 |   | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 790   |         | 306   |            | 49,798  |   | 2072/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000  | 4,650 |         | 4,611 |            | 748,628 |   | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500  | 5,090 |         | 4,707 |            | 764,175 |   | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000  | 5,780 |         | 5,338 |            | 866,601 |   | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 3,430 |         | 3,317 |            | 538,591 |   | 2025/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 3,590 |         | 3,218 |            | 522,455 |   | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500  | 3,560 |         | 3,051 |            | 495,395 |   | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 4,960 |         | 4,712 |            | 765,097 |   | 2026/05/25 |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000  | 3,560 |         | 3,374 |            | 547,800 |   | 2027/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 1,950 |         | 1,298 |            | 210,748 |   | 2040/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500  | 4,080 |         | 3,353 |            | 544,449 |   | 2036/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/38   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500  | 900   |         | 708   |            | 115,058 |   | 2038/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/43    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000  | 1,200 |         | 1,073 |            | 174,267 |   | 2043/05/25 |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/33    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000  | 3,000 |         | 3,046 |            | 494,567 |   | 2033/05/25 |
| FRANCE OAT 0.0 05/25/32    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 2,790 |         | 2,232 |            | 362,342 |   | 2032/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500  | 2,450 |         | 2,055 |            | 333,667 |   | 2039/06/25 |
| FRANCE OAT 0.5 06/25/44    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 1,490 |         | 893   |            | 145,019 |   | 2044/06/25 |
| FRANCE OAT 2.5 09/24/26    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000  | 4,120 |         | 4,090 |            | 664,120 |   | 2026/09/24 |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.0000  | 2,170 |         | 2,274 |            | 369,268 |   | 2025/10/25 |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500  | 3,240 |         | 3,247 |            | 527,129 |   | 2027/10/25 |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000  | 2,040 |         | 2,258 |            | 366,661 |   | 2038/10/25 |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500  | 2,610 |         | 3,196 |            | 518,890 |   | 2032/10/25 |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000  | 2,740 |         | 2,649 |            | 430,136 |   | 2025/11/25 |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500  | 4,020 |         | 3,757 |            | 609,921 |   | 2026/11/25 |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500  | 4,600 |         | 4,216 |            | 684,425 |   | 2028/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 3,670 |         | 2,983 |            | 484,326 |   | 2031/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 4,280 |         | 3,582 |            | 581,580 |   | 2030/11/25 |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000  | 3,850 |         | 3,622 |            | 588,020 |   | 2032/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 3,590 |         | 3,090 |            | 501,787 |   | 2029/11/25 |
| 小                          | 計 | — |   | — |   | 141,120 |       | 128,977 |       | 20,938,250 |         | — |            |
| (ユーロ…ドイツ)                  |   |   |   |   | % |         | 千ユーロ  |         | 千ユーロ  |            | 千円      |   |            |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.6250  | 1,310 |         | 1,460 |            | 237,126 |   | 2028/01/04 |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500  | 840   |         | 1,017 |            | 165,110 |   | 2030/01/04 |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000  | 2,620 |         | 3,139 |            | 509,635 |   | 2031/01/04 |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000  | 2,030 |         | 2,365 |            | 383,970 |   | 2037/01/04 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 1,650 |         | 1,606 |            | 260,751 |   | 2025/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 3,860 |         | 3,693 |            | 599,524 |   | 2026/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500  | 1,430 |         | 1,292 |            | 209,847 |   | 2029/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000  | 2,120 |         | 1,970 |            | 319,897 |   | 2028/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500  | 2,420 |         | 2,264 |            | 367,601 |   | 2027/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 2,340 |         | 1,999 |            | 324,656 |   | 2031/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3000  | 3,050 |         | 3,045 |            | 494,359 |   | 2033/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 2,500 |         | 2,086 |            | 338,727 |   | 2032/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 1,720 |         | 1,502 |            | 243,849 |   | 2030/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3000  | 700   |         | 698   |            | 113,433 |   | 2033/02/15 |
| BUNDESUBL 0.0 04/11/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 1,590 |         | 1,534 |            | 249,117 |   | 2025/04/11 |
| BUNDESUBL 2.2 04/13/28     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2000  | 2,100 |         | 2,083 |            | 338,203 |   | 2028/04/13 |
| BUNDESUBL 0.0 04/10/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000  | 3,510 |         | 3,315 |            | 538,291 |   | 2026/04/10 |

| 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…ドイツ)                 |         | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| BUNDESUBL 0.0 04/16/27    | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,060   | 1,906     | 309,455     | 2027/04/16 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,760   | 1,344     | 218,291     | 2035/05/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,660   | 1,358     | 220,475     | 2038/05/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,880   | 1,394     | 226,448     | 2036/05/15 |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27  | 国 債 証 券 | 6.5000 | 650     | 731       | 118,831     | 2027/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,180   | 1,292     | 209,857     | 2028/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,730   | 2,097     | 340,472     | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,330   | 1,456     | 236,518     | 2042/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44  | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,320   | 2,289     | 371,653     | 2044/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,610   | 2,075     | 336,902     | 2040/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国 債 証 券 | 4.7500 | 2,020   | 2,450     | 397,834     | 2034/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46  | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,240   | 2,215     | 359,662     | 2046/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,540   | 1,258     | 204,270     | 2052/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53  | 国 債 証 券 | 1.8000 | 1,850   | 1,571     | 255,105     | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国 債 証 券 | 1.2500 | 2,820   | 2,164     | 351,439     | 2048/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,420   | 2,350     | 381,540     | 2025/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,610   | 2,443     | 396,671     | 2027/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/26      | 国 債 証 券 | 0.0000 | 3,590   | 3,367     | 546,672     | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国 債 証 券 | 0.2500 | 2,570   | 2,344     | 380,561     | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29      | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,290   | 2,021     | 328,216     | 2029/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 3,140   | 1,632     | 264,969     | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32  | 国 債 証 券 | 1.7000 | 2,330   | 2,222     | 360,879     | 2032/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,890   | 2,443     | 396,601     | 2031/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,010   | 527       | 85,639      | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 3,730   | 3,223     | 523,261     | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 890     | 768       | 124,796     | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,100   | 929       | 150,960     | 2031/08/15 |
| BUNDESUBL 0.0 10/09/26    | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,760   | 2,580     | 418,939     | 2026/10/09 |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25    | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,650   | 2,529     | 410,601     | 2025/10/10 |
| BUNDESUBL 1.3 10/15/27    | 国 債 証 券 | 1.3000 | 2,280   | 2,191     | 355,829     | 2027/10/15 |
| BUNDESUBL 1.3 10/15/27    | 国 債 証 券 | 1.3000 | 1,050   | 1,009     | 163,950     | 2027/10/15 |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25    | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,350   | 1,290     | 209,524     | 2025/10/10 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,620   | 1,481     | 240,547     | 2027/11/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28  | 国 債 証 券 | 0.0000 | 2,560   | 2,295     | 372,664     | 2028/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30  | 国 債 証 券 | 2.4000 | 300     | 301       | 48,942      | 2030/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29  | 国 債 証 券 | 2.1000 | 2,000   | 1,975     | 320,653     | 2029/11/15 |
| 小 計                       | —       | —      | 108,580 | 100,614   | 16,333,748  | —          |
| (ユーロ…スペイン)                |         | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| SPAIN 6.0 01/31/29        | 国 債 証 券 | 6.0000 | 1,960   | 2,238     | 363,423     | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37        | 国 債 証 券 | 4.2000 | 1,660   | 1,792     | 290,935     | 2037/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/25        | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,330   | 1,288     | 209,149     | 2025/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/27        | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,910   | 1,755     | 284,907     | 2027/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/28        | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,880   | 1,678     | 272,436     | 2028/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/26        | 国 債 証 券 | 0.0000 | 1,640   | 1,548     | 251,458     | 2026/01/31 |
| SPAIN 1.6 04/30/25        | 国 債 証 券 | 1.6000 | 1,630   | 1,598     | 259,500     | 2025/04/30 |
| SPAIN 1.5 04/30/27        | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,510   | 1,446     | 234,837     | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.95 04/30/26       | 国 債 証 券 | 1.9500 | 1,730   | 1,693     | 274,938     | 2026/04/30 |
| SPAIN 1.4 04/30/28        | 国 債 証 券 | 1.4000 | 2,170   | 2,044     | 331,931     | 2028/04/30 |
| SPAIN 1.45 04/30/29       | 国 債 証 券 | 1.4500 | 1,500   | 1,396     | 226,756     | 2029/04/30 |
| SPAIN 0.7 04/30/32        | 国 債 証 券 | 0.7000 | 1,850   | 1,533     | 248,942     | 2032/04/30 |
| SPAIN 3.15 04/30/33       | 国 債 証 券 | 3.1500 | 1,570   | 1,565     | 254,101     | 2033/04/30 |

| 銘                        | 柄 | 当 |   |   | 期 |        |       | 末      |       |            |         |    |            |
|--------------------------|---|---|---|---|---|--------|-------|--------|-------|------------|---------|----|------------|
|                          |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額      | 面     | 金      | 額     | 償還年月日      |         |    |            |
|                          |   |   |   |   |   |        |       |        |       |            | 外       | 貨  | 建          |
| (ユーロ…スペイン)               |   |   |   |   | % |        | 千     | ユーロ    |       | 千          | ユーロ     | 千円 |            |
| SPAIN 0.5 04/30/30       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,800 |        | 1,553 |            | 252,120 |    | 2030/04/30 |
| SPAIN 0.1 04/30/31       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1000 | 1,880 |        | 1,527 |            | 247,974 |    | 2031/04/30 |
| SPAIN 3.5 05/31/29       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 500   |        | 513   |            | 83,408  |    | 2029/05/31 |
| SPAIN 2.8 05/31/26       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000 | 1,800 |        | 1,792 |            | 290,984 |    | 2026/05/31 |
| SPAIN 0.0 05/31/25       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 870   |        | 835   |            | 135,584 |    | 2025/05/31 |
| SPAIN 5.9 07/30/26       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.9000 | 2,330 |        | 2,488 |            | 403,962 |    | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.9000 | 1,910 |        | 2,202 |            | 357,479 |    | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7000 | 1,880 |        | 2,135 |            | 346,662 |    | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 1,120 |        | 1,012 |            | 164,419 |    | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6500 | 1,895 |        | 1,933 |            | 313,918 |    | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.9500 | 1,770 |        | 1,665 |            | 270,353 |    | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | 1,965 |        | 2,350 |            | 381,630 |    | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3500 | 1,870 |        | 1,740 |            | 282,629 |    | 2033/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/43      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 740   |        | 710   |            | 115,353 |    | 2043/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4000 | 2,170 |        | 2,038 |            | 330,964 |    | 2028/07/30 |
| SPAIN 1.85 07/30/35      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8500 | 1,940 |        | 1,667 |            | 270,762 |    | 2035/07/30 |
| SPAIN 0.85 07/30/37      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8500 | 1,600 |        | 1,149 |            | 186,678 |    | 2037/07/30 |
| SPAIN 1.0 07/30/42       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 540   |        | 348   |            | 56,648  |    | 2042/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/27       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | 1,550 |        | 1,443 |            | 234,289 |    | 2027/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/29       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | 1,700 |        | 1,513 |            | 245,744 |    | 2029/07/30 |
| SPAIN 5.15 10/31/28      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.1500 | 2,060 |        | 2,256 |            | 366,374 |    | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.1500 | 1,210 |        | 1,457 |            | 236,662 |    | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.9000 | 1,300 |        | 1,134 |            | 184,116 |    | 2046/10/31 |
| SPAIN 2.7 10/31/48       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7000 | 1,560 |        | 1,292 |            | 209,805 |    | 2048/10/31 |
| SPAIN 1.9 10/31/52       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.9000 | 1,270 |        | 846   |            | 137,401 |    | 2052/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/71      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4500 | 660   |        | 321   |            | 52,136  |    | 2071/10/31 |
| SPAIN 1.0 10/31/50       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 1,790 |        | 963   |            | 156,389 |    | 2050/10/31 |
| SPAIN 2.15 10/31/25      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1500 | 1,810 |        | 1,784 |            | 289,724 |    | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4500 | 1,860 |        | 1,768 |            | 287,018 |    | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 10/31/26       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3000 | 2,630 |        | 2,521 |            | 409,413 |    | 2026/10/31 |
| SPAIN 0.6 10/31/29       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.6000 | 2,130 |        | 1,872 |            | 303,968 |    | 2029/10/31 |
| SPAIN 0.5 10/31/31       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 2,140 |        | 1,769 |            | 287,305 |    | 2031/10/31 |
| SPAIN 2.55 10/31/32      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5500 | 1,720 |        | 1,644 |            | 266,943 |    | 2032/10/31 |
| SPAIN 1.2 10/31/40       |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2000 | 1,810 |        | 1,261 |            | 204,801 |    | 2040/10/31 |
| SPAIN 1.25 10/31/30      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 2,450 |        | 2,187 |            | 355,135 |    | 2030/10/31 |
| SPAIN 3.55 10/31/33      |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5500 | 1,820 |        | 1,867 |            | 303,199 |    | 2033/10/31 |
| 小                        | 計 | — |   | — |   | 82,390 |       | 77,154 |       | 12,525,285 |         | —  |            |
| (ユーロ…イタリア)               |   |   |   |   | % |        | 千     | ユーロ    |       | 千          | ユーロ     | 千円 |            |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8500 | 1,710 |        | 1,603 |            | 260,306 |    | 2027/01/15 |
| ITALY BTPS 3.5 01/15/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 1,310 |        | 1,316 |            | 213,707 |    | 2026/01/15 |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | 2,660 |        | 3,071 |            | 498,627 |    | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,470 |        | 1,472 |            | 239,117 |    | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 2,540 |        | 2,430 |            | 394,583 |    | 2028/02/01 |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,610 |        | 1,528 |            | 248,192 |    | 2026/02/01 |
| ITALY BTPS 0.45 02/15/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.4500 | 1,800 |        | 1,566 |            | 254,297 |    | 2029/02/15 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7000 | 1,270 |        | 989   |            | 160,649 |    | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 1,690 |        | 1,491 |            | 242,136 |    | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000 | 400   |        | 289   |            | 47,000  |    | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1500 | 360   |        | 216   |            | 35,094  |    | 2072/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 2,110 |        | 2,163 |            | 351,237 |    | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6500 | 2,290 |        | 1,983 |            | 322,022 |    | 2032/03/01 |

| 銘柄                       | 柄    | 当      |       |       | 期       |            | 末  |   |   |   |   |   |       |
|--------------------------|------|--------|-------|-------|---------|------------|----|---|---|---|---|---|-------|
|                          |      | 種      | 類     | 利     | 率       | 額          | 面  | 金 | 額 | 評 | 価 | 額 | 償還年月日 |
|                          |      |        |       |       |         |            |    |   |   |   |   |   |       |
| (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 | 1,060 | 927   | 150,556 | 2040/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 2,120 | 2,014 | 327,063 | 2035/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30  | 国債証券 | 3.5000 | 2,170 | 2,183 | 354,505 | 2030/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 1,320 | 1,005 | 163,245 | 2036/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41  | 国債証券 | 1.8000 | 1,150 | 818   | 132,867 | 2041/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 1,480 | 1,026 | 166,718 | 2037/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.25 03/01/38 | 国債証券 | 3.2500 | 600   | 545   | 88,579  | 2038/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.2 03/01/34  | 国債証券 | 4.2000 | 400   | 412   | 66,994  | 2034/03/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,460 | 1,299 | 210,944 | 2028/03/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.0 04/30/35  | 国債証券 | 4.0000 | 1,160 | 1,171 | 190,235 | 2035/04/30 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45  | 国債証券 | 1.5000 | 1,110 | 694   | 112,713 | 2045/04/30 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,550 | 1,375 | 223,276 | 2030/04/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31  | 国債証券 | 0.9000 | 2,110 | 1,766 | 286,838 | 2031/04/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28  | 国債証券 | 3.4000 | 1,150 | 1,158 | 188,072 | 2028/04/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.0 04/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 2,020 | 1,890 | 306,906 | 2026/04/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.1 04/01/27  | 国債証券 | 1.1000 | 1,300 | 1,221 | 198,368 | 2027/04/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.8 04/15/26  | 国債証券 | 3.8000 | 1,500 | 1,519 | 246,661 | 2026/04/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31  | 国債証券 | 6.0000 | 2,260 | 2,621 | 425,553 | 2031/05/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 国債証券 | 1.4500 | 1,430 | 1,397 | 226,943 | 2025/05/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.4 05/01/33  | 国債証券 | 4.4000 | 1,600 | 1,685 | 273,614 | 2033/05/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26  | 国債証券 | 1.6000 | 2,850 | 2,753 | 447,077 | 2026/06/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25  | 国債証券 | 1.5000 | 1,560 | 1,524 | 247,437 | 2025/06/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27  | 国債証券 | 2.2000 | 1,590 | 1,544 | 250,738 | 2027/06/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 国債証券 | 0.9500 | 1,580 | 1,282 | 208,224 | 2032/06/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.8 06/15/29  | 国債証券 | 2.8000 | 1,200 | 1,169 | 189,781 | 2029/06/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30  | 国債証券 | 3.7000 | 1,400 | 1,418 | 230,276 | 2030/06/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26  | 国債証券 | 2.1000 | 1,790 | 1,747 | 283,749 | 2026/07/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.5 07/15/28  | 国債証券 | 0.5000 | 1,100 | 979   | 159,002 | 2028/07/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 国債証券 | 1.8500 | 1,240 | 1,215 | 197,396 | 2025/07/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34  | 国債証券 | 5.0000 | 2,360 | 2,591 | 420,706 | 2034/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39  | 国債証券 | 5.0000 | 1,890 | 2,063 | 335,050 | 2039/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 1,700 | 1,639 | 266,236 | 2027/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29  | 国債証券 | 3.0000 | 2,210 | 2,173 | 352,882 | 2029/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31  | 国債証券 | 0.6000 | 1,920 | 1,554 | 252,364 | 2031/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | 0.9500 | 1,350 | 1,156 | 187,819 | 2030/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.2 08/15/25  | 国債証券 | 1.2000 | 1,360 | 1,318 | 214,039 | 2025/08/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.0 08/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 1,850 | 1,714 | 278,404 | 2026/08/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 1,520 | 1,321 | 214,555 | 2038/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 1,560 | 1,658 | 269,197 | 2044/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 1,380 | 1,185 | 192,407 | 2046/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 2,180 | 2,316 | 376,027 | 2028/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40  | 国債証券 | 5.0000 | 1,650 | 1,802 | 292,638 | 2040/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 1,200 | 863   | 140,183 | 2050/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51  | 国債証券 | 1.7000 | 1,120 | 677   | 110,034 | 2051/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 1,330 | 1,195 | 194,047 | 2033/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 国債証券 | 2.1500 | 960   | 632   | 102,624 | 2052/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 1,380 | 1,290 | 209,522 | 2049/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 1,360 | 1,128 | 183,161 | 2036/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 国債証券 | 4.4500 | 800   | 816   | 132,586 | 2043/09/01 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | 0.9500 | 1,680 | 1,556 | 252,712 | 2027/09/15 |    |   |   |   |   |   |       |
| ITALY BTPS 3.85 09/15/26 | 国債証券 | 3.8500 | 1,500 | 1,524 | 247,503 | 2026/09/15 |    |   |   |   |   |   |       |

| 銘                        | 柄 | 当 |   |   | 期 |        | 末       |   |         |   |            |   |            |
|--------------------------|---|---|---|---|---|--------|---------|---|---------|---|------------|---|------------|
|                          |   | 種 | 類 | 利 | 率 | 額      | 面       | 金 | 額       | 評 | 価          | 額 | 償還年月日      |
|                          |   |   |   |   |   |        |         |   |         |   |            |   |            |
| (ユーロ…イタリア)               |   |   |   |   | % | 千ユーロ   |         |   | 千ユーロ    |   | 千円         |   |            |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 670     |   | 684     |   | 111,073    |   | 2053/10/01 |
| ITALY BTPS 4.0 10/30/31  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,400   |   | 1,441   |   | 234,048    |   | 2031/10/30 |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.2500 | 1,250   |   | 1,381   |   | 224,293    |   | 2026/11/01 |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.5000 | 2,010   |   | 2,242   |   | 363,991    |   | 2027/11/01 |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.2500 | 2,640   |   | 2,902   |   | 471,221    |   | 2029/11/01 |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 1,550   |   | 1,531   |   | 248,654    |   | 2025/11/15 |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 1,660   |   | 1,625   |   | 263,935    |   | 2025/12/01 |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 2,180   |   | 2,072   |   | 336,527    |   | 2026/12/01 |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000 | 1,940   |   | 1,902   |   | 308,884    |   | 2028/12/01 |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.9500 | 1,700   |   | 1,400   |   | 227,412    |   | 2031/12/01 |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6500 | 2,140   |   | 1,904   |   | 309,105    |   | 2030/12/01 |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/32  |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 1,340   |   | 1,224   |   | 198,827    |   | 2032/12/01 |
| ITALY BTPS 3.85 12/15/29 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8500 | 1,700   |   | 1,740   |   | 282,518    |   | 2029/12/15 |
| ITALY BTPS 2.65 12/01/27 |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6500 | 1,720   |   | 1,688   |   | 274,059    |   | 2027/12/01 |
| 小                        | 計 | — |   |   | — |        | 122,640 |   | 116,425 |   | 18,900,577 |   | —          |
| (ユーロ…フィンランド)             |   |   |   |   | % | 千ユーロ   |         |   | 千ユーロ    |   | 千円         |   |            |
| FINLAND 0.125 04/15/52   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1250 | 640     |   | 298     |   | 48,521     |   | 2052/04/15 |
| FINLAND 0.75 04/15/31    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 600     |   | 524     |   | 85,162     |   | 2031/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/47   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 | 380     |   | 276     |   | 44,937     |   | 2047/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 460     |   | 438     |   | 71,143     |   | 2026/04/15 |
| FINLAND 1.125 04/15/34   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1250 | 480     |   | 407     |   | 66,172     |   | 2034/04/15 |
| FINLAND 2.75 04/15/38    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 370     |   | 356     |   | 57,931     |   | 2038/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/43     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 380     |   | 239     |   | 38,880     |   | 2043/04/15 |
| FINLAND 0.125 04/15/36   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1250 | 280     |   | 199     |   | 32,347     |   | 2036/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/27   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 | 210     |   | 201     |   | 32,734     |   | 2027/04/15 |
| FINLAND 4.0 07/04/25     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 220     |   | 222     |   | 36,135     |   | 2025/07/04 |
| FINLAND 2.75 07/04/28    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 320     |   | 321     |   | 52,181     |   | 2028/07/04 |
| FINLAND 2.625 07/04/42   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 | 330     |   | 309     |   | 50,246     |   | 2042/07/04 |
| FINLAND 0.5 09/15/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 800     |   | 711     |   | 115,483    |   | 2029/09/15 |
| FINLAND 0.875 09/15/25   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8750 | 810     |   | 784     |   | 127,336    |   | 2025/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/28     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 650     |   | 590     |   | 95,917     |   | 2028/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/27     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 400     |   | 370     |   | 60,186     |   | 2027/09/15 |
| FINLAND 0.25 09/15/40    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 290     |   | 185     |   | 30,036     |   | 2040/09/15 |
| FINLAND 1.5 09/15/32     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 700     |   | 632     |   | 102,699    |   | 2032/09/15 |
| FINLAND 0.125 09/15/31   |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1250 | 700     |   | 576     |   | 93,646     |   | 2031/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/30     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 510     |   | 428     |   | 69,583     |   | 2030/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/26     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 100     |   | 93      |   | 15,124     |   | 2026/09/15 |
| 小                        | 計 | — |   |   | — |        | 9,630   |   | 8,170   |   | 1,326,408  |   | —          |
| (ユーロ…オーストリア)             |   |   |   |   | % | 千ユーロ   |         |   | 千ユーロ    |   | 千円         |   |            |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8000 | 310     |   | 357     |   | 58,062     |   | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 740     |   | 549     |   | 89,179     |   | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,520   |   | 1,366   |   | 221,903    |   | 2029/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 935     |   | 867     |   | 140,901    |   | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/34     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.9000 | 150     |   | 150     |   | 24,387     |   | 2034/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/31     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,410   |   | 1,165   |   | 189,278    |   | 2031/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/33     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.9000 | 1,300   |   | 1,306   |   | 212,033    |   | 2033/02/20 |
| AUSTRIA 0.9 02/20/32     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.9000 | 600     |   | 519     |   | 84,364     |   | 2032/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30     |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,180   |   | 1,006   |   | 163,383    |   | 2030/02/20 |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.8500 | 1,210   |   | 1,257   |   | 204,062    |   | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.1500 | 1,010   |   | 1,131   |   | 183,652    |   | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51    |   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 590     |   | 344     |   | 55,892     |   | 2051/03/20 |

| 銘                     | 柄    | 当      |   |        | 期 |        | 末 |             |   |            |   |   |       |  |
|-----------------------|------|--------|---|--------|---|--------|---|-------------|---|------------|---|---|-------|--|
|                       |      | 種      | 類 | 利      | 率 | 額      | 面 | 金           | 額 | 評          | 価 | 額 | 償還年月日 |  |
|                       |      |        |   |        |   |        |   |             |   |            |   |   |       |  |
| (ユーロ…オーストリア)          |      |        |   | %      |   | 千ユーロ   |   | 千ユーロ        |   | 千円         |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.7 04/20/71  | 国債証券 | 0.7000 |   | 410    |   | 185    |   | 30,075      |   | 2071/04/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27  | 国債証券 | 0.5000 |   | 1,340  |   | 1,251  |   | 203,166     |   | 2027/04/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34  | 国債証券 | 2.4000 |   | 870    |   | 832    |   | 135,183     |   | 2034/05/23 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 1.85 05/23/49 | 国債証券 | 1.8500 |   | 590    |   | 464    |   | 75,354      |   | 2049/05/23 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20 | 国債証券 | 0.8500 |   | 310    |   | 140    |   | 22,859      |   | 2120/06/30 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 |   | 550    |   | 552    |   | 89,772      |   | 2044/06/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 |   | 615    |   | 684    |   | 111,049     |   | 2027/07/15 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 2.0 07/15/26  | 国債証券 | 2.0000 |   | 460    |   | 451    |   | 73,309      |   | 2026/07/15 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17  | 国債証券 | 2.1000 |   | 390    |   | 295    |   | 47,998      |   | 2117/09/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 |   | 1,330  |   | 1,263  |   | 205,073     |   | 2026/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25  | 国債証券 | 1.2000 |   | 890    |   | 864    |   | 140,395     |   | 2025/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 3.15 10/20/53 | 国債証券 | 3.1500 |   | 420    |   | 423    |   | 68,799      |   | 2053/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.25 10/20/36 | 国債証券 | 0.2500 |   | 840    |   | 598    |   | 97,092      |   | 2036/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.0 10/20/40  | 国債証券 | 0.0000 |   | 450    |   | 271    |   | 44,131      |   | 2040/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 0.0 10/20/28  | 国債証券 | 0.0000 |   | 620    |   | 547    |   | 88,955      |   | 2028/10/20 |   |   |       |  |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86  | 国債証券 | 1.5000 |   | 190    |   | 113    |   | 18,478      |   | 2086/11/02 |   |   |       |  |
| 小                     | 計    | —      | — | 21,230 |   | 18,965 |   | 3,078,798   |   | —          |   |   |       |  |
| 合                     | 計    | —      | — | —      |   | —      |   | 256,938,107 |   | —          |   |   |       |  |

## ■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

| 項 目                     | 当 期         |  | 末     |
|-------------------------|-------------|--|-------|
|                         | 評 価 額       |  | 比 率   |
| 公 社 債                   | 千円          |  | %     |
|                         | 256,938,107 |  | 98.3  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,534,468   |  | 1.7   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 261,472,575 |  | 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、259,685,707千円、99.3％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、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝150.16円、1カナダ・ドル＝111.02円、1オーストラリア・ドル＝98.41円、1シンガポール・ドル＝111.73円、1ニュージーランド・ドル＝92.63円、1イギリス・ポンド＝189.58円、1イスラエル・シェケル＝40.76円、1デンマーク・クローネ＝21.78円、1ノルウェー・クローネ＝14.33円、1スウェーデン・クローナ＝14.51円、1メキシコ・ペソ＝8.803円、1オフショア・人民元＝20.841円、1マレーシア・リンギット＝31.284円、1ポーランド・ズロチ＝37.609円、1ユーロ＝162.34円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

| 項                          | 目          | 当 期 末            |
|----------------------------|------------|------------------|
| (A) 資 産                    | 等 価(評価額)   | 262,047,572,911円 |
| コ ー ル ・ 公 社                | 債(評価額)     | 2,571,862,881    |
| 未 収 入                      | 金 息        | 256,938,107,694  |
| 前 払 費                      | 用 金        | 575,027,153      |
| (B) 負 債                    | 債 金        | 1,747,978,124    |
| 未 払 払 解                    | 金 金        | 214,597,059      |
| 未 払 払 解                    | 金 金        | 1,654,049,105    |
| (C) 純 資 産                  | 総 額(A - B) | 1,628,558,105    |
| 元 次 期 繰 越 損 益              | 本 金 数      | 25,491,000       |
| (D) 受 益 権 総 口 益 数          | 口 益 数      | 260,393,523,806  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 口 益 数      | 112,140,675,109  |
|                            |            | 23,220円          |

(注1) 期首元本額 92,568,430,085円  
 追加設定元本額 57,122,203,229円  
 一部解約元本額 37,549,958,205円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                 |                 |
|---------------------------------|-----------------|
| D I A M 外国債券パッシブ・ファンド           | 6,936,625,396円  |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)          | 2,145,444円      |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)          | 13,898,297円     |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)          | 33,055,375円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)           | 29,463,237円     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)           | 42,934,640円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)           | 28,209,559円     |
| たわらノーロード 先進国債券                  | 20,317,116,345円 |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>           | 129,335円        |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)          | 3,175,860,175円  |
| たわらノーロード バランス (堅実型)             | 70,372,889円     |
| たわらノーロード バランス (標準型)             | 393,159,511円    |
| たわらノーロード バランス (積極型)             | 90,074,981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)    | 17,547,319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)    | 1,061,778,662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)  | 1,874,531,468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)    | 939,477,666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)    | 721,685,160円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)          | 1,181,174円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)          | 12,367,147円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)        | 192,544,517円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)          | 20,620,422円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)          | 38,634,144円     |
| D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金>    | 6,881,458,772円  |
| One DC 先進国債券インデックスファンド          | 1,443,766,551円  |
| One グローバルバランス                   | 60,758,637円     |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型    | 734,747,927円    |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型 | 2,430,100,443円  |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型    | 2,916,905,681円  |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド     | 415,782,480円    |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド     | 854,188,656円    |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド     | 822,838,550円    |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)           | 23,358,394円     |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)             | 887,363,869円    |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション          | 15,215,627円     |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)  | 159,329,380円    |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)  | 160,868,965円    |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)  | 260,318,009円    |
| クルーズコントロール                      | 1,073,014,665円  |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>      | 182,522,998円    |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>             | 854,009,676円    |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>            | 699,203,724円    |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>            | 179,400,751円    |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>            | 488,705,414円    |
| One グローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>  | 5,190,355円      |

|                                                            |                  |
|------------------------------------------------------------|------------------|
| One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>                             | 95,009,306円      |
| D I A M パッシブ資産分散ファンド                                       | 989,890,513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)                     | 237,386,300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)                     | 238,317,641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)                        | 95,585,889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)                     | 143,381,639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)                     | 544,565円         |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)                  | 621,159,184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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定) | 543,853,224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)                     | 211,165,647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・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定) | 866,888,247円     |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)                          | 634,044,700円     |
| D I A M 加替マルチャット型外国債券パブリックファンド (適格機関投資家向け)                 | 4,747,484,094円   |
| D I A M 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)                           | 1,364,728,567円   |
| 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)                                   | 2,512,206,226円   |
| 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)                                  | 5,272,436,982円   |
| A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)       | 222,937,463円     |
| D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)                           | 43,680,338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)                            | 393,718,174円     |
| D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)                     | 322,665,524円     |
| D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)                     | 208,816,275円     |
| D I A M 国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)                      | 11,704,671円      |
| D I A M 国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)                      | 20,619,600円      |
| D I A M 国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)                      | 6,524,169円       |
| D I A M 国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)                      | 51,265円          |
| D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)                         | 1,512,264円       |
| D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)                         | 33,413,721円      |
| D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)                           | 1,252,683,690円   |
| D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)                         | 1,244,567,605円   |
| D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)                           | 2,359,122,210円   |
| D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)                      | 50,385,127円      |
| D I A M グローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)                     | 100,205,864円     |
| D I A M アクアグローバル・バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)                  | 1,142,198,851円   |
| D I A M 世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家向け)                      | 202,876,714円     |
| D I A M 世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)                         | 155,039円         |
| D I A M 世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)                     | 199,846,920円     |
| D I A M 世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)                     | 259,826,276円     |
| D I A M 世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)                     | 336,700,092円     |
| D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)                             | 33,520,161円      |
| 動的パッケージファンド<DC年金>                                          | 48,713,270円      |
| コア資産形成ファンド                                                 | 24,325,247円      |
| たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>                            | 4,593,798,614円   |
| たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>                            | 12,277,305,584円  |
| M H A M 動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]                            | 5,666,776,191円   |
| M H A M 外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]                           | 4,945,479,083円   |
| 期末元本合計                                                     | 112,140,675,109円 |

■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

| 項 目 |   |   |                  |              | 当 期             |
|-----|---|---|------------------|--------------|-----------------|
| (A) | 配 | 当 | 等                | 収 益          | 5,766,181,304円  |
|     | 受 |   | 取                | 利 息          | 5,766,646,977   |
|     | そ | の | 他                | 収 益          | 5,079           |
|     | 支 | 払 |                  | 利 息          | △470,752        |
| (B) | 有 | 価 | 証                | 券 売 買 損 益    | 26,829,583,002  |
|     | 売 |   |                  | 買 益          | 30,605,561,933  |
|     | 売 |   |                  | 買 損          | △3,775,978,931  |
| (C) | そ | の | 他                | 費 用          | △34,657,163     |
| (D) | 当 | 期 | 損 益              | 金(A + B + C) | 32,561,107,143  |
| (E) | 前 | 期 | 繰 越              | 損 益 金        | 94,253,940,578  |
| (F) | 解 | 約 | 差 損 益 金          |              | △43,521,353,795 |
| (G) | 追 | 加 | 信 託 差 損 益 金      |              | 64,959,154,771  |
| (H) | 合 |   | 計(D + E + F + G) |              | 148,252,848,697 |
|     | 次 | 期 | 繰 越 損 益 金(H)     |              | 148,252,848,697 |

(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。