

## 運用報告書 (全体版)

第21期<決算日2024年2月21日>

### DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

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   | 2002年12月10日から無期限です。  |
| 運用方針   | 信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。  |
| 主要投資対象 | DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金><br>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド<br>海外の公社債を主要投資対象とします。  |
| 運用方法   | マザーファンド受益証券に投資し、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>外国債券への実質投資割合は原則として高位を維持します。<br>実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いません。 |
| 組入制限   | 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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ます。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。                          |
| 分配方針   | 決算日 (原則として2月21日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。        |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>」は、2024年2月21日に第21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/>

## DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

### ■最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額        |               |               | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |               | 債券組入<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 純資産<br>総額     |
|------------------|-------------|---------------|---------------|---|---------------|------------|------------|---------------|
|                  | (分配落)       | 税込<br>分配<br>金 | 期中<br>騰落<br>率 | 期中<br>騰落<br>率   | 期中<br>騰落<br>率 |            |            |               |
| 17期 (2020年2月21日) | 円<br>18,702 | 円<br>0        | %<br>7.5      | ポイント<br>122,662.63                                    | %<br>7.9      | %<br>97.8  | %<br>-     | 百万円<br>11,424 |
| 18期 (2021年2月22日) | 18,888      | 0             | 1.0           | 124,229.95  | 1.3           | 98.4       | -          | 11,895        |
| 19期 (2022年2月21日) | 19,135      | 0             | 1.3           | 126,280.23  | 1.7           | 98.9       | -          | 12,690        |
| 20期 (2023年2月21日) | 19,111      | 0             | △0.1          | 126,494.96  | 0.2           | 99.0       | -          | 13,348        |
| 21期 (2024年2月21日) | 21,926      | 0             | 14.7          | 145,648.68  | 15.1          | 98.7       | -          | 15,979        |

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

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額 |        | 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<br>比 | 債券先物<br>比 |
|--------------------------|---------|--------|---|--------|-----------|-----------|
|                          | 円       | 騰 落 率  | ポイント  | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2023 年 2 月 21 日 | 19,111  | %<br>— | 126,494.96  | %<br>— | %<br>99.0 | %<br>—    |
| 2 月 末                    | 19,184  | 0.4    | 126,903.56  | 0.3    | 98.8      | —         |
| 3 月 末                    | 19,422  | 1.6    | 128,532.24  | 1.6    | 98.7      | —         |
| 4 月 末                    | 19,561  | 2.4    | 129,370.99  | 2.3    | 98.6      | —         |
| 5 月 末                    | 20,057  | 5.0    | 132,828.99  | 5.0    | 98.8      | —         |
| 6 月 末                    | 20,854  | 9.1    | 138,284.08  | 9.3    | 98.7      | —         |
| 7 月 末                    | 20,399  | 6.7    | 135,227.94  | 6.9    | 98.7      | —         |
| 8 月 末                    | 20,950  | 9.6    | 138,880.03  | 9.8    | 98.9      | —         |
| 9 月 末                    | 20,640  | 8.0    | 136,810.50  | 8.2    | 98.6      | —         |
| 10 月 末                   | 20,609  | 7.8    | 136,724.14  | 8.1    | 98.7      | —         |
| 11 月 末                   | 21,325  | 11.6   | 141,488.31  | 11.9   | 98.5      | —         |
| 12 月 末                   | 21,345  | 11.7   | 141,801.08  | 12.1   | 98.5      | —         |
| 2024 年 1 月 末             | 21,720  | 13.7   | 144,118.59  | 13.9   | 99.4      | —         |
| (期 末)<br>2024 年 2 月 21 日 | 21,926  | 14.7   | 145,648.68  | 15.1   | 98.7      | —         |

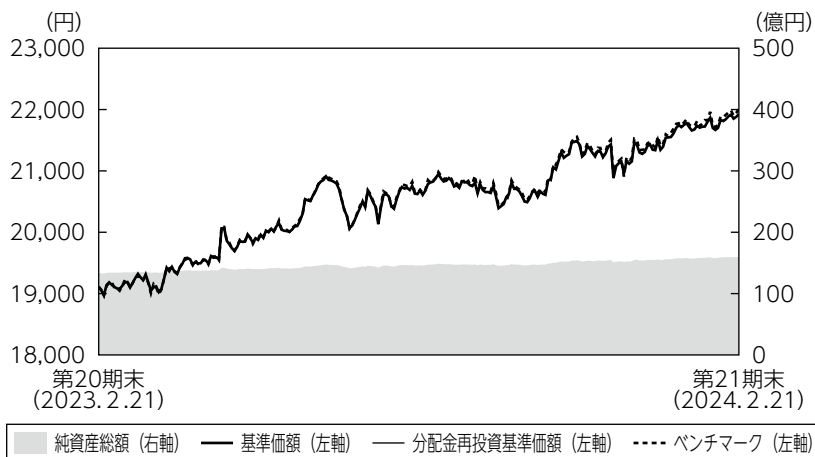
(注1) 騰落率は期首比です。

(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2月22日から2024年2月21日まで）

### 基準価額等の推移



第21期首：19,111円  
第21期末：21,926円  
(既払分配金0円)  
騰落率：14.7%  
(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

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、FRB（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

### ●当ファンド

当ファンドの主要投資対象は外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率は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

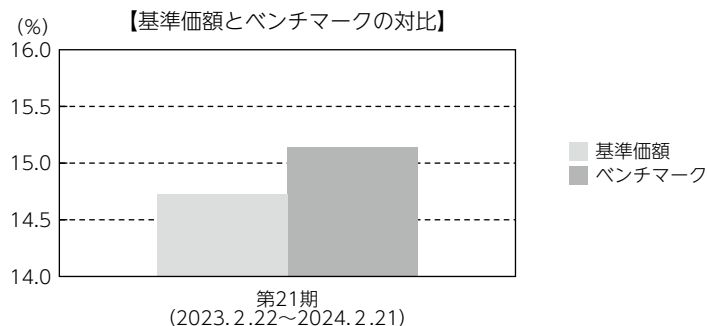
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

※運用状況については14ページをご参照ください。

## 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比で△0.4%と、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。なお、乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なること、信託報酬等の影響が挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                        |
|------------|---------------------------|
|            | 2023年2月22日<br>～2024年2月21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  | 12,387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

当ファンドの運用方針については、引き続き外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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        | 第21期                        |         | 項目の概要  |
|-----------|-----------------------------|---------|--|
|           | (2023年2月22日<br>～2024年2月21日) |         |  |
|           | 金額                          | 比率      |  |
| (a) 信託報酬  | 56円                         | 0.275%  | (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20,545円です。<br>投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価<br>販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価<br>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 |
| (投信会社)    | (25)                        | (0.121) |  |
| (販売会社)    | (25)                        | (0.121) |  |
| (受託会社)    | ( 7)                        | (0.033) |  |
| (b) その他費用 | 4                           | 0.018   | (b) 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>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<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) |  |
| (監査費用)    | ( 1)                        | (0.004) |  |
| (その他)     | ( 0)                        | (0.001) |  |
| 合計        | 60                          | 0.293   |  |

(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。

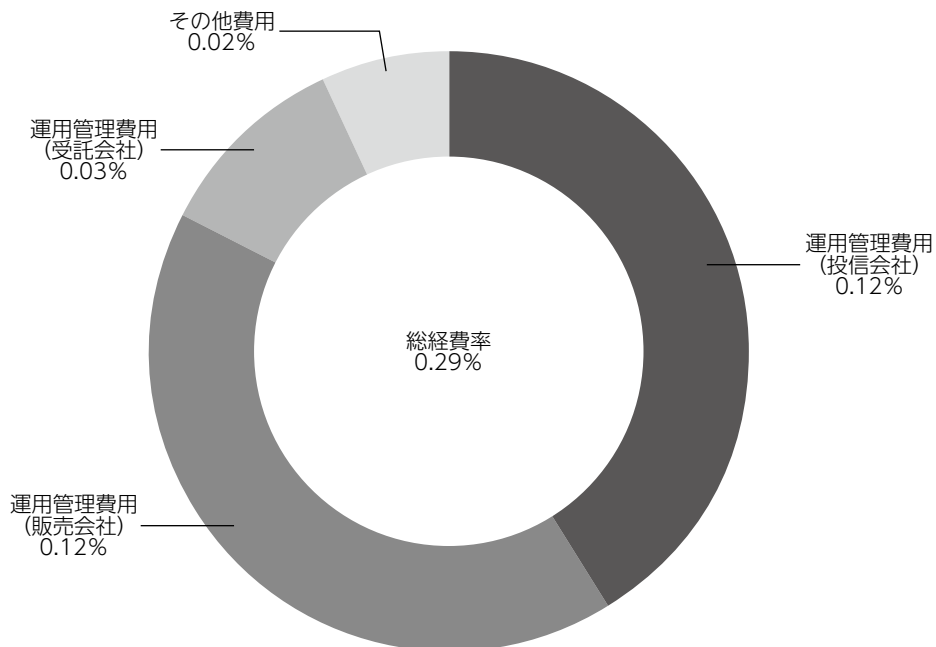
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.29%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2月22日から2024年2月21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□<br>602,450 | 千円<br>1,314,478 | 千□<br>334,567 | 千円<br>725,884 |

■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

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□<br>6,613,575 | 千□<br>6,881,458 | 千円<br>15,978,747 |

## ■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   |
|                         | 千円         | %     |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 15,978,747 | 99.7  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 41,659     | 0.3   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 16,020,406 | 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) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年2月21日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは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・リングギット=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                    | 16,020,406,631円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等            | 41,659,363      |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 15,978,747,268  |
| (B) 負 債                    | 40,699,334      |
| 未 払 解 約 金                  | 19,375,793      |
| 未 払 信 託 報 酬                | 21,046,661      |
| そ の 他 未 払 費 用              | 276,880         |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)         | 15,979,707,297  |
| 元 本                        | 7,288,077,193   |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 8,691,630,104   |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 7,288,077,193口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 21,926円         |

(注) 期首における元本額は6,984,903,220円、当期中における追加設定元本額は1,458,453,358円、同解約元本額は1,155,279,385円です。

## ■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        | △11,674円        |
| 受 取 利 息              | 1,312           |
| 支 払 利 息              | △12,986         |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 1,890,201,951   |
| 売 買 益                | 2,042,666,447   |
| 買 買 損                | △152,464,496    |
| (C) 信 託 報 酬 等        | △40,702,687     |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 1,849,487,590   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 879,599,804     |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 5,962,542,710   |
| (配 当 等 相 当 額)        | (6,298,879,324) |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (△336,336,614)  |
| (G) 合 計(D+E+F)       | 8,691,630,104   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)     | 8,691,630,104   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金      | 5,962,542,710   |
| (配 当 等 相 当 額)        | (6,298,879,324) |
| (売 買 損 益 相 当 額)      | (△336,336,614)  |
| 分 配 準 備 積 立 金        | 2,729,099,068   |
| 繰 越 損 益 金            | △11,674         |

(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      | 0円            |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 1,769,556,912 |
| (c) 収 益 調 整 金        | 6,298,879,324 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金    | 959,542,156   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 9,027,978,392 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額    | 12,387.33     |
| (g) 分 配 金            | 0             |
| (h) 1万口当たり分配金        | 0             |

## ■分配金のお知らせ

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 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、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。                                 |
| 主要投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。<br>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>外貨建資産への投資には、制限を設けません。 |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |      | FTSE世界国債インデックス<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  | 騰落率  | 期中騰落率   | 騰落率  |       |       |         |
| 17期 (2020年2月21日) | 円      | %    | ポイント  | %    | %     | %     | 百万円     |
| 18期 (2021年2月22日) | 19,586 | 7.8  | 122,662.63  | 7.9  | 97.8  | -     | 130,803 |
| 19期 (2022年2月21日) | 19,836 | 1.3  | 124,229.95  | 1.3  | 98.4  | -     | 137,037 |
| 20期 (2023年2月21日) | 20,152 | 1.6  | 126,280.23  | 1.7  | 98.9  | -     | 141,964 |
| 21期 (2024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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

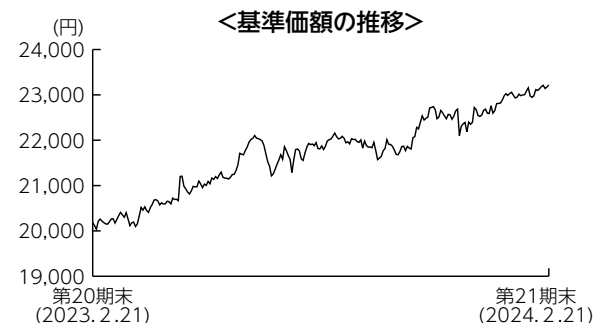
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     |        | F T S E世界国債インデックス<br>( 除く日本、<br>円 ベース、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |        | 債券組入<br>比 率 | 債券先物<br>比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-------------|-------------|
|                          | 騰 落 率       | 騰 落 率  | 騰 落 率  | 騰 落 率  |             |             |
| (期 首)<br>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）

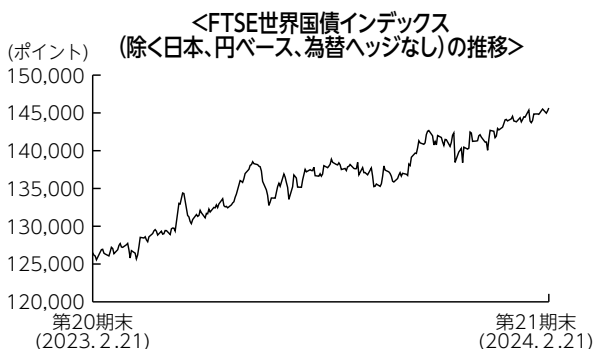


### 基準価額の推移

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

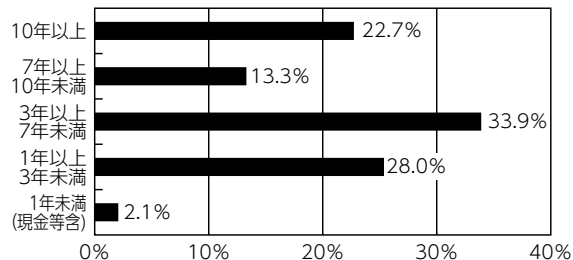
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

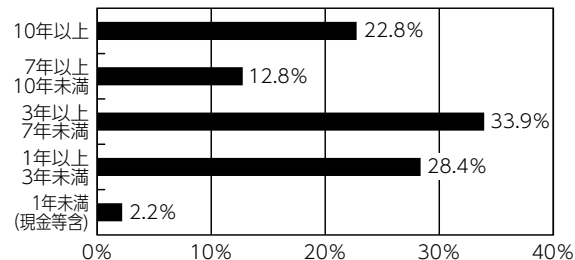
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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%  |
| 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% |
| アジア・オセアニア |        |            |       |
| 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% |
| 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% |
| 中近東       |        |            |       |
| 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% |
| 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% |
| アジア・オセアニア |        |            |       |
| 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% |
| 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% |
| 中近東       |        |            |       |
| 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<br>(保 管 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 |
| (そ の 他)                    | (3) | (0.014) |   |
| 合 計                        | (0) | (0.001) |   |
|                            | 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      |      | 千ユーロ                   | 千ユーロ                  |
|   | アイルランド   | 国債証券 | 3,525                  | 2,887                 |
|   | オランダ     | 国債証券 | 11,284                 | 8,015                 |
|   | ベルギー     | 国債証券 | 12,412                 | 9,503                 |
|   | フランス     | 国債証券 | 70,879                 | 54,149                |
|   | ドイツ      | 国債証券 | 54,900                 | 40,085                |
|   | スペイン     | 国債証券 | 40,842                 | 30,090                |
|   | イタリア     | 国債証券 | 62,054                 | 47,199                |
|   | フィンランド   | 国債証券 | 3,929                  | 2,451                 |
|   | オーストリア   | 国債証券 | 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・シケル<br>22,320    | 千イスラエル・シケル<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                      | 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 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     | 評価額      |         | 償還年月日      |   |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |   |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |   |
| US T N/B 1.875 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     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 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    | 4,166    | 625,673   | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37   | 国債証券 | 5.0000 | 755      | 810      | 121,723   | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 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    | 4,185    | 628,531   | 2050/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 2,250    | 2,135    | 320,676   | 2026/05/31 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 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    | 1,532    | 230,147   | 2025/05/31 |
| US T N/B 3.25 05/15/42  | 国債証券 | 3.2500 | 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      | 728      | 109,316   | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | 2.8750 | 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    | 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    | 2,632    | 395,230   | 2027/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/31/28  | 国債証券 | 1.2500 | 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    | 5,653    | 848,990   | 2030/05/15 |
| US T N/B 2.625 05/31/27 | 国債証券 | 2.6250 | 4,910    | 4,651    | 698,405   | 2027/05/31 |
| US T N/B 2.75 05/31/29  | 国債証券 | 2.7500 | 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    | 5,177    | 777,521   | 2026/05/31 |
| US T N/B 3.625 05/31/28 | 国債証券 | 3.6250 | 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    | 1,595    | 239,555   | 2025/05/31 |
| US T N/B 3.75 05/31/30  | 国債証券 | 3.7500 | 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    | 3,434    | 515,746   | 2026/05/15 |
| US T N/B 2.75 05/15/25  | 国債証券 | 2.7500 | 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    | 1,012    | 152,073   | 2025/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 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    | 2,448    | 367,718   | 2027/06/30 |
| US T N/B 1.25 06/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 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    | 3,293    | 494,529   | 2025/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/27  | 国債証券 | 3.2500 | 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    | 4,152    | 623,586   | 2026/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/29  | 国債証券 | 3.2500 | 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    | 2,361    | 354,536   | 2025/06/15 |
| US T N/B 4.0 06/30/28   | 国債証券 | 4.0000 | 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    | 4,661    | 700,031   | 2026/06/15 |
| US T N/B 3.75 06/30/30  | 国債証券 | 3.7500 | 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    | 2,143    | 321,828   | 2025/07/31 |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 国債証券 | 1.8750 | 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    | 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    | 3,304    | 496,221   | 2027/07/31 |
| US T N/B 4.0 07/31/30   | 国債証券 | 4.0000 | 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    | 3,563    | 535,067   | 2025/07/31 |
| US T N/B 2.625 07/31/29 | 国債証券 | 2.6250 | 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    | 2,484    | 373,061   | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.625 07/31/26 | 国債証券 | 0.6250 | 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    | 3,625    | 544,426   | 2027/07/31 |
| US T N/B 3.0 07/15/25   | 国債証券 | 3.0000 | 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    | 4,102    | 615,956   | 2026/07/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 国債証券 | 3.7500 | 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    | 1,198    | 179,897   | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 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    | 1,684    | 252,930   | 2044/08/15 |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |           | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (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     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 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                       | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額     | 期 間         |             | 償 還 年 月 日  |
|--------------------------|------|--------|-------------|-------------|-------------|------------|
|                          |      |        |             | 評 価 額       |             |            |
|                          |      |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| <b>(アメリカ)</b>            |      | %      | 千アメリカ・ドル    | 千アメリカ・ドル    | 千円          |            |
| US T N/B 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 | —          |
| <b>(カナダ)</b>             |      | %      | 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   | —          |
| <b>(オーストラリア)</b>         |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円          |            |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47  | 国債証券 | 3.0000 | 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     |        |              |              |            | 償還年月日 |
|---------------------------|------|--------|--------|--------------|--------------|------------|-------|
|                           |      | 種類     | 利率     | 額面金額         | 評価額          |            |       |
|                           |      |        |        |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額     |       |
| <b>(オーストラリア)</b>          |      |        | %      | 千オーストラリア・ドル  | 千オーストラリア・ドル  | 千円         |       |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30   | 国債証券 | 2.5000 | 1,660  | 1,529        | 150,519      | 2030/05/21 |       |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41  | 国債証券 | 2.7500 | 960    | 762          | 75,080       | 2041/05/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32  | 国債証券 | 1.2500 | 2,130  | 1,706        | 167,951      | 2032/05/21 |       |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34  | 国債証券 | 3.7500 | 1,800  | 1,734        | 170,694      | 2034/05/21 |       |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39  | 国債証券 | 3.2500 | 820    | 716          | 70,462       | 2039/06/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31   | 国債証券 | 1.5000 | 2,010  | 1,689        | 166,222      | 2031/06/21 |       |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35  | 国債証券 | 2.7500 | 650    | 563          | 55,483       | 2035/06/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51  | 国債証券 | 1.7500 | 2,520  | 1,420        | 139,792      | 2051/06/21 |       |
| AUSTRALIAN 0.5 09/21/26   | 国債証券 | 0.5000 | 2,615  | 2,408        | 237,000      | 2026/09/21 |       |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28  | 国債証券 | 2.7500 | 450    | 429          | 42,287       | 2028/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27  | 国債証券 | 2.7500 | 1,430  | 1,380        | 135,820      | 2027/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29  | 国債証券 | 2.7500 | 1,400  | 1,319        | 129,819      | 2029/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33   | 国債証券 | 3.0000 | 1,670  | 1,513        | 148,951      | 2033/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/32  | 国債証券 | 1.7500 | 1,850  | 1,527        | 150,297      | 2032/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31   | 国債証券 | 1.0000 | 2,470  | 1,969        | 193,799      | 2031/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,460  | 1,372        | 135,065      | 2025/11/21 |       |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30   | 国債証券 | 1.0000 | 1,670  | 1,374        | 135,234      | 2030/12/21 |       |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34   | 国債証券 | 3.5000 | 1,500  | 1,407        | 138,513      | 2034/12/21 |       |
| 小計                        | —    | —      | 40,065 | 35,489       | 3,492,489    | —          |       |
| <b>(シンガポール)</b>           |      |        | %      | 千シンガポール・ドル   | 千シンガポール・ドル   | 千円         |       |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27    | 国債証券 | 3.5000 | 800    | 810          | 90,501       | 2027/03/01 |       |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46   | 国債証券 | 2.7500 | 460    | 441          | 49,339       | 2046/03/01 |       |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50  | 国債証券 | 1.8750 | 840    | 672          | 75,082       | 2050/03/01 |       |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42   | 国債証券 | 2.7500 | 660    | 636          | 71,104       | 2042/04/01 |       |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28  | 国債証券 | 2.6250 | 340    | 334          | 37,399       | 2028/05/01 |       |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25  | 国債証券 | 2.3750 | 780    | 769          | 85,999       | 2025/06/01 |       |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26  | 国債証券 | 2.1250 | 590    | 576          | 64,404       | 2026/06/01 |       |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29  | 国債証券 | 2.8750 | 640    | 635          | 70,970       | 2029/07/01 |       |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39  | 国債証券 | 2.3750 | 190    | 174          | 19,487       | 2039/07/01 |       |
| SINGAPORE 1.625 07/01/31  | 国債証券 | 1.6250 | 840    | 760          | 84,946       | 2031/07/01 |       |
| SINGAPORE 3.0 08/01/72    | 国債証券 | 3.0000 | 125    | 127          | 14,224       | 2072/08/01 |       |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36   | 国債証券 | 2.2500 | 890    | 816          | 91,260       | 2036/08/01 |       |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30  | 国債証券 | 2.8750 | 620    | 613          | 68,510       | 2030/09/01 |       |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33  | 国債証券 | 3.3750 | 580    | 594          | 66,424       | 2033/09/01 |       |
| SINGAPORE 2.875 09/01/27  | 国債証券 | 2.8750 | 200    | 198          | 22,223       | 2027/09/01 |       |
| SINGAPORE 1.875 10/01/51  | 国債証券 | 1.8750 | 510    | 409          | 45,725       | 2051/10/01 |       |
| SINGAPORE 1.25 11/01/26   | 国債証券 | 1.2500 | 510    | 485          | 54,281       | 2026/11/01 |       |
| SINGAPORE 0.5 11/01/25    | 国債証券 | 0.5000 | 280    | 267          | 29,842       | 2025/11/01 |       |
| 小計                        | —    | —      | 9,855  | 9,323        | 1,041,728    | —          |       |
| <b>(ニュージーランド)</b>         |      |        | %      | 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       | 2027/04/15 |       |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33  | 国債証券 | 3.5000 | 450    | 406          | 37,662       | 2033/04/14 |       |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 810    | 635          | 58,902       | 2037/04/15 |       |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/25 | 国債証券 | 2.7500 | 670    | 650          | 60,235       | 2025/04/15 |       |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29  | 国債証券 | 3.0000 | 750    | 693          | 64,206       | 2029/04/20 |       |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 540    | 355          | 32,892       | 2051/05/15 |       |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 400    | 247          | 22,932       | 2041/05/15 |       |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31  | 国債証券 | 1.5000 | 880    | 706          | 65,439       | 2031/05/15 |       |
| NEW ZEALAND 4.25 05/15/34 | 国債証券 | 4.2500 | 130    | 123          | 11,456       | 2034/05/15 |       |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32  | 国債証券 | 2.0000 | 910    | 739          | 68,519       | 2032/05/15 |       |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 650    | 540          | 50,074       | 2028/05/15 |       |

| 銘                          | 柄 | 当期   |        |              |              |         | 償還年月日      |
|----------------------------|---|------|--------|--------------|--------------|---------|------------|
|                            |   | 種類   | 利率     | 額面金額         | 評価額          |         |            |
|                            |   |      |        |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額  |            |
| (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                          | 柄        | 当期   |        |              |              |            | 末          |
|----------------------------|----------|------|--------|--------------|--------------|------------|------------|
|                            |          | 種類   | 利率     | 額面金額         | 評価額          |            | 償還年月日      |
|                            |          |      |        |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額     |            |
| <b>(イギリス)</b>              |          |      | %      | 千イギリス・ポンド    | 千イギリス・ポンド    | 千円         |            |
| UK TREASURY 3.5            | 10/22/25 | 国債証券 | 3.5000 | 1,500        | 1,475        | 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 | -          |
| <b>(イスラエル)</b>             |          |      | %      | 千イスラエル・シケル   | 千イスラエル・シケル   | 千円         |            |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5      | 01/31/42 | 国債証券 | 5.5000 | 1,410        | 1,557        | 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    | -          |
| <b>(デンマーク)</b>             |          |      | %      | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ  | 千円         |            |
| DENMARK 0.25               | 11/15/52 | 国債証券 | 0.2500 | 4,560        | 2,443        | 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    | -          |
| <b>(ノルウェー)</b>             |          |      | %      | 千ノルウェー・クローネ  | 千ノルウェー・クローネ  | 千円         |            |
| NORWAY 1.5                 | 02/19/26 | 国債証券 | 1.5000 | 6,710        | 6,386        | 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    | -          |
| <b>(スウェーデン)</b>            |          |      | %      | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円         |            |
| SWEDEN 3.5                 | 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 3,990        | 4,443        | 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                                  | 柄    | 当期      |         |              |              |            | 償還年月日 |
|-------------------------------------|------|---------|---------|--------------|--------------|------------|-------|
|                                     |      | 種類      | 利率      | 額面金額         | 評価額          |            |       |
|                                     |      |         |         |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額     |       |
| <b>(スウェーデン)</b>                     |      |         | %       | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円         |       |
| SWEDEN 2.25 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      | —          |       |
| <b>(メキシコ)</b>                       |      |         | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     | 千円         |       |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26         | 国債証券 | 5.7500  | 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    | —          |       |
| <b>(中国)</b>                         |      |         | %       | 千オフショア・人民元   | 千オフショア・人民元   | 千円         |       |
| CHINA GOVERNMENT BOND 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   |        |              |              |            | 償還年月日      |
|-------------------------------------|---|------|--------|--------------|--------------|------------|------------|
|                                     |   | 種類   | 利率     | 額面金額         | 評価額          |            |            |
|                                     |   |      |        |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額     |            |
| <b>(中国)</b>                         |   |      | %      | 千オフショア・人民元   | 千オフショア・人民元   | 千円         |            |
| CHINA GOVERNMENT BOND 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 | —          |
| <b>(マレーシア)</b>                      |   |      | %      | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円         |            |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27             |   | 国債証券 | 3.8920 | 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   |        |            |            | 期末        |            |
|---------------------------|------|--------|------------|------------|-----------|------------|
|                           | 種類   | 利率     | 額面金額       | 評価額        |           | 償還年月日      |
|                           |      |        |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |
| <b>(ポーランド)</b>            |      | %      | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |            |
| POLAND 5.75 04/25/29      | 国債証券 | 5.7500 | 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 | -          |
| <b>(ユーロ…アイルランド)</b>       |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |
| IRISH 2.0 02/18/45        | 国債証券 | 2.0000 | 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 | -          |
| <b>(ユーロ…オランダ)</b>         |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,320      | 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                       | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額 | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|--------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|                          |      |        |         | 評 価 額     |             |            |
|                          |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (ユーロ…オランダ)               |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| NETHERLANDS 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                         | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額 | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|----------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|                            |      |        |         | 評 価 額     |             |            |
|                            |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| <b>(ユーロ…フランス)</b>          |      | %      | 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  | -          |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>           |      | %      | 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                        | 柄    | 当期     |         |         |            |            | 償還年月日 |
|---------------------------|------|--------|---------|---------|------------|------------|-------|
|                           |      | 種類     | 利率      | 額面金額    | 評価額        |            |       |
|                           |      |        |         |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |       |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>          |      |        | %       | 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 | -          |       |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>         |      |        | %       | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円         |       |
| SPAIN 6.0 01/31/29        | 国債証券 | 6.0000 | 1,960   | 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   | 評価額    |            | 償還年月日      |
|                          |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |            |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| SPAIN 0.5 04/30/30       | 国債証券 | 0.5000 | 1,800  | 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 | -          |
| <b>(ユーロ…イタリア)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券 | 0.8500 | 1,710  | 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                       | 当    |        |       | 期     |         | 末          |
|--------------------------|------|--------|-------|-------|---------|------------|
|                          | 種類   | 利率     | 額面金額  | 評価額   |         | 償還年月日      |
|                          |      |        |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| (ユーロ…イタリア)               |      | %      | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40  | 国債証券 | 3.1000 | 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   |    | 償 | 還 | 年          | 月 | 日 |   |            |
|                          |   |   |   |   |        |         |     |   |         | 外   | 貨  |   |   |            |   |   | 建 | 金          |
| <b>(ユーロ…イタリア)</b>        |   |   |   | % |        | 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 |   |   |   | -          |
| <b>(ユーロ…フィンランド)</b>      |   |   |   | % |        | 千       | ユー  | ロ |         | 千   | ユー | ロ |   | 千          | 円 |   |   |            |
| FINLAND 0.125 04/15/52   | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.1250 | 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  |   |   |   | -          |
| <b>(ユーロ…オーストリア)</b>      |   |   |   | % |        | 千       | ユー  | ロ |         | 千   | ユー | ロ |   | 千          | 円 |   |   |            |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62     | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8000 | 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      |
|                       |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額      |            |
| (ユーロ…オーストリア)          |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円          |            |
| AUSTRIA 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          |   | %     |
| コーポレートローン等、その他 | 256,938,107 |   | 98.3  |
| 投資信託財産総額       | 4,534,468   |   | 1.7   |
|                | 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                  | 262,047,572,911円 |
| コ ー ル ・ 公 社 債 (評価額)      | 2,571,862,881    |
| 未 収 入 金 息 用 意            | 256,938,107,694  |
| 前 払 収 入 利 費              | 575,027,153      |
| 未 払 収 入 利 費              | 1,747,978,124    |
| (B) 負 債                  | 1,654,049,105    |
| 未 払 収 入 金 息              | 1,628,558,105    |
| 未 払 収 入 金 息              | 25,491,000       |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)       | 260,393,523,806  |
| 元 次 本 金                  | 112,140,675,109  |
| (D) 受 益 権 益 総 額          | 148,252,848,697  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 112,140,675.109円 |
|                          | 23,220円          |

|                                |                 |  |                  |
|--------------------------------|-----------------|--|------------------|
| (注1) 期首元本額                     | 92,568,430,085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      |
| 追加設定元本額                        | 57,122,203,209円 | D I AMパッシブ資産分散ファンド   | 989,890,513円     |
| 一部解約元本額                        | 37,549,958,225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     |
| (注2) 期末における元本の内訳               |                 | 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     |
| D I AM外国債券パッシブ・ファンド            | 6,936,625,396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      |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)         | 2,145,444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     |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)         | 13,898,297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         |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)         | 33,055,375円     | インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)                | 621,159,184円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)          | 29,463,237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     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)          | 42,934,640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     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)          | 28,209,559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     |
| たわらノーロード 先進国債券                 | 20,317,116,345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     |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>          | 129,335円        | D I AM海替フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)                   | 4,747,484,094円   |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)         | 3,175,860,175円  | D I AM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   |
| たわらノーロード バランス (堅実型)            | 70,372,889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   |
| たわらノーロード バランス (標準型)            | 393,159,511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   |
| たわらノーロード バランス (積極型)            | 90,074,981円     | AMO 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     |
| 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     | D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)                             | 43,680,338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  | 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     |
| 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  | D I AM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     |
| 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    | D I AM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     |
| 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    | D I AM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      |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)         | 1,181,174円      | D I AM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      |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)         | 12,367,147円     | D I AM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       |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)       | 192,544,517円    | D I AM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          |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)         | 20,620,422円     | D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)                           | 1,512,264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 AM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 AM外国債券インデックスファンド<DC年金>     | 6,881,458,772円  | D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)                             | 1,252,683,690円   |
| One DC 先進国債券インデックスファンド         | 1,443,766,551円  | D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)                           | 1,244,567,605円   |
| Oneグローバルバランス                   | 60,758,637円     | D I AM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 AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型      | 734,747,927円    | D I AM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 AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型   | 2,430,100,443円  | D I AM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 AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型      | 2,916,905,681円  | D I AM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 AM DC バランス30インデックスファンド     | 415,782,480円    | D I AM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 AM DC バランス50インデックスファンド     | 854,188,656円    | D I AM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 AM DC バランス70インデックスファンド     | 822,838,550円    | D I AM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     |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)          | 23,358,394円     | D I AM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     |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)            | 887,363,869円    | D I AM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     |
| 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 AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)                               | 33,520,121円      |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)  | 159,329,380円    | 動的パッケージファンド<DC年金>  | 48,713,270円      |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)  | 160,868,965円    | コア資産形成ファンド   | 24,325,247円      |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)  | 260,318,009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>                            | 4,593,798,610円   |
| クルーズコントロール                     | 1,073,014,665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  |
| D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>      | 182,522,998円    | MH AM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   |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>            | 854,009,676円    | MH AM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   |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>           | 699,203,724円    | 期末元本合計   | 112,140,675,109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      |  |                  |

## ■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   |   |
|     | その他の収益       | 5,079           |   |
|     | 支払利息         | △470,752        |   |
| (B) | 有価証券売買損益     | 26,829,583,002  |   |
|     | 売却益          | 30,605,561,933  |   |
|     | 売却損          | △3,775,978,931  |   |
| (C) | その他の費用       | △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) | 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。