

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |  |
|--------|--|--|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／債券／インデックス型  |  |
| 信託期間   | 無期限（2000年8月18日設定）  |  |
| 運用方針   | 外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマーク（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。   |  |
| 主要運用対象 | ベビード<br>ファンド   | 外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することもできません。 |
|        | マザー<br>ファンド  | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。              |
| 主な組入制限 | ベビード<br>ファンド   | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。  |
|        | マザー<br>ファンド  | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |
| 分配方針   | 毎年1回決算（原則として8月10日。ただし、8月10日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。原則として、配当等収益の水準を考慮して分配します。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。 |  |

## 運用報告書（全体版）

三菱UFJ  
外国債券オープン

第24期（決算日：2024年8月13日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
さて、お手持ちの「三菱UFJ 外国債券オープン」は、去る8月13日に第24期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル **0120-151034**  
（受付時間：営業日の9:00～17:00、  
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準<br>(分配落) | 標準価額        |        |             | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |             | 債<br>組<br>入<br>比<br>率 | 債<br>先<br>物<br>比<br>率 | 純<br>資<br>産<br>額 |        |
|-----------------|-------------|-------------|--------|-------------|-------------------------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------|--------|
|                 |             | 税<br>分<br>配 | 込<br>金 | 期<br>騰<br>落 | 中<br>率                              | 期<br>騰<br>落 |                       |                       |                  | 中<br>率 |
|                 | 円           |             | 円      |             | %                                   |             | %                     |                       | 百万円              |        |
| 20期(2020年8月11日) | 13,960      |             | 150    |             | 8.0                                 | 29,499.26   | 9.3                   | 97.8                  | —                | 2,863  |
| 21期(2021年8月10日) | 14,138      |             | 100    |             | 2.0                                 | 30,351.42   | 2.9                   | 97.7                  | —                | 2,569  |
| 22期(2022年8月10日) | 14,296      |             | 150    |             | 2.2                                 | 31,353.14   | 3.3                   | 98.8                  | —                | 2,263  |
| 23期(2023年8月10日) | 14,402      |             | 200    |             | 2.1                                 | 32,306.22   | 3.0                   | 98.4                  | —                | 2,219  |
| 24期(2024年8月13日) | 15,145      |             | 250    |             | 6.9                                 | 34,821.71   | 7.8                   | 98.0                  | —                | 2,070  |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、FTSE世界国債インデックス(除く日本)をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額     |        | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |        | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|-------------------------------------|--------|-----------|-----------|
|                     |             | 騰 落 率  |                                     | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2023年8月10日 | 円<br>14,402 | %<br>— | 32,306.22                           | %<br>— | %<br>98.4 | %<br>—    |
| 8月末                 | 14,546      | 1.0    | 32,624.92                           | 1.0    | 98.2      | —         |
| 9月末                 | 14,319      | △ 0.6  | 32,138.76                           | △ 0.5  | 98.3      | —         |
| 10月末                | 14,296      | △ 0.7  | 32,118.47                           | △ 0.6  | 98.0      | —         |
| 11月末                | 14,786      | 2.7    | 33,237.64                           | 2.9    | 98.4      | —         |
| 12月末                | 14,792      | 2.7    | 33,311.11                           | 3.1    | 98.3      | —         |
| 2024年1月末            | 15,044      | 4.5    | 33,855.53                           | 4.8    | 98.3      | —         |
| 2月末                 | 15,231      | 5.8    | 34,311.75                           | 6.2    | 98.2      | —         |
| 3月末                 | 15,415      | 7.0    | 34,773.36                           | 7.6    | 98.0      | —         |
| 4月末                 | 15,692      | 9.0    | 35,378.13                           | 9.5    | 97.9      | —         |
| 5月末                 | 15,767      | 9.5    | 35,602.71                           | 10.2   | 98.0      | —         |
| 6月末                 | 16,307      | 13.2   | 36,860.34                           | 14.1   | 98.1      | —         |
| 7月末                 | 15,695      | 9.0    | 35,464.23                           | 9.8    | 98.2      | —         |
| (期 末)<br>2024年8月13日 | 15,395      | 6.9    | 34,821.71                           | 7.8    | 98.0      | —         |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第24期：2023年8月11日～2024年8月13日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



|       |         |
|-------|---------|
| 第24期首 | 14,402円 |
| 第24期末 | 15,145円 |
| 既払分配金 | 250円    |
| 騰落率   | 6.9%    |

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

**基準価額の動き**

基準価額は期間の初めに比べ6.9%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

**ベンチマークとの差異**

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（7.8%）を0.9%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第24期：2023年8月11日～2024年8月13日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**先進国の債券市況は上昇しました。**

先進国の債券市況は、金融政策引き締め  
の長期化懸念等を背景とした金利上昇に  
より下落した後、景気の先行き懸念によ  
る利下げ期待等を背景とした金利低下に  
より上昇し、期間の初めとの比較では上  
昇しました。

### ▶ 為替市況

**米ドル、ユーロは対円で上昇しました。**

期間の初めに比べて米ドル、ユーロは対  
円で上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 三菱UFJ 外国債券オープン

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資  
したことにより、基準価額（分配金再投  
資ベース）はマザーファンドとほぼ同様  
の推移となりました。

### ▶ 外国債券インデックスマザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資  
対象とし、ベンチマークであるFTSE  
世界国債インデックス（除く日本、円換  
算ベース）に連動する投資成果をめざし  
て運用を行いました。

ベンチマークの動きに連動するべく、組  
入比率は高位に保ち、地域別配分や年限  
構成比がほぼ同様になるようにポート  
フォリオを構築しました。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

### ▶ 三菱UFJ 外国債券オープン

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.9\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.9\%$ 程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は $0.0\%$ 程度でした。

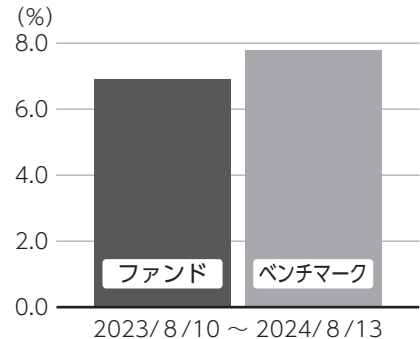
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**評価時価差異要因<sup>※</sup>によるものです。

<sup>※</sup>ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

**主なマイナス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

### 基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



<sup>※</sup>ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目             | 第24期<br>2023年8月11日～2024年8月13日 |
|----------------|-------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | 250 (1.624%)                  |
| 当期の収益          | 250                           |
| 当期の収益以外        | —                             |
| 翌期繰越分配対象額      | 5,770                         |

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

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

## 今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶ **三菱UFJ 外国債券オープン**  
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **外国債券インデックスマザーファンド**  
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。



2023年8月11日～2024年8月13日

## 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 当期     |         | 項目の概要   |
|-------------|--------|---------|---|
|             | 金額 (円) | 比率 (%)  |   |
| (a) 信託報酬    | 126    | 0.831   | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数) |
| ( 投 信 会 社 ) | (59)   | (0.388) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価    |
| ( 販 売 会 社 ) | (59)   | (0.388) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価          |
| ( 受 託 会 社 ) | (8)    | (0.055) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価            |
| (b) その他費用   | 2      | 0.011   | (b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数             |
| ( 保 管 費 用 ) | (2)    | (0.011) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用               |
| ( そ の 他 )   | (0)    | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用                            |
| 合 計         | 128    | 0.842   |   |

期中の平均基準価額は、15,141円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

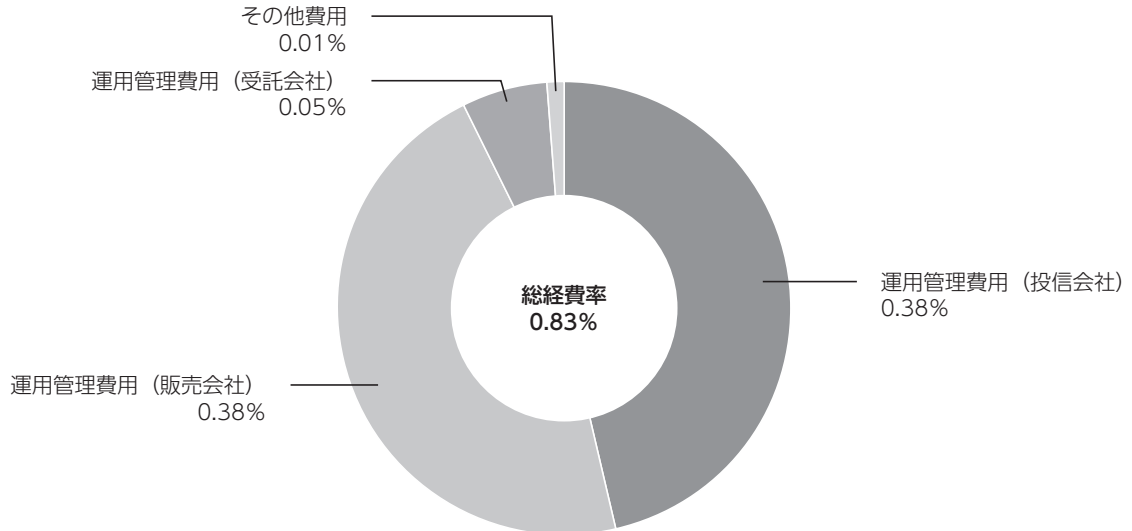
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## (参考情報)

### ■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.83%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ○売買及び取引の状況

(2023年8月11日～2024年8月13日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                | 設 定          |              | 解 約           |               |
|-------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
|                   | 口 数          | 金 額          | 口 数           | 金 額           |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口<br>34,082 | 千円<br>87,419 | 千口<br>155,815 | 千円<br>401,101 |

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年8月11日～2024年8月13日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ 外国債券オープン&gt;

該当事項はございません。

## &lt;外国債券インデックスマザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 為替直物取引 | 193,550   | 94,804             | 49.0          | 62,234    | 47,730             | 76.7          |

平均保有割合 0.4%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年8月13日現在)

## 親投資信託残高

| 銘柄                | 期首(前期末)       | 当 期 末         |                 |
|-------------------|---------------|---------------|-----------------|
|                   | 口 数           | 口 数           | 評 価 額           |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口<br>902,250 | 千口<br>780,517 | 千円<br>2,069,776 |

## ○投資信託財産の構成

(2024年8月13日現在)

| 項 目               | 当 期 末           |           |
|-------------------|-----------------|-----------|
|                   | 評 価 額           | 比 率       |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千円<br>2,069,776 | %<br>97.9 |
| コール・ローン等、その他      | 44,023          | 2.1       |
| 投資信託財産総額          | 2,113,799       | 100.0     |

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (639,950,588千円) の投資信託財産総額 (644,044,520千円) に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                       |                     |                      |                    |
|-----------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=147.34円      | 1 カナダドル=107.19円     | 1 メキシコペソ=7.7334円     | 1 ユーロ=161.04円      |
| 1 イギリスポンド=188.09円     | 1 スウェーデンクローネ=14.00円 | 1 ノルウェークローネ=13.63円   | 1 デンマーククローネ=21.58円 |
| 1 ポーランドズロチ=37.3936円   | 1 オーストラリアドル=96.95円  | 1 ニュージーランドドル=88.76円  | 1 シンガポールドル=111.26円 |
| 1 マレーシアリンギット=33.1041円 | 1 中国元=20.53円        | 1 イスラエルシェケル=38.8994円 |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月13日現在)

| 項 目                    | 当 期 末          |
|------------------------|----------------|
|                        | 円              |
| (A) 資産                 | 2,113,799,006  |
| コール・ローン等               | 9,435,312      |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 2,069,776,256  |
| 未収入金                   | 34,587,383     |
| 未収利息                   | 55             |
| (B) 負債                 | 43,246,461     |
| 未払収益分配金                | 34,178,042     |
| 未払解約金                  | 51             |
| 未払信託報酬                 | 9,068,368      |
| (C) 純資産総額(A-B)         | 2,070,552,545  |
| 元本                     | 1,367,121,704  |
| 次期繰越損益金                | 703,430,841    |
| (D) 受益権総口数             | 1,367,121,704口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)        | 15,145円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 1,541,422,577円  
 期中追加設定元本額 110,811,473円  
 期中一部解約元本額 285,112,346円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5145円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2023年8月11日～<br>2024年8月13日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 47,472,724円               |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 57,074,939円               |
| 収益調整金額                    | 542,488,354円              |
| 分配準備積立金額                  | 175,997,111円              |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 823,033,128円              |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 6,020円                    |
| 1万口当たり分配金額                | 250円                      |
| 収益分配金金額                   | 34,178,042円               |

## ○損益の状況 (2023年8月11日～2024年8月13日)

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 1,576          |
| 受取利息             | 2,050          |
| 支払利息             | △ 474          |
| (B) 有価証券売買損益     | 147,800,951    |
| 売買益              | 165,992,787    |
| 売買損              | △ 18,191,836   |
| (C) 信託報酬等        | △ 18,189,757   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 129,612,770    |
| (E) 前期繰越損益金      | 150,932,004    |
| (F) 追加信託差損益金     | 457,064,109    |
| (配当等相当額)         | ( 542,381,737) |
| (売買損益相当額)        | (△ 85,317,628) |
| (G) 計(D+E+F)     | 737,608,883    |
| (H) 収益分配金        | △ 34,178,042   |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 703,430,841    |
| 追加信託差損益金         | 457,064,109    |
| (配当等相当額)         | ( 542,488,354) |
| (売買損益相当額)        | (△ 85,424,245) |
| 分配準備積立金          | 246,366,732    |

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (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) (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。

## ○分配金のお知らせ

|                  |      |
|------------------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 250円 |
|------------------|------|

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金 (特別分配金)」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金 (特別分配金) となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金 (特別分配金) が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金 (特別分配金) を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

\* 三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

### 【お 知 ら せ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
(2023年10月1日)

## 外国債券インデックスマザーファンド

《第23期》決算日2024年5月13日

[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

|             |  |
|-------------|--|
| 運 用 方 針     | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 |
| 主 要 運 用 対 象 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。  |
| 主 な 組 入 制 限 | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |

### ○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、円換算ベース) |      | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|---------|------|---------------------------------|------|----------------|----------------|--------------|
|                 | 期 騰 落   | 中 率  | 期 騰 落                           | 中 率  |                |                |              |
|                 | 円       | %    |                                 | %    | %              | %              | 百万円          |
| 19期(2020年5月12日) | 21,324  | 4.5  | 119,287.72                      | 4.6  | 98.6           | —              | 149,310      |
| 20期(2021年5月12日) | 22,636  | 6.2  | 126,522.01                      | 6.1  | 97.7           | —              | 197,147      |
| 21期(2022年5月12日) | 23,133  | 2.2  | 129,384.40                      | 2.3  | 98.8           | —              | 302,225      |
| 22期(2023年5月12日) | 23,421  | 1.2  | 130,897.72                      | 1.2  | 98.5           | —              | 438,949      |
| 23期(2024年5月13日) | 26,985  | 15.2 | 150,774.68                      | 15.2 | 98.1           | —              | 633,684      |

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |       | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------------------------------|-------|-----------|-----------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                               | 騰 落 率 |           |           |
| (期 首)<br>2023年5月12日 | 円       | %     | 130,897.72                          | %     | %         | %         |
| 5月末                 | 23,421  | —     | 132,828.99                          | —     | 98.5      | —         |
| 6月末                 | 23,777  | 1.5   | 138,284.08                          | 1.5   | 98.4      | —         |
| 7月末                 | 24,729  | 5.6   | 135,227.94                          | 3.3   | 98.5      | —         |
| 8月末                 | 24,193  | 3.3   | 138,880.03                          | 6.1   | 98.2      | —         |
| 9月末                 | 24,855  | 6.1   | 136,810.50                          | 4.5   | 98.3      | —         |
| 10月末                | 24,483  | 4.5   | 136,724.14                          | 4.5   | 98.0      | —         |
| 11月末                | 24,461  | 4.4   | 141,488.31                          | 8.1   | 98.4      | —         |
| 12月末                | 25,316  | 8.1   | 141,801.08                          | 8.3   | 98.3      | —         |
| 2024年1月末            | 25,343  | 8.2   | 144,118.59                          | 10.1  | 98.3      | —         |
| 2月末                 | 25,795  | 10.1  | 146,060.66                          | 11.6  | 98.2      | —         |
| 3月末                 | 26,132  | 11.6  | 148,025.68                          | 13.1  | 98.0      | —         |
| 4月末                 | 26,465  | 13.0  | 150,600.10                          | 15.1  | 97.9      | —         |
| (期 末)<br>2024年5月13日 | 26,960  | 15.1  | 150,774.68                          | 15.2  | 98.1      | —         |
|                     | 26,985  | 15.2  |                                     |       |           | —         |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

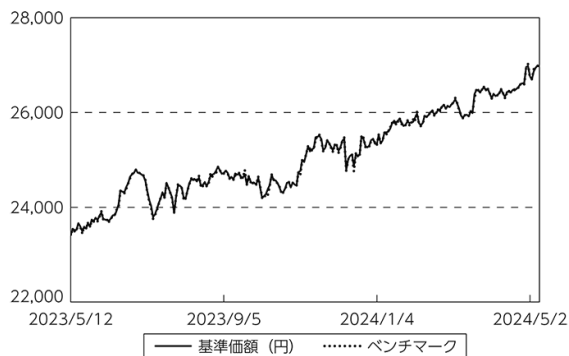
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ15.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(15.2%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。



● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

- ・ 先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により下落した後、中銀による利上げの打ち止め観測等を背景とした金利低下により反発し、期間の初めとの比較では上昇しました。

◎ 為替市況

- ・ 期間の初めに比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは15.2%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因<sup>※</sup>によるものです。

<sup>※</sup>ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ ありません。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                       |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                 |
| (a) そ の 他 費 用         | 円<br>3 | %<br>0.011 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数    |
| （ 保 管 費 用 ）           | (3)    | (0.011)    | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （ そ の 他 ）             | (0)    | (0.000)    | 信託事務の処理等に要するその他諸費用              |
| 合 計                   | 3      | 0.011      |                                 |
| 期中の平均基準価額は、25,112円です。 |        |            |                                 |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 公社債

|          |        | 買付額                            | 売付額                         |
|----------|--------|--------------------------------|-----------------------------|
| 外        | アメリカ   | 千アメリカドル<br>814,193             | 千アメリカドル<br>458,266          |
|          | カナダ    | 千カナダドル<br>42,271               | 千カナダドル<br>16,542            |
|          | メキシコ   | 千メキシコペソ<br>201,901             | 千メキシコペソ<br>125,620          |
|          | ユーロ    | 千ユーロ                           | 千ユーロ                        |
|          | ドイツ    | 国債証券<br>83,615                 | 48,446                      |
|          | イタリア   | 国債証券<br>81,503                 | 42,107                      |
|          | フランス   | 国債証券<br>90,465                 | 47,566                      |
|          | オランダ   | 国債証券<br>13,002                 | 3,824                       |
|          | スペイン   | 国債証券<br>70,161                 | 34,468                      |
|          | ベルギー   | 国債証券<br>19,150                 | 8,292                       |
|          | オーストリア | 国債証券<br>11,675                 | 5,336                       |
|          | フィンランド | 国債証券<br>5,786                  | 821                         |
|          | アイルランド | 国債証券<br>3,834                  | 2,962                       |
|          | イギリス   | 国債証券<br>千イギリスポンド<br>59,078     | 千イギリスポンド<br>15,129          |
|          | スウェーデン | 国債証券<br>千スウェーデンクローネ<br>17,392  | 千スウェーデンクローネ<br>931          |
|          | ノルウェー  | 国債証券<br>千ノルウェークローネ<br>22,343   | 千ノルウェークローネ<br>9,963         |
|          | デンマーク  | 国債証券<br>千デンマーククローネ<br>11,773   | 千デンマーククローネ<br>7,714         |
|          | 国      | ポーランド                          | 国債証券<br>千ポーランドズロチ<br>29,041 |
| オーストラリア  |        | 国債証券<br>千オーストラリアドル<br>18,851   | 千オーストラリアドル<br>12,388        |
| ニュージーランド |        | 国債証券<br>千ニュージーランドドル<br>6,218   | 千ニュージーランドドル<br>1,945        |
| シンガポール   |        | 国債証券<br>千シンガポールドル<br>5,272     | 千シンガポールドル<br>1,689          |
| マレーシア    |        | 国債証券<br>千マレーシアリングギット<br>26,121 | 千マレーシアリングギット<br>11,793      |
| 中国       |        | 国債証券<br>千中国元<br>1,872,942      | 千中国元<br>290,605             |
| イスラエル    |        | 国債証券<br>千イスラエルシェケル<br>26,234   | 千イスラエルシェケル<br>6,941         |

(注) 金額は受渡代金。(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5月13日～2024年5月13日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A |                    |                    | 売付額等<br>C |                    |                    |
|--------|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
|        |           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$<br>% |           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$<br>% |
|        | 百万円       | 百万円                | %                  | 百万円       | 百万円                | %                  |
| 為替先物取引 | 50,160    | 28,627             | 57.1               | 49,407    | 17,079             | 34.6               |
| 為替直物取引 | 178,901   | 88,096             | 49.2               | 58,151    | 41,961             | 72.2               |

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分      | 当 期 末                 |                       |                   |           |                 |           |           |          |
|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
|          | 額面金額                  | 評 価 額                 |                   | 組入比率      | うちBB格以下<br>組入比率 |           | 残存期間別組入比率 |          |
|          |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額            |           | %               | %         | 5年以上      | 2年以上     |
| アメリカ     | 千アメリカドル<br>2,101,330  | 千アメリカドル<br>1,864,030  | 千円<br>290,751,456 | %<br>45.9 | %<br>—          | %<br>19.5 | %<br>18.1 | %<br>8.3 |
| カナダ      | 千カナダドル<br>120,130     | 千カナダドル<br>109,972     | 12,539,117        | 2.0       | —               | 1.1       | 0.4       | 0.5      |
| メキシコ     | 千メキシコペソ<br>637,530    | 千メキシコペソ<br>573,744    | 5,335,597         | 0.8       | —               | 0.5       | 0.2       | 0.1      |
| ユーロ      | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |                   |           |                 |           |           |          |
| ドイツ      | 241,360               | 223,538               | 37,545,578        | 5.9       | —               | 3.4       | 1.7       | 0.9      |
| イタリア     | 283,020               | 270,408               | 45,417,781        | 7.2       | —               | 4.2       | 2.0       | 1.0      |
| フランス     | 320,960               | 292,949               | 49,203,800        | 7.8       | —               | 4.5       | 2.5       | 0.8      |
| オランダ     | 61,090                | 55,256                | 9,280,940         | 1.5       | —               | 0.9       | 0.4       | 0.1      |
| スペイン     | 197,020               | 184,761               | 31,032,496        | 4.9       | —               | 2.7       | 1.6       | 0.6      |
| ベルギー     | 71,790                | 65,924                | 11,072,709        | 1.7       | —               | 1.2       | 0.4       | 0.2      |
| オーストリア   | 48,190                | 42,987                | 7,220,099         | 1.1       | —               | 0.7       | 0.4       | 0.1      |
| フィンランド   | 22,740                | 19,868                | 3,337,158         | 0.5       | —               | 0.3       | 0.2       | 0.1      |
| アイルランド   | 21,630                | 18,869                | 3,169,284         | 0.5       | —               | 0.4       | 0.1       | —        |
| イギリス     | 千イギリスポンド<br>197,680   | 千イギリスポンド<br>162,906   | 31,805,788        | 5.0       | —               | 3.5       | 1.2       | 0.4      |
| スウェーデン   | 千スウェーデンクローネ<br>84,670 | 千スウェーデンクローネ<br>80,832 | 1,162,376         | 0.2       | —               | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| ノルウェー    | 千ノルウェークローネ<br>70,430  | 千ノルウェークローネ<br>64,751  | 929,829           | 0.1       | —               | 0.1       | 0.0       | 0.0      |
| デンマーク    | 千デンマーククローネ<br>75,720  | 千デンマーククローネ<br>71,022  | 1,599,416         | 0.3       | —               | 0.2       | 0.0       | 0.0      |
| ポーランド    | 千ポーランドズロチ<br>90,840   | 千ポーランドズロチ<br>83,538   | 3,260,658         | 0.5       | —               | 0.2       | 0.3       | 0.1      |
| オーストラリア  | 千オーストラリアドル<br>87,900  | 千オーストラリアドル<br>78,051  | 8,029,971         | 1.3       | —               | 0.8       | 0.3       | 0.1      |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル<br>18,240 | 千ニュージーランドドル<br>15,899 | 1,491,558         | 0.2       | —               | 0.2       | 0.1       | —        |
| シンガポール   | 千シンガポールドル<br>22,560   | 千シンガポールドル<br>21,295   | 2,451,736         | 0.4       | —               | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| マレーシア    | 千マレーシアリンギット<br>92,380 | 千マレーシアリンギット<br>93,847 | 3,086,150         | 0.5       | —               | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| 中国       | 千中国元<br>2,674,000     | 千中国元<br>2,774,135     | 59,846,705        | 9.4       | —               | 4.3       | 3.4       | 1.8      |
| イスラエル    | 千イスラエルシェケル<br>53,210  | 千イスラエルシェケル<br>47,839  | 2,009,481         | 0.3       | —               | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| 合 計      | —                     | —                     | 621,579,696       | 98.1      | —               | 49.5      | 33.6      | 15.0     |

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   | 銘柄   | 当 期 末               |         |         |        | 償還年月日     |            |
|------|------|---------------------|---------|---------|--------|-----------|------------|
|      |      | 利 率                 | 額面金額    | 評 価 額   |        |           |            |
|      |      |                     |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |           |            |
|      |      | %                   | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円     |           |            |
| アメリカ |      |                     |         |         |        |           |            |
|      | 国債証券 | 0.25 T-NOTE 250531  | 0.25    | 5,000   | 4,752  | 741,227   | 2025/5/31  |
|      |      | 0.25 T-NOTE 250630  | 0.25    | 6,650   | 6,300  | 982,688   | 2025/6/30  |
|      |      | 0.25 T-NOTE 250731  | 0.25    | 5,800   | 5,473  | 853,777   | 2025/7/31  |
|      |      | 0.25 T-NOTE 250831  | 0.25    | 6,700   | 6,299  | 982,586   | 2025/8/31  |
|      |      | 0.25 T-NOTE 250930  | 0.25    | 7,600   | 7,119  | 1,110,523 | 2025/9/30  |
|      |      | 0.25 T-NOTE 251031  | 0.25    | 10,300  | 9,613  | 1,499,466 | 2025/10/31 |
|      |      | 0.375 T-NOTE 251130 | 0.375   | 10,150  | 9,457  | 1,475,248 | 2025/11/30 |
|      |      | 0.375 T-NOTE 251231 | 0.375   | 8,500   | 7,893  | 1,231,286 | 2025/12/31 |
|      |      | 0.375 T-NOTE 260131 | 0.375   | 9,200   | 8,512  | 1,327,838 | 2026/1/31  |
|      |      | 0.375 T-NOTE 270731 | 0.375   | 7,150   | 6,246  | 974,325   | 2027/7/31  |
|      |      | 0.375 T-NOTE 270930 | 0.375   | 7,300   | 6,338  | 988,694   | 2027/9/30  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 260228   | 0.5     | 9,900   | 9,153  | 1,427,753 | 2026/2/28  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 270430   | 0.5     | 5,280   | 4,676  | 729,410   | 2027/4/30  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 270531   | 0.5     | 5,490   | 4,846  | 755,928   | 2027/5/31  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 270630   | 0.5     | 5,900   | 5,194  | 810,171   | 2027/6/30  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 270831   | 0.5     | 6,650   | 5,817  | 907,365   | 2027/8/31  |
|      |      | 0.5 T-NOTE 271031   | 0.5     | 8,590   | 7,466  | 1,164,638 | 2027/10/31 |
|      |      | 0.625 T-NOTE 260731 | 0.625   | 7,930   | 7,239  | 1,129,246 | 2026/7/31  |
|      |      | 0.625 T-NOTE 270331 | 0.625   | 3,800   | 3,390  | 528,844   | 2027/3/31  |
|      |      | 0.625 T-NOTE 271130 | 0.625   | 8,780   | 7,643  | 1,192,164 | 2027/11/30 |
|      |      | 0.625 T-NOTE 271231 | 0.625   | 8,630   | 7,490  | 1,168,379 | 2027/12/31 |
|      |      | 0.625 T-NOTE 300515 | 0.625   | 14,210  | 11,332 | 1,767,639 | 2030/5/15  |
|      |      | 0.625 T-NOTE 300815 | 0.625   | 17,350  | 13,709 | 2,138,468 | 2030/8/15  |
|      |      | 0.75 T-NOTE 260331  | 0.75    | 13,590  | 12,590 | 1,963,890 | 2026/3/31  |
|      |      | 0.75 T-NOTE 260430  | 0.75    | 9,200   | 8,496  | 1,325,343 | 2026/4/30  |
|      |      | 0.75 T-NOTE 260531  | 0.75    | 8,200   | 7,550  | 1,177,712 | 2026/5/31  |
|      |      | 0.75 T-NOTE 260831  | 0.75    | 10,100  | 9,220  | 1,438,227 | 2026/8/31  |
|      |      | 0.75 T-NOTE 280131  | 0.75    | 9,950   | 8,652  | 1,349,573 | 2028/1/31  |
|      |      | 0.875 T-NOTE 260630 | 0.875   | 8,300   | 7,644  | 1,192,454 | 2026/6/30  |
|      |      | 0.875 T-NOTE 260930 | 0.875   | 10,000  | 9,133  | 1,424,718 | 2026/9/30  |
|      |      | 0.875 T-NOTE 301115 | 0.875   | 22,310  | 17,813 | 2,778,493 | 2030/11/15 |
|      |      | 1 T-NOTE 280731     | 1.0     | 9,150   | 7,910  | 1,233,957 | 2028/7/31  |
|      |      | 1.125 T-BOND 400515 | 1.125   | 6,890   | 4,153  | 647,843   | 2040/5/15  |
|      |      | 1.125 T-BOND 400815 | 1.125   | 9,380   | 5,596  | 872,911   | 2040/8/15  |
|      |      | 1.125 T-NOTE 261031 | 1.125   | 10,450  | 9,575  | 1,493,542 | 2026/10/31 |
|      |      | 1.125 T-NOTE 270228 | 1.125   | 2,950   | 2,676  | 417,550   | 2027/2/28  |
|      |      | 1.125 T-NOTE 280229 | 1.125   | 9,760   | 8,589  | 1,339,799 | 2028/2/29  |
|      |      | 1.125 T-NOTE 280831 | 1.125   | 16,430  | 14,246 | 2,222,235 | 2028/8/31  |
|      |      | 1.125 T-NOTE 310215 | 1.125   | 17,120  | 13,827 | 2,156,747 | 2031/2/15  |
|      |      | 1.25 T-BOND 500515  | 1.25    | 10,720  | 5,202  | 811,493   | 2050/5/15  |
|      |      | 1.25 T-NOTE 261130  | 1.25    | 11,360  | 10,416 | 1,624,779 | 2026/11/30 |
|      |      | 1.25 T-NOTE 261231  | 1.25    | 8,200   | 7,502  | 1,170,267 | 2026/12/31 |
|      |      | 1.25 T-NOTE 280331  | 1.25    | 9,950   | 8,779  | 1,369,398 | 2028/3/31  |
|      |      | 1.25 T-NOTE 280430  | 1.25    | 9,740   | 8,573  | 1,337,232 | 2028/4/30  |
|      |      | 1.25 T-NOTE 280531  | 1.25    | 9,750   | 8,562  | 1,335,545 | 2028/5/31  |
|      |      | 1.25 T-NOTE 280630  | 1.25    | 9,680   | 8,479  | 1,322,654 | 2028/6/30  |

| 銘柄   | 銘柄                  | 当 期 末 |         |         |           | 償還年月日      |
|------|---------------------|-------|---------|---------|-----------|------------|
|      |                     | 利 率   | 額面金額    | 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        |            |
|      | 国債証券                |       |         |         |           |            |
|      | 1.25 T-NOTE 280930  | 1.25  | 10,700  | 9,306   | 1,451,659 | 2028/9/30  |
|      | 1.25 T-NOTE 310815  | 1.25  | 19,990  | 16,017  | 2,498,451 | 2031/8/15  |
|      | 1.375 T-BOND 401115 | 1.375 | 9,910   | 6,139   | 957,647   | 2040/11/15 |
|      | 1.375 T-BOND 500815 | 1.375 | 11,180  | 5,597   | 873,086   | 2050/8/15  |
|      | 1.375 T-NOTE 260831 | 1.375 | 3,800   | 3,519   | 549,033   | 2026/8/31  |
|      | 1.375 T-NOTE 281031 | 1.375 | 9,050   | 7,899   | 1,232,106 | 2028/10/31 |
|      | 1.375 T-NOTE 281231 | 1.375 | 8,700   | 7,558   | 1,179,048 | 2028/12/31 |
|      | 1.375 T-NOTE 311115 | 1.375 | 20,320  | 16,314  | 2,544,772 | 2031/11/15 |
|      | 1.5 T-NOTE 260815   | 1.5   | 9,740   | 9,058   | 1,412,957 | 2026/8/15  |
|      | 1.5 T-NOTE 270131   | 1.5   | 13,540  | 12,441  | 1,940,577 | 2027/1/31  |
|      | 1.5 T-NOTE 281130   | 1.5   | 9,700   | 8,497   | 1,325,446 | 2028/11/30 |
|      | 1.5 T-NOTE 300215   | 1.5   | 9,680   | 8,218   | 1,281,869 | 2030/2/15  |
|      | 1.625 T-BOND 501115 | 1.625 | 11,410  | 6,116   | 954,068   | 2050/11/15 |
|      | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625 | 9,760   | 9,220   | 1,438,248 | 2026/2/15  |
|      | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625 | 7,670   | 7,202   | 1,123,509 | 2026/5/15  |
|      | 1.625 T-NOTE 260930 | 1.625 | 5,500   | 5,115   | 797,938   | 2026/9/30  |
|      | 1.625 T-NOTE 261031 | 1.625 | 3,350   | 3,108   | 484,914   | 2026/10/31 |
|      | 1.625 T-NOTE 261130 | 1.625 | 3,400   | 3,147   | 490,971   | 2026/11/30 |
|      | 1.625 T-NOTE 290815 | 1.625 | 7,050   | 6,113   | 953,610   | 2029/8/15  |
|      | 1.625 T-NOTE 310515 | 1.625 | 16,640  | 13,807  | 2,153,662 | 2031/5/15  |
|      | 1.75 T-BOND 410815  | 1.75  | 14,850  | 9,657   | 1,506,411 | 2041/8/15  |
|      | 1.75 T-NOTE 261231  | 1.75  | 4,700   | 4,358   | 679,812   | 2026/12/31 |
|      | 1.75 T-NOTE 290131  | 1.75  | 10,040  | 8,860   | 1,382,060 | 2029/1/31  |
|      | 1.75 T-NOTE 291115  | 1.75  | 5,150   | 4,479   | 698,648   | 2029/11/15 |
|      | 1.875 T-BOND 410215 | 1.875 | 10,700  | 7,195   | 1,122,327 | 2041/2/15  |
|      | 1.875 T-BOND 510215 | 1.875 | 12,560  | 7,188   | 1,121,207 | 2051/2/15  |
|      | 1.875 T-BOND 511115 | 1.875 | 13,630  | 7,748   | 1,208,626 | 2051/11/15 |
|      | 1.875 T-NOTE 260630 | 1.875 | 5,100   | 4,799   | 748,576   | 2026/6/30  |
|      | 1.875 T-NOTE 260731 | 1.875 | 5,500   | 5,165   | 805,645   | 2026/7/31  |
|      | 1.875 T-NOTE 270228 | 1.875 | 9,120   | 8,450   | 1,318,042 | 2027/2/28  |
|      | 1.875 T-NOTE 290228 | 1.875 | 7,800   | 6,912   | 1,078,226 | 2029/2/28  |
|      | 1.875 T-NOTE 320215 | 1.875 | 16,860  | 13,984  | 2,181,263 | 2032/2/15  |
|      | 2 T-BOND 411115     | 2.0   | 10,220  | 6,913   | 1,078,300 | 2041/11/15 |
|      | 2 T-BOND 500215     | 2.0   | 8,590   | 5,121   | 798,844   | 2050/2/15  |
|      | 2 T-BOND 510815     | 2.0   | 12,060  | 7,096   | 1,106,920 | 2051/8/15  |
|      | 2 T-NOTE 250815     | 2.0   | 8,600   | 8,283   | 1,292,067 | 2025/8/15  |
|      | 2 T-NOTE 261115     | 2.0   | 8,680   | 8,122   | 1,266,907 | 2026/11/15 |
|      | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 6,970   | 6,766   | 1,055,381 | 2025/5/15  |
|      | 2.125 T-NOTE 260531 | 2.125 | 5,000   | 4,737   | 738,985   | 2026/5/31  |
|      | 2.25 T-BOND 410515  | 2.25  | 9,320   | 6,638   | 1,035,416 | 2041/5/15  |
|      | 2.25 T-BOND 460815  | 2.25  | 5,730   | 3,759   | 586,463   | 2046/8/15  |
|      | 2.25 T-BOND 490815  | 2.25  | 6,950   | 4,418   | 689,183   | 2049/8/15  |
|      | 2.25 T-BOND 520215  | 2.25  | 10,280  | 6,421   | 1,001,576 | 2052/2/15  |
|      | 2.25 T-NOTE 251115  | 2.25  | 10,290  | 9,882   | 1,541,459 | 2025/11/15 |
|      | 2.25 T-NOTE 260331  | 2.25  | 4,500   | 4,289   | 669,062   | 2026/3/31  |
|      | 2.25 T-NOTE 270215  | 2.25  | 6,810   | 6,382   | 995,523   | 2027/2/15  |
|      | 2.25 T-NOTE 270815  | 2.25  | 12,190  | 11,317  | 1,765,327 | 2027/8/15  |

| 銘柄   | 銘柄                  | 当 期 末               |         |         |           | 償還年月日      |            |
|------|---------------------|---------------------|---------|---------|-----------|------------|------------|
|      |                     | 利 率                 | 額面金額    | 評 価 額   |           |            |            |
|      |                     |                     |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |            |            |
|      |                     | %                   | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |            |
| アメリカ | 国債証券                | 2.25 T-NOTE 271115  | 2.25    | 7,500   | 6,928     | 1,080,763  | 2027/11/15 |
|      |                     | 2.375 T-BOND 420215 | 2.375   | 8,920   | 6,396     | 997,798    | 2042/2/15  |
|      |                     | 2.375 T-BOND 491115 | 2.375   | 6,600   | 4,310     | 672,310    | 2049/11/15 |
|      |                     | 2.375 T-BOND 510515 | 2.375   | 12,850  | 8,302     | 1,295,071  | 2051/5/15  |
|      |                     | 2.375 T-NOTE 260430 | 2.375   | 4,000   | 3,815     | 595,063    | 2026/4/30  |
|      |                     | 2.375 T-NOTE 270515 | 2.375   | 9,070   | 8,492     | 1,324,604  | 2027/5/15  |
|      |                     | 2.375 T-NOTE 290331 | 2.375   | 7,500   | 6,794     | 1,059,810  | 2029/3/31  |
|      |                     | 2.375 T-NOTE 290515 | 2.375   | 8,510   | 7,696     | 1,200,458  | 2029/5/15  |
|      |                     | 2.5 T-BOND 450215   | 2.5     | 5,050   | 3,548     | 553,512    | 2045/2/15  |
|      |                     | 2.5 T-BOND 460215   | 2.5     | 5,410   | 3,755     | 585,850    | 2046/2/15  |
|      |                     | 2.5 T-BOND 460515   | 2.5     | 4,210   | 2,915     | 454,696    | 2046/5/15  |
|      |                     | 2.5 T-NOTE 260228   | 2.5     | 3,450   | 3,307     | 515,859    | 2026/2/28  |
|      |                     | 2.5 T-NOTE 270331   | 2.5     | 7,700   | 7,253     | 1,131,329  | 2027/3/31  |
|      |                     | 2.625 T-NOTE 251231 | 2.625   | 3,200   | 3,083     | 480,974    | 2025/12/31 |
|      |                     | 2.625 T-NOTE 260131 | 2.625   | 3,900   | 3,752     | 585,284    | 2026/1/31  |
|      |                     | 2.625 T-NOTE 270531 | 2.625   | 7,900   | 7,444     | 1,161,267  | 2027/5/31  |
|      |                     | 2.625 T-NOTE 290215 | 2.625   | 9,640   | 8,856     | 1,381,505  | 2029/2/15  |
|      |                     | 2.625 T-NOTE 290731 | 2.625   | 6,790   | 6,196     | 966,453    | 2029/7/31  |
|      |                     | 2.75 T-BOND 420815  | 2.75    | 2,520   | 1,906     | 297,397    | 2042/8/15  |
|      |                     | 2.75 T-BOND 421115  | 2.75    | 3,700   | 2,791     | 435,414    | 2042/11/15 |
|      |                     | 2.75 T-BOND 470815  | 2.75    | 5,190   | 3,725     | 581,031    | 2047/8/15  |
|      |                     | 2.75 T-BOND 471115  | 2.75    | 5,710   | 4,090     | 638,064    | 2047/11/15 |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 250630  | 2.75    | 2,370   | 2,309     | 360,214    | 2025/6/30  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 250831  | 2.75    | 4,050   | 3,932     | 613,458    | 2025/8/31  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 270430  | 2.75    | 10,100  | 9,566     | 1,492,135  | 2027/4/30  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 270731  | 2.75    | 7,650   | 7,219     | 1,126,080  | 2027/7/31  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 280215  | 2.75    | 9,990   | 9,355     | 1,459,267  | 2028/2/15  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 290531  | 2.75    | 7,160   | 6,589     | 1,027,885  | 2029/5/31  |
|      |                     | 2.75 T-NOTE 320815  | 2.75    | 17,340  | 15,254    | 2,379,337  | 2032/8/15  |
|      |                     | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875   | 4,680   | 3,584     | 559,066    | 2043/5/15  |
|      |                     | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875   | 3,500   | 2,618     | 408,509    | 2045/8/15  |
|      |                     | 2.875 T-BOND 461115 | 2.875   | 2,340   | 1,731     | 270,094    | 2046/11/15 |
|      |                     | 2.875 T-BOND 490515 | 2.875   | 8,570   | 6,232     | 972,171    | 2049/5/15  |
|      | 2.875 T-BOND 520515 | 2.875               | 10,840  | 7,805   | 1,217,458 | 2052/5/15  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 250531 | 2.875               | 4,230   | 4,132   | 644,647   | 2025/5/31  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 250615 | 2.875               | 7,800   | 7,616   | 1,187,962 | 2025/6/15  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 250731 | 2.875               | 6,100   | 5,943   | 927,096   | 2025/7/31  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 251130 | 2.875               | 3,800   | 3,680   | 574,155   | 2025/11/30 |            |
|      | 2.875 T-NOTE 280515 | 2.875               | 11,990  | 11,248  | 1,754,554 | 2028/5/15  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 280815 | 2.875               | 10,310  | 9,642   | 1,504,000 | 2028/8/15  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 290430 | 2.875               | 7,000   | 6,488   | 1,012,124 | 2029/4/30  |            |
|      | 2.875 T-NOTE 320515 | 2.875               | 17,030  | 15,172  | 2,366,632 | 2032/5/15  |            |
|      | 3 T-BOND 420515     | 3.0                 | 2,270   | 1,792   | 279,608   | 2042/5/15  |            |
|      | 3 T-BOND 441115     | 3.0                 | 3,900   | 3,003   | 468,431   | 2044/11/15 |            |
|      | 3 T-BOND 450515     | 3.0                 | 2,790   | 2,138   | 333,595   | 2045/5/15  |            |
|      | 3 T-BOND 451115     | 3.0                 | 2,000   | 1,527   | 238,210   | 2045/11/15 |            |
|      | 3 T-BOND 470215     | 3.0                 | 4,590   | 3,468   | 540,960   | 2047/2/15  |            |



| 銘柄   | 銘柄                  | 利率    | 当<br>額面金額 | 期 末     |           | 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        |            |
| 国債証券 | 3 T-BOND 470515     | 3.0   | 3,990     | 3,009   | 469,371   | 2047/5/15  |
|      | 3 T-BOND 480215     | 3.0   | 5,970     | 4,477   | 698,364   | 2048/2/15  |
|      | 3 T-BOND 480815     | 3.0   | 7,070     | 5,286   | 824,542   | 2048/8/15  |
|      | 3 T-BOND 490215     | 3.0   | 7,450     | 5,558   | 867,044   | 2049/2/15  |
|      | 3 T-BOND 520815     | 3.0   | 9,700     | 7,167   | 1,117,910 | 2052/8/15  |
|      | 3 T-NOTE 250715     | 3.0   | 6,700     | 6,542   | 1,020,429 | 2025/7/15  |
|      | 3 T-NOTE 250930     | 3.0   | 5,400     | 5,254   | 819,606   | 2025/9/30  |
|      | 3 T-NOTE 251031     | 3.0   | 3,300     | 3,207   | 500,277   | 2025/10/31 |
|      | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125 | 1,990     | 1,613   | 251,703   | 2041/11/15 |
|      | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125 | 2,200     | 1,777   | 277,232   | 2042/2/15  |
|      | 3.125 T-BOND 430215 | 3.125 | 3,160     | 2,523   | 393,624   | 2043/2/15  |
|      | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 5,680     | 4,476   | 698,286   | 2044/8/15  |
|      | 3.125 T-BOND 480515 | 3.125 | 7,240     | 5,549   | 865,587   | 2048/5/15  |
|      | 3.125 T-NOTE 250815 | 3.125 | 5,000     | 4,883   | 761,682   | 2025/8/15  |
|      | 3.125 T-NOTE 270831 | 3.125 | 7,300     | 6,963   | 1,086,235 | 2027/8/31  |
|      | 3.125 T-NOTE 281115 | 3.125 | 9,380     | 8,838   | 1,378,564 | 2028/11/15 |
|      | 3.125 T-NOTE 290831 | 3.125 | 5,900     | 5,514   | 860,086   | 2029/8/31  |
|      | 3.25 T-BOND 420515  | 3.25  | 9,570     | 7,848   | 1,224,183 | 2042/5/15  |
|      | 3.25 T-NOTE 270630  | 3.25  | 8,090     | 7,762   | 1,210,811 | 2027/6/30  |
|      | 3.25 T-NOTE 290630  | 3.25  | 6,170     | 5,810   | 906,269   | 2029/6/30  |
|      | 3.375 T-BOND 420815 | 3.375 | 6,370     | 5,307   | 827,922   | 2042/8/15  |
|      | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375 | 3,380     | 2,777   | 433,282   | 2044/5/15  |
|      | 3.375 T-BOND 481115 | 3.375 | 8,120     | 6,500   | 1,013,988 | 2048/11/15 |
|      | 3.375 T-NOTE 330515 | 3.375 | 16,100    | 14,757  | 2,301,841 | 2033/5/15  |
|      | 3.5 T-BOND 390215   | 3.5   | 1,490     | 1,323   | 206,450   | 2039/2/15  |
|      | 3.5 T-NOTE 250915   | 3.5   | 7,900     | 7,742   | 1,207,645 | 2025/9/15  |
|      | 3.5 T-NOTE 280131   | 3.5   | 9,030     | 8,692   | 1,355,790 | 2028/1/31  |
|      | 3.5 T-NOTE 280430   | 3.5   | 6,900     | 6,631   | 1,034,346 | 2028/4/30  |
|      | 3.5 T-NOTE 300131   | 3.5   | 5,800     | 5,502   | 858,354   | 2030/1/31  |
|      | 3.5 T-NOTE 300430   | 3.5   | 5,600     | 5,304   | 827,442   | 2030/4/30  |
|      | 3.5 T-NOTE 330215   | 3.5   | 17,690    | 16,405  | 2,558,968 | 2033/2/15  |
|      | 3.625 T-BOND 430815 | 3.625 | 3,400     | 2,915   | 454,821   | 2043/8/15  |
|      | 3.625 T-BOND 440215 | 3.625 | 3,870     | 3,308   | 516,020   | 2044/2/15  |
|      | 3.625 T-BOND 530215 | 3.625 | 9,740     | 8,141   | 1,269,875 | 2053/2/15  |
|      | 3.625 T-BOND 530515 | 3.625 | 10,160    | 8,494   | 1,325,036 | 2053/5/15  |
|      | 3.625 T-NOTE 260515 | 3.625 | 7,000     | 6,836   | 1,066,376 | 2026/5/15  |
|      | 3.625 T-NOTE 280331 | 3.625 | 6,000     | 5,796   | 904,074   | 2028/3/31  |
|      | 3.625 T-NOTE 280531 | 3.625 | 6,600     | 6,370   | 993,617   | 2028/5/31  |
|      | 3.625 T-NOTE 300331 | 3.625 | 5,500     | 5,248   | 818,648   | 2030/3/31  |
|      | 3.75 T-BOND 410815  | 3.75  | 2,060     | 1,831   | 285,672   | 2041/8/15  |
|      | 3.75 T-BOND 431115  | 3.75  | 4,830     | 4,212   | 657,062   | 2043/11/15 |
|      | 3.75 T-NOTE 260415  | 3.75  | 7,000     | 6,856   | 1,069,447 | 2026/4/15  |
|      | 3.75 T-NOTE 281231  | 3.75  | 10,260    | 9,924   | 1,547,999 | 2028/12/31 |
|      | 3.75 T-NOTE 300531  | 3.75  | 5,600     | 5,374   | 838,343   | 2030/5/31  |
|      | 3.75 T-NOTE 300630  | 3.75  | 6,250     | 5,995   | 935,137   | 2030/6/30  |
|      | 3.75 T-NOTE 301231  | 3.75  | 6,660     | 6,372   | 994,027   | 2030/12/31 |
|      | 3.875 T-BOND 400815 | 3.875 | 2,560     | 2,336   | 364,392   | 2040/8/15  |

| 銘柄   | 銘柄   | 利率    | 当<br>期<br>額面金額 | 期<br>末<br>評<br>価<br>額 |        | 償還年月日     |            |
|------|------|-------|----------------|-----------------------|--------|-----------|------------|
|      |      |       |                | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額 |           |            |
|      |      |       |                |                       |        |           | 千アメリカドル    |
| アメリカ |      | %     | 千アメリカドル        | 千アメリカドル               | 千円     |           |            |
|      | 国債証券 | 3.875 | T-BOND 430215  | 6,740                 | 6,013  | 937,981   | 2043/2/15  |
|      |      | 3.875 | T-BOND 430515  | 6,920                 | 6,165  | 961,640   | 2043/5/15  |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 260115  | 6,700                 | 6,585  | 1,027,165 | 2026/1/15  |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 271130  | 6,900                 | 6,732  | 1,050,196 | 2027/11/30 |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 271231  | 7,000                 | 6,829  | 1,065,203 | 2027/12/31 |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 290930  | 6,030                 | 5,843  | 911,497   | 2029/9/30  |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 291130  | 6,190                 | 5,993  | 934,853   | 2029/11/30 |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 291231  | 5,700                 | 5,516  | 860,537   | 2029/12/31 |
|      |      | 3.875 | T-NOTE 330815  | 18,320                | 17,442 | 2,720,647 | 2033/8/15  |
|      |      | 4.0   | T-BOND 421115  | 6,840                 | 6,220  | 970,340   | 2042/11/15 |
|      |      | 4.0   | T-BOND 521115  | 9,790                 | 8,772  | 1,368,285 | 2052/11/15 |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 251215  | 7,750                 | 7,632  | 1,190,547 | 2025/12/15 |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 260215  | 8,000                 | 7,875  | 1,228,391 | 2026/2/15  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 270115  | 12,300                | 12,079 | 1,884,154 | 2027/1/15  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 280229  | 7,640                 | 7,481  | 1,167,015 | 2028/2/29  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 280630  | 8,990                 | 8,797  | 1,372,270 | 2028/6/30  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 290131  | 10,050                | 9,824  | 1,532,358 | 2029/1/31  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 291031  | 6,600                 | 6,432  | 1,003,288 | 2029/10/31 |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 300228  | 7,330                 | 7,136  | 1,113,097 | 2030/2/28  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 300731  | 5,400                 | 5,250  | 818,931   | 2030/7/31  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 310131  | 6,950                 | 6,747  | 1,052,428 | 2031/1/31  |
|      |      | 4.0   | T-NOTE 340215  | 20,450                | 19,633 | 3,062,448 | 2034/2/15  |
|      |      | 4.125 | T-BOND 530815  | 10,700                | 9,795  | 1,527,969 | 2053/8/15  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 260615  | 7,000                 | 6,901  | 1,076,420 | 2026/6/15  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 270215  | 9,500                 | 9,358  | 1,459,814 | 2027/2/15  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 270930  | 7,440                 | 7,323  | 1,142,358 | 2027/9/30  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 271031  | 6,500                 | 6,395  | 997,592   | 2027/10/31 |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 280731  | 7,700                 | 7,570  | 1,180,848 | 2028/7/31  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 290331  | 7,500                 | 7,369  | 1,149,469 | 2029/3/31  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 300831  | 7,100                 | 6,948  | 1,083,859 | 2030/8/31  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 310331  | 5,400                 | 5,279  | 823,472   | 2031/3/31  |
|      |      | 4.125 | T-NOTE 321115  | 16,070                | 15,636 | 2,439,037 | 2032/11/15 |
|      |      | 4.25  | T-BOND 390515  | 1,770                 | 1,706  | 266,227   | 2039/5/15  |
|      |      | 4.25  | T-BOND 401115  | 1,980                 | 1,888  | 294,556   | 2040/11/15 |
|      |      | 4.25  | T-BOND 540215  | 10,660                | 9,979  | 1,556,616 | 2054/2/15  |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 251015  | 6,000                 | 5,935  | 925,844   | 2025/10/15 |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 251231  | 13,580                | 13,426 | 2,094,213 | 2025/12/31 |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 260131  | 9,390                 | 9,282  | 1,447,946 | 2026/1/31  |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 270315  | 14,000                | 13,839 | 2,158,641 | 2027/3/15  |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 290228  | 11,330                | 11,197 | 1,746,612 | 2029/2/28  |
|      |      | 4.25  | T-NOTE 310228  | 8,180                 | 8,059  | 1,257,176 | 2031/2/28  |
|      |      | 4.375 | T-BOND 380215  | 1,280                 | 1,263  | 197,092   | 2038/2/15  |
|      |      | 4.375 | T-BOND 391115  | 2,270                 | 2,212  | 345,132   | 2039/11/15 |
|      |      | 4.375 | T-BOND 400515  | 2,080                 | 2,021  | 315,326   | 2040/5/15  |
|      |      | 4.375 | T-BOND 410515  | 1,960                 | 1,892  | 295,199   | 2041/5/15  |
|      |      | 4.375 | T-BOND 430815  | 7,570                 | 7,218  | 1,125,881 | 2043/8/15  |
|      |      | 4.375 | T-NOTE 260815  | 7,600                 | 7,529  | 1,174,519 | 2026/8/15  |

| 銘柄   |                      | 利 率   | 当 期 末   |         |             |            | 償還年月日 |
|------|----------------------|-------|---------|---------|-------------|------------|-------|
|      |                      |       | 額面金額    | 評 価 額   |             | 千円         |       |
|      |                      |       |         | 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 |             |            |       |
| 国債証券 | 4.375 T-NOTE 261215  | 4.375 | 9,640   | 9,556   | 1,490,695   | 2026/12/15 |       |
|      | 4.375 T-NOTE 280831  | 4.375 | 7,000   | 6,949   | 1,083,905   | 2028/8/31  |       |
|      | 4.375 T-NOTE 281130  | 4.375 | 9,310   | 9,247   | 1,442,360   | 2028/11/30 |       |
|      | 4.375 T-NOTE 301130  | 4.375 | 6,250   | 6,201   | 967,239     | 2030/11/30 |       |
|      | 4.5 T-BOND 360215    | 4.5   | 1,160   | 1,173   | 182,965     | 2036/2/15  |       |
|      | 4.5 T-BOND 380515    | 4.5   | 1,330   | 1,327   | 207,052     | 2038/5/15  |       |
|      | 4.5 T-BOND 390815    | 4.5   | 1,880   | 1,861   | 290,367     | 2039/8/15  |       |
|      | 4.5 T-BOND 440215    | 4.5   | 5,350   | 5,184   | 808,675     | 2044/2/15  |       |
|      | 4.5 T-NOTE 251115    | 4.5   | 4,700   | 4,665   | 727,707     | 2025/11/15 |       |
|      | 4.5 T-NOTE 260331    | 4.5   | 2,280   | 2,263   | 353,092     | 2026/3/31  |       |
|      | 4.5 T-NOTE 260715    | 4.5   | 6,500   | 6,456   | 1,007,077   | 2026/7/15  |       |
|      | 4.5 T-NOTE 270415    | 4.5   | 13,000  | 12,937  | 2,017,918   | 2027/4/15  |       |
|      | 4.5 T-NOTE 331115    | 4.5   | 19,430  | 19,410  | 3,027,613   | 2033/11/15 |       |
|      | 4.625 T-BOND 400215  | 4.625 | 2,100   | 2,103   | 328,057     | 2040/2/15  |       |
|      | 4.625 T-NOTE 260228  | 4.625 | 19,800  | 19,699  | 3,072,781   | 2026/2/28  |       |
|      | 4.625 T-NOTE 260315  | 4.625 | 6,000   | 5,971   | 931,438     | 2026/3/15  |       |
|      | 4.625 T-NOTE 260915  | 4.625 | 7,500   | 7,473   | 1,165,645   | 2026/9/15  |       |
|      | 4.625 T-NOTE 261015  | 4.625 | 6,800   | 6,777   | 1,057,225   | 2026/10/15 |       |
|      | 4.625 T-NOTE 261115  | 4.625 | 8,720   | 8,694   | 1,356,160   | 2026/11/15 |       |
|      | 4.625 T-NOTE 280930  | 4.625 | 8,030   | 8,049   | 1,255,601   | 2028/9/30  |       |
|      | 4.625 T-NOTE 300930  | 4.625 | 5,700   | 5,734   | 894,538     | 2030/9/30  |       |
|      | 4.75 T-BOND 410215   | 4.75  | 2,010   | 2,032   | 317,010     | 2041/2/15  |       |
|      | 4.75 T-BOND 431115   | 4.75  | 6,220   | 6,226   | 971,180     | 2043/11/15 |       |
|      | 4.75 T-BOND 531115   | 4.75  | 10,670  | 10,849  | 1,692,261   | 2053/11/15 |       |
|      | 4.75 T-NOTE 250731   | 4.75  | 7,500   | 7,470   | 1,165,303   | 2025/7/31  |       |
|      | 4.875 T-NOTE 251130  | 4.875 | 8,400   | 8,384   | 1,307,749   | 2025/11/30 |       |
|      | 4.875 T-NOTE 281031  | 4.875 | 8,500   | 8,609   | 1,342,843   | 2028/10/31 |       |
|      | 4.875 T-NOTE 301031  | 4.875 | 6,100   | 6,222   | 970,507     | 2030/10/31 |       |
|      | 5 T-BOND 370515      | 5.0   | 1,020   | 1,075   | 167,682     | 2037/5/15  |       |
|      | 5 T-NOTE 250831      | 5.0   | 8,500   | 8,493   | 1,324,794   | 2025/8/31  |       |
|      | 5 T-NOTE 250930      | 5.0   | 7,600   | 7,595   | 1,184,707   | 2025/9/30  |       |
|      | 5 T-NOTE 251031      | 5.0   | 9,500   | 9,496   | 1,481,317   | 2025/10/31 |       |
|      | 5.25 T-BOND 281115   | 5.25  | 2,690   | 2,768   | 431,764     | 2028/11/15 |       |
|      | 5.375 T-BOND 310215  | 5.375 | 1,300   | 1,373   | 214,180     | 2031/2/15  |       |
|      | 6 T-BOND 260215      | 6.0   | 1,200   | 1,225   | 191,131     | 2026/2/15  |       |
|      | 6.125 T-BOND 271115  | 6.125 | 1,160   | 1,216   | 189,771     | 2027/11/15 |       |
|      | 6.25 T-BOND 300515   | 6.25  | 1,150   | 1,253   | 195,534     | 2030/5/15  |       |
| 小 計  |                      |       |         |         | 290,751,456 |            |       |
| カナダ  |                      |       | 千カナダドル  | 千カナダドル  |             |            |       |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 260301 | 0.25  | 2,200   | 2,047   | 233,505     | 2026/3/1   |       |
|      | 0.5 CAN GOVT 250901  | 0.5   | 2,900   | 2,755   | 314,166     | 2025/9/1   |       |
|      | 0.5 CAN GOVT 301201  | 0.5   | 4,500   | 3,673   | 418,811     | 2030/12/1  |       |
|      | 1 CAN GOVT 260901    | 1.0   | 2,500   | 2,328   | 265,505     | 2026/9/1   |       |
|      | 1 CAN GOVT 270601    | 1.0   | 1,930   | 1,769   | 201,766     | 2027/6/1   |       |
|      | 1.25 CAN GOVT 270301 | 1.25  | 2,500   | 2,317   | 264,215     | 2027/3/1   |       |
|      | 1.25 CAN GOVT 300601 | 1.25  | 4,410   | 3,829   | 436,656     | 2030/6/1   |       |
|      | 1.5 CAN GOVT 260601  | 1.5   | 4,070   | 3,854   | 439,538     | 2026/6/1   |       |

| 銘柄   | 銘柄   | 当 期 末                    |         |         |        |            | 償還年月日      |
|------|------|--------------------------|---------|---------|--------|------------|------------|
|      |      | 利 率                      | 額面金額    | 評 価 額   |        |            |            |
|      |      |                          |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |            |            |
| カナダ  |      | %                        | 千カナダドル  | 千カナダドル  | 千円     |            |            |
|      | 国債証券 | 1.5 CAN GOVT 310601      | 1.5     | 5,900   | 5,102  | 581,775    | 2031/6/1   |
|      |      | 1.5 CAN GOVT 311201      | 1.5     | 4,930   | 4,220  | 481,168    | 2031/12/1  |
|      |      | 1.75 CAN GOVT 531201     | 1.75    | 5,550   | 3,733  | 425,720    | 2053/12/1  |
|      |      | 2 CAN GOVT 280601        | 2.0     | 2,670   | 2,495  | 284,529    | 2028/6/1   |
|      |      | 2 CAN GOVT 320601        | 2.0     | 5,350   | 4,720  | 538,259    | 2032/6/1   |
|      |      | 2 CAN GOVT 511201        | 2.0     | 7,140   | 5,183  | 590,982    | 2051/12/1  |
|      |      | 2.25 CAN GOVT 250601     | 2.25    | 4,360   | 4,257  | 485,447    | 2025/6/1   |
|      |      | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2.25    | 2,210   | 2,068  | 235,876    | 2029/6/1   |
|      |      | 2.25 CAN GOVT 291201     | 2.25    | 1,000   | 931    | 106,211    | 2029/12/1  |
|      |      | 2.5 CAN GOVT 321201      | 2.5     | 3,500   | 3,194  | 364,224    | 2032/12/1  |
|      |      | 2.75 CAN GOVT 270901     | 2.75    | 2,000   | 1,927  | 219,828    | 2027/9/1   |
|      |      | 2.75 CAN GOVT 330601     | 2.75    | 3,000   | 2,783  | 317,416    | 2033/6/1   |
|      |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 2.75    | 1,680   | 1,453  | 165,767    | 2048/12/1  |
|      |      | 2.75 CAN GOVT 551201     | 2.75    | 2,590   | 2,210  | 252,015    | 2055/12/1  |
|      |      | 2.75 CANADA GOWER 641201 | 2.75    | 1,250   | 1,053  | 120,151    | 2064/12/1  |
|      |      | 3 CAN GOVT 251001        | 3.0     | 3,000   | 2,939  | 335,108    | 2025/10/1  |
|      |      | 3 CAN GOVT 340601        | 3.0     | 3,140   | 2,959  | 337,400    | 2034/6/1   |
|      |      | 3.25 CAN GOVT 280901     | 3.25    | 2,600   | 2,543  | 290,031    | 2028/9/1   |
|      |      | 3.25 CAN GOVT 331201     | 3.25    | 3,170   | 3,057  | 348,596    | 2033/12/1  |
|      |      | 3.5 CAN GOVT 280301      | 3.5     | 2,000   | 1,975  | 225,202    | 2028/3/1   |
|      |      | 3.5 CAN GOVT 340301      | 3.5     | 2,020   | 1,990  | 226,962    | 2034/3/1   |
|      |      | 3.5 CAN GOVT 451201      | 3.5     | 1,650   | 1,622  | 185,019    | 2045/12/1  |
|      |      | 3.75 CAN GOVT 250501     | 3.75    | 3,500   | 3,469  | 395,548    | 2025/5/1   |
|      |      | 4 CAN GOVT 260501        | 4.0     | 3,200   | 3,182  | 362,916    | 2026/5/1   |
|      |      | 4 CAN GOVT 290301        | 4.0     | 5,060   | 5,111  | 582,819    | 2029/3/1   |
|      |      | 4 CAN GOVT 410601        | 4.0     | 1,200   | 1,254  | 142,981    | 2041/6/1   |
|      |      | 4.5 CAN GOVT 251101      | 4.5     | 2,540   | 2,539  | 289,573    | 2025/11/1  |
|      |      | 4.5 CAN GOVT 260201      | 4.5     | 5,200   | 5,208  | 593,881    | 2026/2/1   |
|      |      | 5 CAN GOVT 370601        | 5.0     | 1,330   | 1,511  | 172,389    | 2037/6/1   |
|      |      | 5.75 CAN GOVT 290601     | 5.75    | 950     | 1,040  | 118,618    | 2029/6/1   |
|      |      | 5.75 CAN GOVT 330601     | 5.75    | 1,430   | 1,653  | 188,527    | 2033/6/1   |
| 小    | 計    |                          |         |         |        | 12,539,117 |            |
| メキシコ |      |                          | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ |        |            |            |
|      | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 10.0    | 12,350  | 12,696 | 118,076    | 2036/11/20 |
|      |      | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 5.5     | 52,000  | 46,427 | 431,758    | 2027/3/4   |
|      |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75    | 65,500  | 60,502 | 562,650    | 2026/3/5   |
|      |      | 7 MEXICAN BONOS 260903   | 7.0     | 42,000  | 39,220 | 364,738    | 2026/9/3   |
|      |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5     | 63,950  | 59,918 | 557,218    | 2027/6/3   |
|      |      | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 7.5     | 60,200  | 52,476 | 488,014    | 2033/5/26  |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75    | 68,050  | 61,482 | 571,762    | 2031/5/29  |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75    | 13,400  | 11,746 | 109,234    | 2034/11/23 |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75    | 57,940  | 48,169 | 447,957    | 2042/11/13 |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 350524   | 8.0     | 5,000   | 4,398  | 40,907     | 2035/5/24  |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 8.0     | 39,100  | 33,029 | 307,163    | 2047/11/7  |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 8.0     | 46,270  | 38,869 | 361,471    | 2053/7/31  |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 8.5     | 23,420  | 22,378 | 208,113    | 2029/3/1   |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5     | 48,650  | 46,309 | 430,659    | 2029/5/31  |

| 銘柄   |      |                          | 当 期 末 |        |        |           |            |
|------|------|--------------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
|      |      |                          | 利 率   | 額面金額   | 評 価 額  |           | 償還年月日      |
|      |      |                          |       |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| メキシコ | 国債証券 | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5   | 39,700 | 36,116 | 335,870   | 2038/11/18 |
| 小 計  |      |                          |       |        |        | 5,335,597 |            |
| ユーロ  |      |                          |       | 千ユーロ   | 千ユーロ   |           |            |
| ドイツ  | 国債証券 | 0 BUND 260815            | —     | 5,930  | 5,564  | 934,683   | 2026/8/15  |
|      |      | 0 BUND 271115            | —     | 3,100  | 2,829  | 475,179   | 2027/11/15 |
|      |      | 0 BUND 281115            | —     | 5,500  | 4,912  | 825,137   | 2028/11/15 |
|      |      | 0 BUND 290815            | —     | 4,550  | 3,998  | 671,585   | 2029/8/15  |
|      |      | 0 BUND 300215            | —     | 4,820  | 4,188  | 703,431   | 2030/2/15  |
|      |      | 0 BUND 300815            | —     | 6,660  | 5,724  | 961,425   | 2030/8/15  |
|      |      | 0 BUND 300815            | —     | 1,550  | 1,333  | 223,936   | 2030/8/15  |
|      |      | 0 BUND 310215            | —     | 5,140  | 4,364  | 733,106   | 2031/2/15  |
|      |      | 0 BUND 310815            | —     | 5,400  | 4,533  | 761,432   | 2031/8/15  |
|      |      | 0 BUND 310815            | —     | 1,900  | 1,595  | 268,026   | 2031/8/15  |
|      |      | 0 BUND 320215            | —     | 4,690  | 3,886  | 652,745   | 2032/2/15  |
|      |      | 0 BUND 350515            | —     | 3,630  | 2,750  | 461,926   | 2035/5/15  |
|      |      | 0 BUND 360515            | —     | 4,270  | 3,142  | 527,754   | 2036/5/15  |
|      |      | 0 BUND 500815            | —     | 7,470  | 3,779  | 634,858   | 2050/8/15  |
|      |      | 0 BUND 500815            | —     | 1,560  | 792    | 133,117   | 2050/8/15  |
|      |      | 0 BUND 520815            | —     | 5,150  | 2,483  | 417,209   | 2052/8/15  |
|      |      | 0 OBL 251010             | —     | 4,000  | 3,830  | 643,340   | 2025/10/10 |
|      |      | 0 OBL 251010             | —     | 1,000  | 957    | 160,896   | 2025/10/10 |
|      |      | 0 OBL 260410             | —     | 6,910  | 6,536  | 1,097,942 | 2026/4/10  |
|      |      | 0 OBL 261009             | —     | 2,900  | 2,711  | 455,378   | 2026/10/9  |
|      |      | 0 OBL 270416             | —     | 3,830  | 3,539  | 594,516   | 2027/4/16  |
|      |      | 0.25 BUND 280815         | 0.25  | 4,640  | 4,214  | 707,869   | 2028/8/15  |
|      |      | 0.25 BUND 290215         | 0.25  | 4,850  | 4,362  | 732,784   | 2029/2/15  |
|      |      | 0.5 BUND 260215          | 0.5   | 6,660  | 6,378  | 1,071,396 | 2026/2/15  |
|      |      | 0.5 BUND 270815          | 0.5   | 5,120  | 4,779  | 802,682   | 2027/8/15  |
|      |      | 0.5 BUND 280215          | 0.5   | 4,280  | 3,962  | 665,566   | 2028/2/15  |
|      |      | 1 BUND 250815            | 1.0   | 5,580  | 5,427  | 911,646   | 2025/8/15  |
|      |      | 1 BUND 380515            | 1.0   | 3,610  | 2,919  | 490,367   | 2038/5/15  |
|      |      | 1.25 BUND 480815         | 1.25  | 6,260  | 4,691  | 788,006   | 2048/8/15  |
|      |      | 1.3 OBL 271015           | 1.3   | 5,750  | 5,497  | 923,417   | 2027/10/15 |
|      |      | 1.3 OBL 271015           | 1.3   | 800    | 765    | 128,563   | 2027/10/15 |
|      |      | 1.7 BUND 320815          | 1.7   | 6,430  | 6,066  | 1,018,959 | 2032/8/15  |
|      |      | 1.8 BUND 530815          | 1.8   | 4,780  | 3,961  | 665,295   | 2053/8/15  |
|      |      | 1.8 BUND 530815          | 1.8   | 1,000  | 830    | 139,489   | 2053/8/15  |
|      |      | 2.1 BUND 291115          | 2.1   | 4,460  | 4,363  | 732,956   | 2029/11/15 |
|      |      | 2.1 OBL 290412           | 2.1   | 2,510  | 2,457  | 412,774   | 2029/4/12  |
|      |      | 2.2 BUND 340215          | 2.2   | 3,850  | 3,744  | 628,960   | 2034/2/15  |
|      |      | 2.2 OBL 280413           | 2.2   | 4,250  | 4,184  | 702,749   | 2028/4/13  |
|      |      | 2.3 BUND 330215          | 2.3   | 6,190  | 6,102  | 1,025,019 | 2033/2/15  |
|      |      | 2.3 BUND 330215          | 2.3   | 950    | 937    | 157,401   | 2033/2/15  |
|      |      | 2.4 BUND 301115          | 2.4   | 2,580  | 2,564  | 430,734   | 2030/11/15 |
|      |      | 2.4 OBL 281019           | 2.4   | 4,820  | 4,780  | 803,013   | 2028/10/19 |
|      |      | 2.5 BUND 440704          | 2.5   | 5,360  | 5,195  | 872,581   | 2044/7/4   |
|      |      | 2.5 BUND 460815          | 2.5   | 5,660  | 5,481  | 920,746   | 2046/8/15  |

| 銘柄                     |      |                        | 当 期 末 |         |           |         | 償還年月日      |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
|                        |      |                        | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |         |            |
|                        |      |                        |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                    |      |                        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |            |
| ドイツ                    | 国債証券 | 2.5 BUND 540815        | 2.5   | 1,970   | 1,909     | 320,706 | 2054/8/15  |
|                        |      | 2.5 SCHATS 260319      | 2.5   | 2,500   | 2,475     | 415,846 | 2026/3/19  |
|                        |      | 2.6 BUND 330815        | 2.6   | 4,910   | 4,950     | 831,446 | 2033/8/15  |
|                        |      | 2.8 SCHATS 250612      | 2.8   | 3,470   | 3,450     | 579,620 | 2025/6/12  |
|                        |      | 3.1 SCHATS 251212      | 3.1   | 4,000   | 3,997     | 671,455 | 2025/12/12 |
|                        |      | 3.25 BUND 420704       | 3.25  | 3,190   | 3,439     | 577,758 | 2042/7/4   |
|                        |      | 4 BUND 370104          | 4.0   | 4,830   | 5,540     | 930,552 | 2037/1/4   |
|                        |      | 4.25 BUND 390704       | 4.25  | 3,810   | 4,551     | 764,529 | 2039/7/4   |
|                        |      | 4.75 BUND 280704       | 4.75  | 2,340   | 2,535     | 425,862 | 2028/7/4   |
|                        |      | 4.75 BUND 340704       | 4.75  | 4,890   | 5,850     | 982,650 | 2034/7/4   |
|                        |      | 4.75 BUND 400704       | 4.75  | 3,610   | 4,580     | 769,352 | 2040/7/4   |
|                        |      | 5.5 BUND 310104        | 5.5   | 3,650   | 4,308     | 723,671 | 2031/1/4   |
|                        |      | 5.625 BUND 280104      | 5.625 | 3,460   | 3,813     | 640,456 | 2028/1/4   |
|                        |      | 6.25 BUND 300104       | 6.25  | 1,700   | 2,028     | 340,650 | 2030/1/4   |
|                        |      | 6.5 BUND 270704        | 6.5   | 2,680   | 2,979     | 500,404 | 2027/7/4   |
| イタリア                   | 国債証券 | 0 ITALY GOVT 260401    | —     | 3,300   | 3,099     | 520,521 | 2026/4/1   |
|                        |      | 0 ITALY GOVT 260801    | —     | 5,000   | 4,646     | 780,342 | 2026/8/1   |
|                        |      | 0.25 ITALY GOVT 280315 | 0.25  | 4,760   | 4,241     | 712,425 | 2028/3/15  |
|                        |      | 0.45 ITALY GOVT 290215 | 0.45  | 2,300   | 2,010     | 337,704 | 2029/2/15  |
|                        |      | 0.5 ITALY GOVT 260201  | 0.5   | 2,450   | 2,332     | 391,767 | 2026/2/1   |
|                        |      | 0.5 ITALY GOVT 280715  | 0.5   | 2,400   | 2,140     | 359,509 | 2028/7/15  |
|                        |      | 0.6 ITALY GOVT 310801  | 0.6   | 3,100   | 2,527     | 424,436 | 2031/8/1   |
|                        |      | 0.85 ITALY GOVT 270115 | 0.85  | 3,060   | 2,869     | 481,955 | 2027/1/15  |
|                        |      | 0.9 ITALY GOVT 310401  | 0.9   | 4,230   | 3,561     | 598,150 | 2031/4/1   |
|                        |      | 0.95 ITALY GOVT 270915 | 0.95  | 4,000   | 3,707     | 622,705 | 2027/9/15  |
|                        |      | 0.95 ITALY GOVT 300801 | 0.95  | 2,940   | 2,530     | 424,987 | 2030/8/1   |
|                        |      | 0.95 ITALY GOVT 311201 | 0.95  | 4,330   | 3,590     | 603,123 | 2031/12/1  |
|                        |      | 0.95 ITALY GOVT 320601 | 0.95  | 3,600   | 2,942     | 494,270 | 2032/6/1   |
|                        |      | 0.95 ITALY GOVT 370301 | 0.95  | 2,560   | 1,793     | 301,218 | 2037/3/1   |
|                        |      | 1.1 ITALY GOVT 270401  | 1.1   | 3,300   | 3,101     | 520,896 | 2027/4/1   |
|                        |      | 1.2 ITALY GOVT 250815  | 1.2   | 2,100   | 2,041     | 342,926 | 2025/8/15  |
|                        |      | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25  | 4,080   | 3,878     | 651,372 | 2026/12/1  |
|                        |      | 1.35 ITALY GOVT 300401 | 1.35  | 3,610   | 3,214     | 539,838 | 2030/4/1   |
|                        |      | 1.45 ITALY GOVT 250515 | 1.45  | 2,300   | 2,254     | 378,613 | 2025/5/15  |
|                        |      | 1.45 ITALY GOVT 360301 | 1.45  | 2,140   | 1,646     | 276,530 | 2036/3/1   |
|                        |      | 1.5 ITALY GOVT 250601  | 1.5   | 3,300   | 3,232     | 542,936 | 2025/6/1   |
|                        |      | 1.5 ITALY GOVT 450430  | 1.5   | 2,880   | 1,822     | 306,105 | 2045/4/30  |
|                        |      | 1.6 ITALY GOVT 260601  | 1.6   | 4,120   | 3,978     | 668,280 | 2026/6/1   |
|                        |      | 1.65 ITALY GOVT 301201 | 1.65  | 3,870   | 3,454     | 580,259 | 2030/12/1  |
|                        |      | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65  | 4,450   | 3,874     | 650,805 | 2032/3/1   |
|                        |      | 1.7 ITALY GOVT 510901  | 1.7   | 2,650   | 1,613     | 271,015 | 2051/9/1   |
|                        |      | 1.8 ITALY GOVT 410301  | 1.8   | 2,950   | 2,120     | 356,212 | 2041/3/1   |
|                        |      | 1.85 ITALY GOVT 250701 | 1.85  | 4,650   | 4,566     | 766,944 | 2025/7/1   |
|                        |      | 2 ITALY GOVT 251201    | 2.0   | 3,530   | 3,456     | 580,599 | 2025/12/1  |
|                        |      | 2 ITALY GOVT 280201    | 2.0   | 3,880   | 3,705     | 622,446 | 2028/2/1   |
| 2.05 ITALY GOVT 270801 | 2.05 | 2,650                  | 2,551 | 428,491 | 2027/8/1  |         |            |
| 2.1 ITALY GOVT 260715  | 2.1  | 2,350                  | 2,289 | 384,551 | 2026/7/15 |         |            |

| 銘柄   | 銘柄   |                        | 当 期 末 |       |       |         | 償還年月日      |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         |            |
|      |      |                        |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| イタリア | 国債証券 | 2.15 ITALY GOVT 520901 | 2.15  | 1,550 | 1,027 | 172,604 | 2052/9/1   |
|      |      | 2.15 ITALY GOVT 720301 | 2.15  | 1,410 | 859   | 144,426 | 2072/3/1   |
|      |      | 2.2 ITALY GOVT 270601  | 2.2   | 3,380 | 3,274 | 549,987 | 2027/6/1   |
|      |      | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25  | 2,720 | 2,277 | 382,499 | 2036/9/1   |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45  | 3,420 | 3,088 | 518,808 | 2033/9/1   |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 500901 | 2.45  | 2,750 | 1,990 | 334,246 | 2050/9/1   |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 251115  | 2.5   | 2,330 | 2,300 | 386,317 | 2025/11/15 |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 321201  | 2.5   | 3,950 | 3,624 | 608,718 | 2032/12/1  |
|      |      | 2.65 ITALY GOVT 271201 | 2.65  | 2,800 | 2,739 | 460,206 | 2027/12/1  |
|      |      | 2.7 ITALY GOVT 470301  | 2.7   | 3,300 | 2,583 | 433,934 | 2047/3/1   |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 281201  | 2.8   | 3,680 | 3,602 | 604,992 | 2028/12/1  |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 290615  | 2.8   | 3,200 | 3,114 | 523,176 | 2029/6/15  |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 670301  | 2.8   | 1,510 | 1,105 | 185,611 | 2067/3/1   |
|      |      | 2.95 ITALY GOVT 270215 | 2.95  | 830   | 821   | 137,985 | 2027/2/15  |
|      |      | 2.95 ITALY GOVT 380901 | 2.95  | 2,380 | 2,097 | 352,277 | 2038/9/1   |
|      |      | 3 ITALY GOVT 290801    | 3.0   | 5,420 | 5,325 | 894,457 | 2029/8/1   |
|      |      | 3.1 ITALY GOVT 400301  | 3.1   | 2,310 | 2,037 | 342,182 | 2040/3/1   |
|      |      | 3.2 ITALY GOVT 260128  | 3.2   | 4,450 | 4,431 | 744,350 | 2026/1/28  |
|      |      | 3.25 ITALY GOVT 380301 | 3.25  | 2,220 | 2,032 | 341,408 | 2038/3/1   |
|      |      | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25  | 2,740 | 2,364 | 397,064 | 2046/9/1   |
|      |      | 3.35 ITALY GOVT 350301 | 3.35  | 3,110 | 2,972 | 499,258 | 2035/3/1   |
|      |      | 3.4 ITALY GOVT 280401  | 3.4   | 3,000 | 3,009 | 505,472 | 2028/4/1   |
|      |      | 3.45 ITALY GOVT 480301 | 3.45  | 3,470 | 3,072 | 516,114 | 2048/3/1   |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 260115  | 3.5   | 2,500 | 2,502 | 420,371 | 2026/1/15  |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 300301  | 3.5   | 4,470 | 4,493 | 754,719 | 2030/3/1   |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 310215  | 3.5   | 2,040 | 2,036 | 341,979 | 2031/2/15  |
|      |      | 3.6 ITALY GOVT 250929  | 3.6   | 2,000 | 2,002 | 336,373 | 2025/9/29  |
|      |      | 3.7 ITALY GOVT 300615  | 3.7   | 2,350 | 2,378 | 399,483 | 2030/6/15  |
|      |      | 3.8 ITALY GOVT 260415  | 3.8   | 2,700 | 2,720 | 456,884 | 2026/4/15  |
|      |      | 3.8 ITALY GOVT 280801  | 3.8   | 3,090 | 3,145 | 528,393 | 2028/8/1   |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 260915 | 3.85  | 2,800 | 2,830 | 475,390 | 2026/9/15  |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 291215 | 3.85  | 3,890 | 3,973 | 667,342 | 2029/12/15 |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 340701 | 3.85  | 1,620 | 1,624 | 272,895 | 2034/7/1   |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 490901 | 3.85  | 2,450 | 2,300 | 386,435 | 2049/9/1   |
|      |      | 4 ITALY GOVT 301115    | 4.0   | 3,840 | 3,949 | 663,367 | 2030/11/15 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 311030    | 4.0   | 1,650 | 1,699 | 285,503 | 2031/10/30 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 350430    | 4.0   | 2,150 | 2,182 | 366,566 | 2035/4/30  |
|      |      | 4 ITALY GOVT 370201    | 4.0   | 5,850 | 5,898 | 990,634 | 2037/2/1   |
|      |      | 4.1 ITALY GOVT 290201  | 4.1   | 3,530 | 3,643 | 611,994 | 2029/2/1   |
|      |      | 4.15 ITALY GOVT 391001 | 4.15  | 1,830 | 1,830 | 307,446 | 2039/10/1  |
|      |      | 4.2 ITALY GOVT 340301  | 4.2   | 3,430 | 3,547 | 595,776 | 2034/3/1   |
|      |      | 4.35 ITALY GOVT 331101 | 4.35  | 3,710 | 3,887 | 652,946 | 2033/11/1  |
|      |      | 4.4 ITALY GOVT 330501  | 4.4   | 3,800 | 4,005 | 672,738 | 2033/5/1   |
|      |      | 4.45 ITALY GOVT 430901 | 4.45  | 1,940 | 1,991 | 334,445 | 2043/9/1   |
|      |      | 4.5 ITALY GOVT 260301  | 4.5   | 3,740 | 3,810 | 640,015 | 2026/3/1   |
|      |      | 4.5 ITALY GOVT 531001  | 4.5   | 2,470 | 2,539 | 426,454 | 2053/10/1  |
|      |      | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75  | 3,930 | 4,151 | 697,270 | 2028/9/1   |

| 銘柄   |      |                        | 当 期 末 |        |        |           | 償還年月日      |
|------|------|------------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額   | 評 価 額  |           |            |
|      |      |                        |       |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
|      |      |                        | 千ユーロ  | 千ユーロ   | 千円     |           |            |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| イタリア | 国債証券 | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75  | 3,200  | 3,422  | 574,765   | 2044/9/1   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 340801    | 5.0   | 4,650  | 5,119  | 859,863   | 2034/8/1   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 390801    | 5.0   | 5,170  | 5,675  | 953,307   | 2039/8/1   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 400901    | 5.0   | 3,600  | 3,950  | 663,476   | 2040/9/1   |
|      |      | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25  | 4,660  | 5,097  | 856,188   | 2029/11/1  |
|      |      | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75  | 4,320  | 4,979  | 836,413   | 2033/2/1   |
|      |      | 6 ITALY GOVT 310501    | 6.0   | 5,600  | 6,468  | 1,086,431 | 2031/5/1   |
|      |      | 6.5 ITALY GOVT 271101  | 6.5   | 4,970  | 5,489  | 921,981   | 2027/11/1  |
|      |      | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25  | 2,300  | 2,511  | 421,876   | 2026/11/1  |
| フランス | 国債証券 | 0 O.A.T 260225         | —     | 7,790  | 7,372  | 1,238,286 | 2026/2/25  |
|      |      | 0 O.A.T 270225         | —     | 6,740  | 6,212  | 1,043,382 | 2027/2/25  |
|      |      | 0 O.A.T 291125         | —     | 7,180  | 6,151  | 1,033,181 | 2029/11/25 |
|      |      | 0 O.A.T 301125         | —     | 8,840  | 7,356  | 1,235,661 | 2030/11/25 |
|      |      | 0 O.A.T 311125         | —     | 11,400 | 9,206  | 1,546,259 | 2031/11/25 |
|      |      | 0 O.A.T 320525         | —     | 6,030  | 4,794  | 805,223   | 2032/5/25  |
|      |      | 0.25 O.A.T 261125      | 0.25  | 7,360  | 6,873  | 1,154,455 | 2026/11/25 |
|      |      | 0.5 O.A.T 250525       | 0.5   | 2,490  | 2,417  | 405,983   | 2025/5/25  |
|      |      | 0.5 O.A.T 260525       | 0.5   | 10,240 | 9,728  | 1,633,983 | 2026/5/25  |
|      |      | 0.5 O.A.T 290525       | 0.5   | 10,330 | 9,206  | 1,546,384 | 2029/5/25  |
|      |      | 0.5 O.A.T 400525       | 0.5   | 4,680  | 3,079  | 517,206   | 2040/5/25  |
|      |      | 0.5 O.A.T 440625       | 0.5   | 3,890  | 2,296  | 385,710   | 2044/6/25  |
|      |      | 0.5 O.A.T 720525       | 0.5   | 2,310  | 872    | 146,552   | 2072/5/25  |
|      |      | 0.75 O.A.T 280225      | 0.75  | 11,000 | 10,167 | 1,707,749 | 2028/2/25  |
|      |      | 0.75 O.A.T 280525      | 0.75  | 9,750  | 8,972  | 1,507,059 | 2028/5/25  |
|      |      | 0.75 O.A.T 281125      | 0.75  | 10,340 | 9,426  | 1,583,207 | 2028/11/25 |
|      |      | 0.75 O.A.T 520525      | 0.75  | 5,560  | 2,938  | 493,591   | 2052/5/25  |
|      |      | 0.75 O.A.T 530525      | 0.75  | 5,390  | 2,782  | 467,420   | 2053/5/25  |
|      |      | 1 O.A.T 251125         | 1.0   | 6,580  | 6,364  | 1,069,039 | 2025/11/25 |
|      |      | 1 O.A.T 270525         | 1.0   | 7,540  | 7,122  | 1,196,256 | 2027/5/25  |
|      |      | 1.25 O.A.T 340525      | 1.25  | 8,410  | 7,136  | 1,198,700 | 2034/5/25  |
|      |      | 1.25 O.A.T 360525      | 1.25  | 7,890  | 6,420  | 1,078,305 | 2036/5/25  |
|      |      | 1.25 O.A.T 380525      | 1.25  | 4,320  | 3,364  | 565,172   | 2038/5/25  |
|      |      | 1.5 O.A.T 310525       | 1.5   | 10,790 | 9,872  | 1,658,144 | 2031/5/25  |
|      |      | 1.5 O.A.T 500525       | 1.5   | 6,180  | 4,179  | 701,954   | 2050/5/25  |
|      |      | 1.75 O.A.T 390625      | 1.75  | 5,550  | 4,586  | 770,318   | 2039/6/25  |
|      |      | 1.75 O.A.T 660525      | 1.75  | 2,970  | 1,950  | 327,643   | 2066/5/25  |
|      |      | 2 O.A.T 321125         | 2.0   | 7,450  | 6,932  | 1,164,405 | 2032/11/25 |
|      |      | 2 O.A.T 480525         | 2.0   | 4,970  | 3,851  | 646,831   | 2048/5/25  |
|      |      | 2.5 O.A.T 260924       | 2.5   | 8,300  | 8,196  | 1,376,736 | 2026/9/24  |
|      |      | 2.5 O.A.T 270924       | 2.5   | 1,200  | 1,183  | 198,769   | 2027/9/24  |
|      |      | 2.5 O.A.T 300525       | 2.5   | 11,270 | 11,060 | 1,857,647 | 2030/5/25  |
|      |      | 2.5 O.A.T 430525       | 2.5   | 2,530  | 2,226  | 373,898   | 2043/5/25  |
|      |      | 2.75 O.A.T 271025      | 2.75  | 10,320 | 10,264 | 1,723,952 | 2027/10/25 |
|      |      | 2.75 O.A.T 290225      | 2.75  | 7,900  | 7,857  | 1,319,709 | 2029/2/25  |
|      |      | 2.75 O.A.T 300225      | 2.75  | 750    | 744    | 125,112   | 2030/2/25  |
|      |      | 3 O.A.T 330525         | 3.0   | 6,130  | 6,147  | 1,032,584 | 2033/5/25  |
|      |      | 3 O.A.T 490625         | 3.0   | 1,080  | 1,011  | 169,935   | 2049/6/25  |



| 銘柄                    |      |                       | 当 期 末 |         |           |           | 償還年月日      |
|-----------------------|------|-----------------------|-------|---------|-----------|-----------|------------|
|                       |      |                       | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |           |            |
|                       |      |                       |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |            |
|                       |      |                       | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円        |            |
| ユーロ                   |      |                       |       |         |           |           |            |
| フランス                  | 国債証券 | 3 O. A. T 540525      | 3.0   | 4,370   | 4,001     | 672,022   | 2054/5/25  |
|                       |      | 3.25 O. A. T 450525   | 3.25  | 5,600   | 5,510     | 925,581   | 2045/5/25  |
|                       |      | 3.25 O. A. T 550525   | 3.25  | 1,730   | 1,654     | 277,855   | 2055/5/25  |
|                       |      | 3.5 O. A. T 260425    | 3.5   | 6,690   | 6,740     | 1,132,187 | 2026/4/25  |
|                       |      | 3.5 O. A. T 331125    | 3.5   | 7,180   | 7,472     | 1,255,044 | 2033/11/25 |
|                       |      | 4 O. A. T 381025      | 4.0   | 4,510   | 4,914     | 825,510   | 2038/10/25 |
|                       |      | 4 O. A. T 550425      | 4.0   | 3,330   | 3,673     | 617,030   | 2055/4/25  |
|                       |      | 4 O. A. T 600425      | 4.0   | 3,520   | 3,922     | 658,890   | 2060/4/25  |
|                       |      | 4.5 O. A. T 410425    | 4.5   | 7,070   | 8,180     | 1,373,946 | 2041/4/25  |
|                       |      | 4.75 O. A. T 350425   | 4.75  | 4,750   | 5,482     | 920,869   | 2035/4/25  |
|                       |      | 5.5 O. A. T 290425    | 5.5   | 6,800   | 7,611     | 1,278,398 | 2029/4/25  |
|                       |      | 5.75 O. A. T 321025   | 5.75  | 6,200   | 7,477     | 1,255,947 | 2032/10/25 |
|                       |      | 6 O. A. T 251025      | 6.0   | 5,760   | 5,978     | 1,004,096 | 2025/10/25 |
| オランダ                  | 国債証券 | 0 NETH GOVT 260115    | —     | 2,200   | 2,091     | 351,335   | 2026/1/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 270115    | —     | 1,950   | 1,808     | 303,817   | 2027/1/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 290115    | —     | 2,380   | 2,097     | 352,318   | 2029/1/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 300715    | —     | 2,650   | 2,248     | 377,712   | 2030/7/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 310715    | —     | 2,540   | 2,099     | 352,650   | 2031/7/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 380115    | —     | 2,280   | 1,540     | 258,698   | 2038/1/15  |
|                       |      | 0 NETH GOVT 520115    | —     | 3,690   | 1,739     | 292,246   | 2052/1/15  |
|                       |      | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25  | 3,290   | 3,177     | 533,678   | 2025/7/15  |
|                       |      | 0.25 NETH GOVT 290715 | 0.25  | 2,950   | 2,604     | 437,460   | 2029/7/15  |
|                       |      | 0.5 NETH GOVT 260715  | 0.5   | 3,970   | 3,767     | 632,868   | 2026/7/15  |
|                       |      | 0.5 NETH GOVT 320715  | 0.5   | 2,300   | 1,928     | 323,981   | 2032/7/15  |
|                       |      | 0.5 NETH GOVT 400115  | 0.5   | 2,630   | 1,848     | 310,464   | 2040/1/15  |
|                       |      | 0.75 NETH GOVT 270715 | 0.75  | 2,670   | 2,506     | 421,012   | 2027/7/15  |
|                       |      | 0.75 NETH GOVT 280715 | 0.75  | 3,020   | 2,786     | 468,095   | 2028/7/15  |
|                       |      | 2 NETH GOVT 540115    | 2.0   | 2,030   | 1,691     | 284,089   | 2054/1/15  |
|                       |      | 2.5 NETH GOVT 300115  | 2.5   | 1,900   | 1,877     | 315,315   | 2030/1/15  |
|                       |      | 2.5 NETH GOVT 330115  | 2.5   | 2,750   | 2,699     | 453,446   | 2033/1/15  |
|                       |      | 2.5 NETH GOVT 330715  | 2.5   | 1,910   | 1,868     | 313,761   | 2033/7/15  |
|                       |      | 2.5 NETH GOVT 340715  | 2.5   | 1,050   | 1,021     | 171,501   | 2034/7/15  |
|                       |      | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75  | 3,320   | 3,262     | 547,980   | 2047/1/15  |
| 3.25 NETH GOVT 440115 | 3.25 | 1,330                 | 1,397 | 234,805 | 2044/1/15 |           |            |
| 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 2,940                 | 3,278 | 550,585 | 2042/1/15 |           |            |
| 4 NETH GOVT 370115    | 4.0  | 3,160                 | 3,528 | 592,726 | 2037/1/15 |           |            |
| 5.5 NETH GOVT 280115  | 5.5  | 2,180                 | 2,383 | 400,386 | 2028/1/15 |           |            |
| スペイン                  | 国債証券 | 0 SPAIN GOVT 250531   | —     | 2,500   | 2,412     | 405,157   | 2025/5/31  |
|                       |      | 0 SPAIN GOVT 260131   | —     | 3,000   | 2,842     | 477,491   | 2026/1/31  |
|                       |      | 0 SPAIN GOVT 270131   | —     | 9,400   | 8,652     | 1,453,331 | 2027/1/31  |
|                       |      | 0 SPAIN GOVT 280131   | —     | 5,320   | 4,764     | 800,171   | 2028/1/31  |
|                       |      | 0.1 SPAIN GOVT 310430 | 0.1   | 4,360   | 3,560     | 598,014   | 2031/4/30  |
|                       |      | 0.5 SPAIN GOVT 300430 | 0.5   | 4,580   | 3,960     | 665,133   | 2030/4/30  |
|                       |      | 0.5 SPAIN GOVT 311031 | 0.5   | 4,340   | 3,599     | 604,506   | 2031/10/31 |
|                       |      | 0.6 SPAIN GOVT 291031 | 0.6   | 3,680   | 3,239     | 544,116   | 2029/10/31 |
|                       |      | 0.7 SPAIN GOVT 320430 | 0.7   | 3,800   | 3,157     | 530,408   | 2032/4/30  |
|                       |      | 0.8 SPAIN GOVT 270730 | 0.8   | 3,350   | 3,123     | 524,629   | 2027/7/30  |

| 銘柄                     |      |                        | 当 期 末 |         |            |           | 償還年月日      |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|------------|-----------|------------|
|                        |      |                        | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額      |           |            |
|                        |      |                        |       |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |
|                        |      |                        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円        |            |
| ユーロ                    |      |                        |       |         |            |           |            |
| スペイン                   | 国債証券 | 0.8 SPAIN GOVT 290730  | 0.8   | 5,430   | 4,857      | 815,849   | 2029/7/30  |
|                        |      | 0.85 SPAIN GOVT 370730 | 0.85  | 2,470   | 1,779      | 298,953   | 2037/7/30  |
|                        |      | 1 SPAIN GOVT 420730    | 1.0   | 2,070   | 1,339      | 225,034   | 2042/7/30  |
|                        |      | 1 SPAIN GOVT 501031    | 1.0   | 3,650   | 1,971      | 331,206   | 2050/10/31 |
|                        |      | 1.2 SPAIN GOVT 401031  | 1.2   | 3,400   | 2,371      | 398,311   | 2040/10/31 |
|                        |      | 1.25 SPAIN GOVT 301031 | 1.25  | 4,030   | 3,609      | 606,260   | 2030/10/31 |
|                        |      | 1.3 SPAIN GOVT 261031  | 1.3   | 4,750   | 4,550      | 764,333   | 2026/10/31 |
|                        |      | 1.4 SPAIN GOVT 280430  | 1.4   | 4,660   | 4,385      | 736,556   | 2028/4/30  |
|                        |      | 1.4 SPAIN GOVT 280730  | 1.4   | 4,240   | 3,976      | 667,929   | 2028/7/30  |
|                        |      | 1.45 SPAIN GOVT 271031 | 1.45  | 4,330   | 4,109      | 690,203   | 2027/10/31 |
|                        |      | 1.45 SPAIN GOVT 290430 | 1.45  | 4,280   | 3,981      | 668,656   | 2029/4/30  |
|                        |      | 1.45 SPAIN GOVT 711031 | 1.45  | 1,300   | 632        | 106,281   | 2071/10/31 |
|                        |      | 1.5 SPAIN GOVT 270430  | 1.5   | 4,290   | 4,103      | 689,215   | 2027/4/30  |
|                        |      | 1.6 SPAIN GOVT 250430  | 1.6   | 3,510   | 3,448      | 579,193   | 2025/4/30  |
|                        |      | 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 1.85  | 4,400   | 3,781      | 635,158   | 2035/7/30  |
|                        |      | 1.9 SPAIN GOVT 521031  | 1.9   | 3,170   | 2,113      | 354,919   | 2052/10/31 |
|                        |      | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95  | 3,520   | 3,438      | 577,612   | 2026/4/30  |
|                        |      | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95  | 3,790   | 3,562      | 598,437   | 2030/7/30  |
|                        |      | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15  | 8,000   | 7,878      | 1,323,210 | 2025/10/31 |
|                        |      | 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 2.35  | 4,090   | 3,807      | 639,487   | 2033/7/30  |
|                        |      | 2.5 SPAIN GOVT 270531  | 2.5   | 1,400   | 1,376      | 231,232   | 2027/5/31  |
|                        |      | 2.55 SPAIN GOVT 321031 | 2.55  | 3,560   | 3,396      | 570,555   | 2032/10/31 |
|                        |      | 2.7 SPAIN GOVT 481031  | 2.7   | 3,670   | 3,035      | 509,777   | 2048/10/31 |
|                        |      | 2.8 SPAIN GOVT 260531  | 2.8   | 3,500   | 3,473      | 583,330   | 2026/5/31  |
|                        |      | 2.9 SPAIN GOVT 461031  | 2.9   | 3,540   | 3,080      | 517,390   | 2046/10/31 |
|                        |      | 3.15 SPAIN GOVT 330430 | 3.15  | 4,400   | 4,375      | 734,900   | 2033/4/30  |
|                        |      | 3.25 SPAIN GOVT 340430 | 3.25  | 3,260   | 3,243      | 544,794   | 2034/4/30  |
|                        |      | 3.45 SPAIN GOVT 430730 | 3.45  | 2,460   | 2,353      | 395,356   | 2043/7/30  |
|                        |      | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45  | 2,800   | 2,534      | 425,637   | 2066/7/30  |
|                        |      | 3.5 SPAIN GOVT 290531  | 3.5   | 3,380   | 3,456      | 580,496   | 2029/5/31  |
|                        |      | 3.55 SPAIN GOVT 331031 | 3.55  | 4,120   | 4,212      | 707,554   | 2033/10/31 |
|                        |      | 3.9 SPAIN GOVT 390730  | 3.9   | 2,390   | 2,461      | 413,476   | 2039/7/30  |
|                        |      | 4 SPAIN GOVT 541031    | 4.0   | 1,000   | 1,011      | 169,948   | 2054/10/31 |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131  | 4.2  | 4,260                  | 4,580 | 769,323 | 2037/1/31  |           |            |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | 2,890                  | 2,933 | 492,767 | 2025/7/30  |           |            |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730  | 4.7  | 3,150                  | 3,559 | 597,908 | 2041/7/30  |           |            |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730  | 4.9  | 3,770                  | 4,332 | 727,766 | 2040/7/30  |           |            |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | 3,250                  | 3,540 | 594,590 | 2028/10/31 |           |            |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15 | 2,640                  | 3,161 | 530,993 | 2044/10/31 |           |            |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 4,990                  | 5,924 | 995,108 | 2032/7/30  |           |            |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730  | 5.9  | 4,650                  | 4,916 | 825,799 | 2026/7/30  |           |            |
| 6 SPAIN GOVT 290131    | 6.0  | 4,230                  | 4,786 | 804,014 | 2029/1/31  |           |            |
| ベルギー                   | 国債証券 | 0 BEL GOVT 271022      | —     | 1,800   | 1,632      | 274,213   | 2027/10/22 |
|                        |      | 0 BEL GOVT 311022      | —     | 2,300   | 1,860      | 312,546   | 2031/10/22 |
|                        |      | 0.1 BEL GOVT 300622    | 0.1   | 2,320   | 1,968      | 330,550   | 2030/6/22  |
|                        |      | 0.35 BEL GOVT 320622   | 0.35  | 2,940   | 2,398      | 402,846   | 2032/6/22  |
|                        |      | 0.4 BEL GOVT 400622    | 0.4   | 1,660   | 1,062      | 178,452   | 2040/6/22  |

| 銘柄     |      |                          | 当 期 末 |       |       |         | 償還年月日      |
|--------|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|        |      |                          | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         |            |
|        |      |                          |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ    |      |                          | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ベルギー   | 国債証券 | 0.65 BEL GOVT 710622     | 0.65  | 1,090 | 452   | 75,922  | 2071/6/22  |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 250622      | 0.8   | 4,170 | 4,054 | 680,934 | 2025/6/22  |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 270622      | 0.8   | 2,880 | 2,701 | 453,770 | 2027/6/22  |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 280622      | 0.8   | 2,740 | 2,527 | 424,521 | 2028/6/22  |
|        |      | 0.9 BEL GOVT 290622      | 0.9   | 3,090 | 2,812 | 472,325 | 2029/6/22  |
|        |      | 1 BEL GOVT 260622        | 1.0   | 2,760 | 2,645 | 444,418 | 2026/6/22  |
|        |      | 1 BEL GOVT 310622        | 1.0   | 4,430 | 3,901 | 655,354 | 2031/6/22  |
|        |      | 1.25 BEL GOVT 330422     | 1.25  | 1,770 | 1,540 | 258,753 | 2033/4/22  |
|        |      | 1.4 BEL GOVT 530622      | 1.4   | 2,040 | 1,276 | 214,418 | 2053/6/22  |
|        |      | 1.45 BEL GOVT 370622     | 1.45  | 1,220 | 997   | 167,551 | 2037/6/22  |
|        |      | 1.6 BEL GOVT 470622      | 1.6   | 1,800 | 1,283 | 215,513 | 2047/6/22  |
|        |      | 1.7 BEL GOVT 500622      | 1.7   | 1,840 | 1,292 | 217,111 | 2050/6/22  |
|        |      | 1.9 BEL GOVT 380622      | 1.9   | 1,360 | 1,155 | 194,083 | 2038/6/22  |
|        |      | 2.15 BEL GOVT 660622     | 2.15  | 1,530 | 1,132 | 190,175 | 2066/6/22  |
|        |      | 2.25 BEL GOVT 570622     | 2.25  | 1,300 | 994   | 167,043 | 2057/6/22  |
|        |      | 2.75 BEL GOVT 390422     | 2.75  | 950   | 893   | 150,000 | 2039/4/22  |
|        |      | 2.85 BEL GOVT 341022     | 2.85  | 1,850 | 1,815 | 305,002 | 2034/10/22 |
|        |      | 3 BEL GOVT 330622        | 3.0   | 2,750 | 2,755 | 462,841 | 2033/6/22  |
|        |      | 3 BEL GOVT 340622        | 3.0   | 2,050 | 2,047 | 343,840 | 2034/6/22  |
|        |      | 3.3 BEL GOVT 540622      | 3.3   | 1,690 | 1,627 | 273,281 | 2054/6/22  |
|        |      | 3.45 BEL GOVT 430622     | 3.45  | 300   | 302   | 50,761  | 2043/6/22  |
|        |      | 3.5 BEL GOVT 550622      | 3.5   | 1,180 | 1,174 | 197,275 | 2055/6/22  |
|        |      | 3.75 BEL GOVT 450622     | 3.75  | 1,620 | 1,703 | 286,193 | 2045/6/22  |
|        |      | 4 BEL GOVT 320328        | 4.0   | 1,620 | 1,742 | 292,677 | 2032/3/28  |
|        |      | 4.25 BEL GOVT 410328     | 4.25  | 2,940 | 3,286 | 551,952 | 2041/3/28  |
|        |      | 4.5 BEL GOVT 260328      | 4.5   | 1,610 | 1,650 | 277,253 | 2026/3/28  |
|        |      | 5 BEL GOVT 350328        | 5.0   | 3,280 | 3,855 | 647,497 | 2035/3/28  |
|        |      | 5.5 BEL GOVT 280328      | 5.5   | 4,910 | 5,379 | 903,621 | 2028/3/28  |
| オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 281020    | —     | 1,790 | 1,580 | 265,392 | 2028/10/20 |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 300220    | —     | 2,150 | 1,827 | 306,944 | 2030/2/20  |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 310220    | —     | 2,720 | 2,244 | 376,936 | 2031/2/20  |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 401020    | —     | 1,170 | 701   | 117,870 | 2040/10/20 |
|        |      | 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 0.25  | 1,490 | 1,057 | 177,569 | 2036/10/20 |
|        |      | 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 0.5   | 2,100 | 1,958 | 329,020 | 2027/4/20  |
|        |      | 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 0.5   | 2,050 | 1,837 | 308,581 | 2029/2/20  |
|        |      | 0.7 AUSTRIA GOVT 710420  | 0.7   | 680   | 301   | 50,698  | 2071/4/20  |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75  | 2,480 | 2,353 | 395,264 | 2026/10/20 |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 0.75  | 2,940 | 2,721 | 457,102 | 2028/2/20  |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 0.75  | 1,570 | 899   | 151,082 | 2051/3/20  |
|        |      | 0.85 AUSTRIA GOVT 200630 | 0.85  | 830   | 370   | 62,203  | 2120/6/30  |
|        |      | 0.9 AUSTRIA GOVT 320220  | 0.9   | 2,120 | 1,825 | 306,620 | 2032/2/20  |
|        |      | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 1.2   | 2,710 | 2,634 | 442,426 | 2025/10/20 |
|        |      | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 1.5   | 1,810 | 1,322 | 222,094 | 2047/2/20  |
|        |      | 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 1.5   | 460   | 273   | 45,967  | 2086/11/2  |
|        |      | 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 1.85  | 1,130 | 872   | 146,607 | 2049/5/23  |
|        |      | 2 AUSTRIA GOVT 260715    | 2.0   | 1,000 | 979   | 164,448 | 2026/7/15  |
|        |      | 2.1 AUSTRIA GOVT 170920  | 2.1   | 950   | 707   | 118,793 | 2117/9/20  |

| 銘柄                       |       |                          | 当 期 末 |         |           |         | 償還年月日      |
|--------------------------|-------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
|                          |       |                          | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |         |            |
|                          |       |                          |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                      |       |                          | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |            |
| オーストリア                   | 国債証券  | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 2.4   | 1,690   | 1,603     | 269,375 | 2034/5/23  |
|                          |       | 2.9 AUSTRIA GOVT 290523  | 2.9   | 700     | 702       | 118,046 | 2029/5/23  |
|                          |       | 2.9 AUSTRIA GOVT 330220  | 2.9   | 2,710   | 2,697     | 453,079 | 2033/2/20  |
|                          |       | 2.9 AUSTRIA GOVT 340220  | 2.9   | 1,470   | 1,458     | 244,948 | 2034/2/20  |
|                          |       | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15  | 1,250   | 1,243     | 208,922 | 2044/6/20  |
|                          |       | 3.15 AUSTRIA GOVT 531020 | 3.15  | 1,070   | 1,058     | 177,711 | 2053/10/20 |
|                          |       | 3.45 AUSTRIA GOVT 301020 | 3.45  | 910     | 940       | 157,963 | 2030/10/20 |
|                          |       | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 3.8   | 700     | 791       | 132,949 | 2062/1/26  |
|                          |       | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15  | 2,540   | 2,818     | 473,405 | 2037/3/15  |
|                          |       | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85  | 1,370   | 1,412     | 237,270 | 2026/3/15  |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25  | 1,630                    | 1,790 | 300,802 | 2027/7/15 |         |            |
| フィンランド                   | 国債証券  | 0 FINNISH GOVT 260915    | —     | 1,800   | 1,679     | 282,028 | 2026/9/15  |
|                          |       | 0 FINNISH GOVT 300915    | —     | 750     | 626       | 105,263 | 2030/9/15  |
|                          |       | 0.125 FINNISH GOV 310915 | 0.125 | 1,070   | 876       | 147,278 | 2031/9/15  |
|                          |       | 0.125 FINNISH GOV 360415 | 0.125 | 1,120   | 793       | 133,205 | 2036/4/15  |
|                          |       | 0.125 FINNISH GOV 520415 | 0.125 | 750     | 343       | 57,678  | 2052/4/15  |
|                          |       | 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 0.25  | 540     | 341       | 57,421  | 2040/9/15  |
|                          |       | 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 0.5   | 1,670   | 1,590     | 267,219 | 2026/4/15  |
|                          |       | 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 0.5   | 700     | 647       | 108,774 | 2027/9/15  |
|                          |       | 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 0.5   | 1,480   | 1,339     | 224,910 | 2028/9/15  |
|                          |       | 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 0.5   | 1,350   | 1,194     | 200,654 | 2029/9/15  |
|                          |       | 0.5 FINNISH GOVT 430415  | 0.5   | 780     | 487       | 81,900  | 2043/4/15  |
|                          |       | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75  | 1,050   | 912       | 153,207 | 2031/4/15  |
|                          |       | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 630     | 611       | 102,676 | 2025/9/15  |
|                          |       | 1.125 FINNISH GOV 340415 | 1.125 | 730     | 614       | 103,257 | 2034/4/15  |
|                          |       | 1.375 FINNISH GOV 270415 | 1.375 | 800     | 765       | 128,576 | 2027/4/15  |
|                          |       | 1.375 FINNISH GOV 470415 | 1.375 | 990     | 709       | 119,126 | 2047/4/15  |
|                          |       | 1.5 FINNISH GOVT 320915  | 1.5   | 750     | 671       | 112,816 | 2032/9/15  |
|                          |       | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 940     | 871       | 146,355 | 2042/7/4   |
|                          |       | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75  | 1,110   | 1,105     | 185,686 | 2028/7/4   |
|                          |       | 2.75 FINNISH GOVT 380415 | 2.75  | 680     | 649       | 109,070 | 2038/4/15  |
| 2.875 FINNISH GOV 290415 | 2.875 | 600                      | 600   | 100,820 | 2029/4/15 |         |            |
| 2.95 FINNISH GOVT 550415 | 2.95  | 490                      | 470   | 79,028  | 2055/4/15 |         |            |
| 3 FINNISH GOVT 330915    | 3.0   | 1,720                    | 1,724 | 289,573 | 2033/9/15 |         |            |
| 4 FINNISH GOVT 250704    | 4.0   | 240                      | 241   | 40,628  | 2025/7/4  |         |            |
| アイルランド                   | 国債証券  | 0 IRISH GOVT 311018      | —     | 1,900   | 1,551     | 260,585 | 2031/10/18 |
|                          |       | 0.2 IRISH GOVT 270515    | 0.2   | 500     | 462       | 77,690  | 2027/5/15  |
|                          |       | 0.2 IRISH GOVT 301018    | 0.2   | 2,130   | 1,815     | 305,002 | 2030/10/18 |
|                          |       | 0.35 IRISH GOVT 321018   | 0.35  | 800     | 655       | 110,043 | 2032/10/18 |
|                          |       | 0.4 IRISH GOVT 350515    | 0.4   | 1,020   | 780       | 131,167 | 2035/5/15  |
|                          |       | 0.55 IRISH GOVT 410422   | 0.55  | 600     | 401       | 67,417  | 2041/4/22  |
|                          |       | 0.9 IRISH GOVT 280515    | 0.9   | 1,640   | 1,526     | 256,373 | 2028/5/15  |
|                          |       | 1 IRISH GOVT 260515      | 1.0   | 1,850   | 1,779     | 298,868 | 2026/5/15  |
|                          |       | 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1.1   | 1,610   | 1,487     | 249,784 | 2029/5/15  |
|                          |       | 1.3 IRISH GOVT 330515    | 1.3   | 860     | 757       | 127,192 | 2033/5/15  |
|                          |       | 1.35 IRISH GOVT 310318   | 1.35  | 1,070   | 978       | 164,372 | 2031/3/18  |
|                          |       | 1.5 IRISH GOVT 500515    | 1.5   | 1,460   | 1,039     | 174,532 | 2050/5/15  |

| 銘柄               |                   |                       | 当 期 末 |          |            |             | 償還年月日      |
|------------------|-------------------|-----------------------|-------|----------|------------|-------------|------------|
|                  |                   |                       | 利 率   | 額面金額     | 評 価 額      |             |            |
|                  |                   |                       |       |          | 外貨建金額      | 邦貨換算金額      |            |
| ユーロ              |                   |                       | %     | 千ユーロ     | 千ユーロ       | 千円          |            |
| アイルランド           | 国債証券              | 1.7 IRISH GOVT 370515 | 1.7   | 1,190    | 1,023      | 171,911     | 2037/5/15  |
|                  |                   | 2 IRISH GOVT 450218   | 2.0   | 1,970    | 1,641      | 275,685     | 2045/2/18  |
|                  |                   | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4   | 1,490    | 1,460      | 245,323     | 2030/5/15  |
|                  |                   | 2.6 IRISH GOVT 341018 | 2.6   | 850      | 826        | 138,879     | 2034/10/18 |
|                  |                   | 3 IRISH GOVT 431018   | 3.0   | 690      | 681        | 114,453     | 2043/10/18 |
| 小 計              |                   |                       |       |          |            | 197,279,850 |            |
| イギリス             |                   |                       |       | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド   |             |            |
| 国債証券             | 0.125 GILT 260130 | 0.125                 | 2,600 | 2,422    | 473,016    | 2026/1/30   |            |
|                  | 0.125 GILT 280131 | 0.125                 | 2,300 | 1,988    | 388,174    | 2028/1/31   |            |
|                  | 0.25 GILT 310731  | 0.25                  | 5,110 | 3,916    | 764,661    | 2031/7/31   |            |
|                  | 0.375 GILT 261022 | 0.375                 | 4,870 | 4,433    | 865,539    | 2026/10/22  |            |
|                  | 0.375 GILT 301022 | 0.375                 | 3,100 | 2,470    | 482,308    | 2030/10/22  |            |
|                  | 0.5 GILT 290131   | 0.5                   | 4,900 | 4,161    | 812,409    | 2029/1/31   |            |
|                  | 0.5 GILT 611022   | 0.5                   | 3,700 | 1,098    | 214,549    | 2061/10/22  |            |
|                  | 0.625 GILT 250607 | 0.625                 | 1,480 | 1,419    | 277,123    | 2025/6/7    |            |
|                  | 0.625 GILT 350731 | 0.625                 | 4,030 | 2,745    | 535,978    | 2035/7/31   |            |
|                  | 0.625 GILT 501022 | 0.625                 | 2,890 | 1,152    | 225,076    | 2050/10/22  |            |
|                  | 0.875 GILT 291022 | 0.875                 | 2,900 | 2,463    | 480,978    | 2029/10/22  |            |
|                  | 0.875 GILT 330731 | 0.875                 | 5,140 | 3,871    | 755,801    | 2033/7/31   |            |
|                  | 0.875 GILT 460131 | 0.875                 | 2,930 | 1,444    | 281,965    | 2046/1/31   |            |
|                  | 1 GILT 320131     | 1.0                   | 5,880 | 4,700    | 917,685    | 2032/1/31   |            |
|                  | 1.125 GILT 390131 | 1.125                 | 4,450 | 2,868    | 559,985    | 2039/1/31   |            |
|                  | 1.125 GILT 731022 | 1.125                 | 1,750 | 631      | 123,200    | 2073/10/22  |            |
|                  | 1.25 GILT 270722  | 1.25                  | 2,530 | 2,314    | 451,797    | 2027/7/22   |            |
|                  | 1.25 GILT 411022  | 1.25                  | 4,250 | 2,589    | 505,612    | 2041/10/22  |            |
|                  | 1.25 GILT 510731  | 1.25                  | 4,930 | 2,383    | 465,288    | 2051/7/31   |            |
|                  | 1.5 GILT 260722   | 1.5                   | 3,630 | 3,421    | 668,037    | 2026/7/22   |            |
|                  | 1.5 GILT 470722   | 1.5                   | 3,160 | 1,768    | 345,311    | 2047/7/22   |            |
|                  | 1.5 GILT 530731   | 1.5                   | 3,370 | 1,700    | 331,992    | 2053/7/31   |            |
|                  | 1.625 GILT 281022 | 1.625                 | 3,470 | 3,137    | 612,618    | 2028/10/22  |            |
|                  | 1.625 GILT 541022 | 1.625                 | 2,470 | 1,277    | 249,441    | 2054/10/22  |            |
|                  | 1.625 GILT 711022 | 1.625                 | 2,530 | 1,151    | 224,740    | 2071/10/22  |            |
|                  | 1.75 GILT 370907  | 1.75                  | 3,340 | 2,471    | 482,462    | 2037/9/7    |            |
|                  | 1.75 GILT 490122  | 1.75                  | 1,780 | 1,034    | 201,996    | 2049/1/22   |            |
|                  | 1.75 GILT 570722  | 1.75                  | 3,230 | 1,695    | 331,095    | 2057/7/22   |            |
|                  | 2 GILT 250907     | 2.0                   | 2,100 | 2,030    | 396,371    | 2025/9/7    |            |
|                  | 2.5 GILT 650722   | 2.5                   | 2,480 | 1,557    | 304,057    | 2065/7/22   |            |
|                  | 3.25 GILT 330131  | 3.25                  | 5,100 | 4,784    | 934,058    | 2033/1/31   |            |
|                  | 3.25 GILT 440122  | 3.25                  | 3,620 | 2,992    | 584,241    | 2044/1/22   |            |
|                  | 3.5 GILT 251022   | 3.5                   | 6,150 | 6,048    | 1,180,979  | 2025/10/22  |            |
| 3.5 GILT 450122  | 3.5               | 3,740                 | 3,188 | 622,478  | 2045/1/22  |             |            |
| 3.5 GILT 680722  | 3.5               | 2,960                 | 2,400 | 468,685  | 2068/7/22  |             |            |
| 3.75 GILT 270307 | 3.75              | 2,000                 | 1,969 | 384,429  | 2027/3/7   |             |            |
| 3.75 GILT 380129 | 3.75              | 4,650                 | 4,350 | 849,399  | 2038/1/29  |             |            |
| 3.75 GILT 520722 | 3.75              | 2,110                 | 1,821 | 355,646  | 2052/7/22  |             |            |
| 3.75 GILT 531022 | 3.75              | 4,540                 | 3,899 | 761,243  | 2053/10/22 |             |            |
| 4 GILT 311022    | 4.0               | 700                   | 696   | 136,028  | 2031/10/22 |             |            |

| 銘柄     |      |                         | 当 期 末 |             |             |            | 償還年月日      |
|--------|------|-------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
|        |      |                         | 利 率   | 額面金額        | 評 価 額       |            |            |
|        |      |                         |       |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |            |
| イギリス   |      |                         | %     | 千イギリスポンド    | 千イギリスポンド    | 千円         |            |
|        | 国債証券 | 4 GILT 600122           | 4.0   | 2,640       | 2,376       | 464,026    | 2060/1/22  |
|        |      | 4 GILT 631022           | 4.0   | 2,230       | 1,999       | 390,453    | 2063/10/22 |
|        |      | 4.125 GILT 270129       | 4.125 | 4,900       | 4,873       | 951,509    | 2027/1/29  |
|        |      | 4.25 GILT 271207        | 4.25  | 2,450       | 2,460       | 480,466    | 2027/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 320607        | 4.25  | 4,290       | 4,354       | 850,230    | 2032/6/7   |
|        |      | 4.25 GILT 360307        | 4.25  | 2,910       | 2,906       | 567,386    | 2036/3/7   |
|        |      | 4.25 GILT 390907        | 4.25  | 2,430       | 2,375       | 463,796    | 2039/9/7   |
|        |      | 4.25 GILT 401207        | 4.25  | 2,420       | 2,349       | 458,772    | 2040/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 461207        | 4.25  | 2,930       | 2,778       | 542,478    | 2046/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 491207        | 4.25  | 2,470       | 2,329       | 454,728    | 2049/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 551207        | 4.25  | 2,770       | 2,601       | 507,879    | 2055/12/7  |
|        |      | 4.375 GILT 540731       | 4.375 | 1,530       | 1,463       | 285,812    | 2054/7/31  |
|        |      | 4.5 GILT 280607         | 4.5   | 6,460       | 6,540       | 1,276,878  | 2028/6/7   |
|        |      | 4.5 GILT 340907         | 4.5   | 2,300       | 2,359       | 460,597    | 2034/9/7   |
|        |      | 4.5 GILT 421207         | 4.5   | 3,190       | 3,169       | 618,767    | 2042/12/7  |
|        |      | 4.625 GILT 340131       | 4.625 | 4,220       | 4,372       | 853,779    | 2034/1/31  |
|        |      | 4.75 GILT 301207        | 4.75  | 3,650       | 3,807       | 743,281    | 2030/12/7  |
|        |      | 4.75 GILT 381207        | 4.75  | 2,310       | 2,395       | 467,703    | 2038/12/7  |
|        |      | 4.75 GILT 431022        | 4.75  | 2,820       | 2,876       | 561,656    | 2043/10/22 |
|        |      | 6 GILT 281207           | 6.0   | 1,890       | 2,044       | 399,114    | 2028/12/7  |
| 小      | 計    |                         |       |             |             | 31,805,788 |            |
| スウェーデン |      |                         |       | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ |            |            |
|        | 国債証券 | 0.125 SWD GOVT 310512   | 0.125 | 9,450       | 8,107       | 116,590    | 2031/5/12  |
|        |      | 0.75 SWD GOVT 280512    | 0.75  | 17,500      | 16,360      | 235,262    | 2028/5/12  |
|        |      | 0.75 SWD GOVT 291112    | 0.75  | 12,200      | 11,209      | 161,187    | 2029/11/12 |
|        |      | 1 SWD GOVT 261112       | 1.0   | 11,960      | 11,465      | 164,880    | 2026/11/12 |
|        |      | 1.75 SWD GOVT 331111    | 1.75  | 11,500      | 10,919      | 157,015    | 2033/11/11 |
|        |      | 2.25 SWD GOVT 320601    | 2.25  | 6,750       | 6,700       | 96,350     | 2032/6/1   |
|        |      | 2.5 SWD GOVT 250512     | 2.5   | 8,840       | 8,776       | 126,209    | 2025/5/12  |
|        |      | 3.5 SWD GOVT 390330     | 3.5   | 6,470       | 7,293       | 104,879    | 2039/3/30  |
| 小      | 計    |                         |       |             |             | 1,162,376  |            |
| ノルウェー  |      |                         |       | 千ノルウェークローネ  | 千ノルウェークローネ  |            |            |
|        | 国債証券 | 1.25 NORWE GOVT 310917  | 1.25  | 4,700       | 3,981       | 57,169     | 2031/9/17  |
|        |      | 1.375 NORWE GOVT 300819 | 1.375 | 15,770      | 13,793      | 198,067    | 2030/8/19  |
|        |      | 1.5 NORWE GOVT 260219   | 1.5   | 6,040       | 5,796       | 83,238     | 2026/2/19  |
|        |      | 1.75 NORWE GOVT 270217  | 1.75  | 5,120       | 4,856       | 69,735     | 2027/2/17  |
|        |      | 1.75 NORWE GOVT 290906  | 1.75  | 4,600       | 4,184       | 60,087     | 2029/9/6   |
|        |      | 2 NORWE GOVT 280426     | 2.0   | 6,900       | 6,485       | 93,130     | 2028/4/26  |
|        |      | 2.125 NORWE GOVT 320518 | 2.125 | 10,500      | 9,371       | 134,574    | 2032/5/18  |
|        |      | 3 NORWE GOVT 330815     | 3.0   | 8,700       | 8,227       | 118,151    | 2033/8/15  |
|        |      | 3.5 NORWE GOVT 421006   | 3.5   | 4,000       | 3,994       | 57,361     | 2042/10/6  |
|        |      | 3.625 NORWE GOVT 340413 | 3.625 | 4,100       | 4,060       | 58,312     | 2034/4/13  |
| 小      | 計    |                         |       |             |             | 929,829    |            |
| デンマーク  |      |                         |       | 千デンマーククローネ  | 千デンマーククローネ  |            |            |
|        | 国債証券 | 0 DMK GOVT 311115       | —     | 14,550      | 12,151      | 273,642    | 2031/11/15 |
|        |      | 0.25 DMK GOVT 521115    | 0.25  | 9,730       | 5,138       | 115,722    | 2052/11/15 |
|        |      | 0.5 DMK GOVT 271115     | 0.5   | 8,100       | 7,538       | 169,756    | 2027/11/15 |

| 銘柄      | 当期末                   |      |            |            |           |            |
|---------|-----------------------|------|------------|------------|-----------|------------|
|         | 利率                    | 額面金額 | 評価額        |            | 償還年月日     |            |
|         |                       |      | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |           |            |
| デンマーク   |                       | %    | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | 千円        |            |
| 国債証券    | 0.5 DMK GOVT 291115   | 0.5  | 10,550     | 9,497      | 213,891   | 2029/11/15 |
|         | 1.75 DMK GOVT 251115  | 1.75 | 7,490      | 7,355      | 165,645   | 2025/11/15 |
|         | 2.25 DMK GOVT 331115  | 2.25 | 6,800      | 6,634      | 149,414   | 2033/11/15 |
|         | 4.5 DMK GOVT 391115   | 4.5  | 18,500     | 22,706     | 511,341   | 2039/11/15 |
| 小計      |                       |      |            |            | 1,599,416 |            |
| ポーランド   |                       |      | 千ポーランドズロチ  | 千ポーランドズロチ  |           |            |
| 国債証券    | 0.25 POLAND 261025    | 0.25 | 8,000      | 7,094      | 276,916   | 2026/10/25 |
|         | 1.25 POLAND 301025    | 1.25 | 9,190      | 7,125      | 278,136   | 2030/10/25 |
|         | 1.75 POLAND 320425    | 1.75 | 9,900      | 7,519      | 293,490   | 2032/4/25  |
|         | 2.5 POLAND 260725     | 2.5  | 7,840      | 7,395      | 288,648   | 2026/7/25  |
|         | 2.5 POLAND 270725     | 2.5  | 6,110      | 5,610      | 218,978   | 2027/7/25  |
|         | 2.75 POLAND 280425    | 2.75 | 5,760      | 5,230      | 204,155   | 2028/4/25  |
|         | 2.75 POLAND 291025    | 2.75 | 7,900      | 6,922      | 270,217   | 2029/10/25 |
|         | 3.25 POLAND 250725    | 3.25 | 8,700      | 8,503      | 331,927   | 2025/7/25  |
|         | 3.75 POLAND 270525    | 3.75 | 4,000      | 3,824      | 149,265   | 2027/5/25  |
|         | 5.75 POLAND 290425    | 5.75 | 10,600     | 10,727     | 418,714   | 2029/4/25  |
|         | 6 POLAND 331025       | 6.0  | 4,720      | 4,858      | 189,621   | 2033/10/25 |
|         | 7.5 POLAND 280725     | 7.5  | 8,120      | 8,725      | 340,585   | 2028/7/25  |
| 小計      |                       |      |            |            | 3,260,658 |            |
| オーストラリア |                       |      | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル |           |            |
| 国債証券    | 0.25 AUST GOVT 251121 | 0.25 | 3,650      | 3,443      | 354,242   | 2025/11/21 |
|         | 0.5 AUST GOVT 260921  | 0.5  | 4,100      | 3,780      | 388,976   | 2026/9/21  |
|         | 1 AUST GOVT 301221    | 1.0  | 4,260      | 3,494      | 359,515   | 2030/12/21 |
|         | 1 AUST GOVT 311121    | 1.0  | 5,310      | 4,220      | 434,256   | 2031/11/21 |
|         | 1.25 AUST GOVT 320521 | 1.25 | 5,070      | 4,046      | 416,336   | 2032/5/21  |
|         | 1.5 AUST GOVT 310621  | 1.5  | 3,740      | 3,129      | 321,953   | 2031/6/21  |
|         | 1.75 AUST GOVT 321121 | 1.75 | 5,090      | 4,180      | 430,052   | 2032/11/21 |
|         | 1.75 AUST GOVT 510621 | 1.75 | 3,040      | 1,672      | 172,030   | 2051/6/21  |
|         | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25 | 2,900      | 2,716      | 279,479   | 2028/5/21  |
|         | 2.5 AUST GOVT 300521  | 2.5  | 3,940      | 3,608      | 371,290   | 2030/5/21  |
|         | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75 | 4,390      | 4,216      | 433,819   | 2027/11/21 |
|         | 2.75 AUST GOVT 281121 | 2.75 | 3,040      | 2,886      | 296,959   | 2028/11/21 |
|         | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2.75 | 2,980      | 2,790      | 287,076   | 2029/11/21 |
|         | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 1,520      | 1,306      | 134,383   | 2035/6/21  |
|         | 2.75 AUST GOVT 410521 | 2.75 | 2,170      | 1,699      | 174,823   | 2041/5/21  |
|         | 3 AUST GOVT 331121    | 3.0  | 4,100      | 3,685      | 379,123   | 2033/11/21 |
|         | 3 AUST GOVT 470321    | 3.0  | 2,420      | 1,849      | 190,261   | 2047/3/21  |
|         | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 3,400      | 3,284      | 337,914   | 2029/4/21  |
|         | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 2,130      | 1,835      | 188,840   | 2039/6/21  |
|         | 3.5 AUST GOVT 341221  | 3.5  | 3,090      | 2,871      | 295,378   | 2034/12/21 |
|         | 3.75 AUST GOVT 340521 | 3.75 | 3,700      | 3,529      | 363,163   | 2034/5/21  |
|         | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 3,150      | 2,941      | 302,604   | 2037/4/21  |
|         | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 2,490      | 2,500      | 257,251   | 2026/4/21  |
|         | 4.5 AUST GOVT 330421  | 4.5  | 3,900      | 3,961      | 407,544   | 2033/4/21  |
|         | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 3,050      | 3,115      | 320,544   | 2027/4/21  |
|         | 4.75 AUST GOVT 540621 | 4.75 | 1,270      | 1,284      | 132,150   | 2054/6/21  |
| 小計      |                       |      |            |            | 8,029,971 |            |

| 銘柄       | 銘柄                       | 利 率   | 当 期 末       |             |           | 償還年月日      |
|----------|--------------------------|-------|-------------|-------------|-----------|------------|
|          |                          |       | 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        |            |
| 国債証券     | 0.25 NZ GOVT 280515      | 0.25  | 2,000       | 1,684       | 157,977   | 2028/5/15  |
|          | 1.5 NZ GOVT 310515       | 1.5   | 1,870       | 1,522       | 142,844   | 2031/5/15  |
|          | 1.75 NZ GOVT 410515      | 1.75  | 600         | 376         | 35,347    | 2041/5/15  |
|          | 2 NZ GOVT 320515         | 2.0   | 2,300       | 1,893       | 177,616   | 2032/5/15  |
|          | 2.75 NZ GOVT 370415      | 2.75  | 1,450       | 1,153       | 108,253   | 2037/4/15  |
|          | 2.75 NZ GOVT 510515      | 2.75  | 1,180       | 784         | 73,560    | 2051/5/15  |
|          | 3 NZ GOVT 290420         | 3.0   | 1,700       | 1,582       | 148,413   | 2029/4/20  |
|          | 3.5 NZ GOVT 330414       | 3.5   | 1,900       | 1,735       | 162,841   | 2033/4/14  |
|          | 4.25 NZ GOVT 340515      | 4.25  | 620         | 596         | 55,928    | 2034/5/15  |
|          | 4.5 NZ GOVT 270415       | 4.5   | 1,800       | 1,791       | 168,084   | 2027/4/15  |
|          | 4.5 NZ GOVT 300515       | 4.5   | 1,000       | 994         | 93,325    | 2030/5/15  |
|          | 4.5 NZ GOVT 350515       | 4.5   | 1,200       | 1,170       | 109,820   | 2035/5/15  |
|          | 5 NZ GOVT 540515         | 5.0   | 620         | 613         | 57,543    | 2054/5/15  |
| 小 計      |                          |       |             |             | 1,491,558 |            |
| シンガポール   |                          |       | 千シンガポールドル   | 千シンガポールドル   |           |            |
| 国債証券     | 1.25 SINGAPORGOVT 261101 | 1.25  | 700         | 664         | 76,480    | 2026/11/1  |
|          | 1.625 SINGAPORGOV 310701 | 1.625 | 1,050       | 942         | 108,495   | 2031/7/1   |
|          | 1.875 SINGAPORGOV 500301 | 1.875 | 1,090       | 827         | 95,248    | 2050/3/1   |
|          | 1.875 SINGAPORGOV 511001 | 1.875 | 950         | 712         | 82,071    | 2051/10/1  |
|          | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 2.125 | 1,530       | 1,491       | 171,724   | 2026/6/1   |
|          | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 2.25  | 1,300       | 1,170       | 134,702   | 2036/8/1   |
|          | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 2.375 | 1,560       | 1,540       | 177,393   | 2025/6/1   |
|          | 2.375 SINGAPORGOV 390701 | 2.375 | 780         | 696         | 80,140    | 2039/7/1   |
|          | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 2.625 | 800         | 780         | 89,893    | 2028/5/1   |
|          | 2.625 SINGAPORGOV 320801 | 2.625 | 700         | 668         | 76,964    | 2032/8/1   |
|          | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 2.75  | 980         | 911         | 104,985   | 2042/4/1   |
|          | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 2.75  | 1,480       | 1,359       | 156,463   | 2046/3/1   |
|          | 2.875 SINGAPORGOV 270901 | 2.875 | 1,000       | 986         | 113,610   | 2027/9/1   |
|          | 2.875 SINGAPORGOV 280801 | 2.875 | 1,000       | 985         | 113,460   | 2028/8/1   |
|          | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 1,760       | 1,729       | 199,082   | 2029/7/1   |
|          | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 2.875 | 1,340       | 1,311       | 150,957   | 2030/9/1   |
|          | 3 SINGAPORGOVT 720801    | 3.0   | 910         | 859         | 98,953    | 2072/8/1   |
|          | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 2,630       | 2,653       | 305,517   | 2033/9/1   |
|          | 3.5 SINGAPORGOVT 270301  | 3.5   | 1,000       | 1,004       | 115,590   | 2027/3/1   |
| 小 計      |                          |       |             |             | 2,451,736 |            |
| マレーシア    |                          |       | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット |           |            |
| 国債証券     | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 2.632 | 6,280       | 5,818       | 191,352   | 2031/4/15  |
|          | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 3.502 | 3,000       | 2,989       | 98,305    | 2027/5/31  |
|          | 3.519 MALAYSIAGOV 280420 | 3.519 | 3,500       | 3,478       | 114,374   | 2028/4/20  |
|          | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 3.582 | 2,370       | 2,317       | 76,197    | 2032/7/15  |
|          | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 3.733 | 2,800       | 2,802       | 92,166    | 2028/6/15  |
|          | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 3.757 | 3,980       | 3,825       | 125,811   | 2040/5/22  |
|          | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3.828 | 3,410       | 3,386       | 111,377   | 2034/7/5   |
|          | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 2,400       | 2,386       | 78,473    | 2033/4/15  |
|          | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3.885 | 3,600       | 3,621       | 119,107   | 2029/8/15  |
|          | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 4,400       | 4,437       | 145,912   | 2027/3/15  |
|          | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3.899 | 5,640       | 5,689       | 187,106   | 2027/11/16 |



| 銘柄    | 銘柄   | 当期末                      |             |             |        | 償還年月日     |            |
|-------|------|--------------------------|-------------|-------------|--------|-----------|------------|
|       |      | 利率                       | 額面金額        | 評価額         |        |           |            |
|       |      |                          |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額 |           |            |
| マレーシア |      | %                        | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | 千円     |           |            |
|       | 国債証券 | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 3.9         | 2,900       | 2,924  | 96,181    | 2026/11/30 |
|       |      | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 3.906       | 2,960       | 2,983  | 98,125    | 2026/7/15  |
|       |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955       | 1,740       | 1,752  | 57,625    | 2025/9/15  |
|       |      | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 4.065       | 5,250       | 5,097  | 167,619   | 2050/6/15  |
|       |      | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 4.232       | 2,550       | 2,607  | 85,741    | 2031/6/30  |
|       |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254       | 2,600       | 2,660  | 87,485    | 2035/5/31  |
|       |      | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392       | 1,940       | 1,972  | 64,867    | 2026/4/15  |
|       |      | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 4.457       | 2,400       | 2,473  | 81,355    | 2053/3/31  |
|       |      | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498       | 4,240       | 4,394  | 144,523   | 2030/4/15  |
|       |      | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 4.504       | 1,500       | 1,552  | 51,053    | 2029/4/30  |
|       |      | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 4.642       | 3,200       | 3,377  | 111,071   | 2033/11/7  |
|       |      | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 4.696       | 6,000       | 6,414  | 210,948   | 2042/10/15 |
|       |      | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736       | 1,650       | 1,771  | 58,242    | 2046/3/15  |
|       |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4.762       | 4,440       | 4,747  | 156,109   | 2037/4/7   |
|       |      | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 4.893       | 3,360       | 3,661  | 120,396   | 2038/6/8   |
|       |      | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 4.921       | 2,720       | 2,997  | 98,566    | 2048/7/6   |
|       |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935       | 1,550       | 1,704  | 56,052    | 2043/9/30  |
| 小     | 計    |                          |             |             |        | 3,086,150 |            |
| 中国    |      |                          |             | 千中国元        | 千中国元   |           |            |
|       | 国債証券 | 1.99 CHINA GOVT 260315   | 1.99        | 35,000      | 35,083 | 756,855   | 2026/3/15  |
|       |      | 2 CHINA GOVT 250615      | 2.0         | 42,000      | 42,076 | 907,713   | 2025/6/15  |
|       |      | 2.04 CHINA GOVT 270225   | 2.04        | 37,000      | 37,081 | 799,952   | 2027/2/25  |
|       |      | 2.18 CHINA GOVT 250825   | 2.18        | 34,000      | 34,139 | 736,490   | 2025/8/25  |
|       |      | 2.18 CHINA GOVT 260815   | 2.18        | 39,000      | 39,188 | 845,407   | 2026/8/15  |
|       |      | 2.22 CHINA GOVT 250925   | 2.22        | 50,000      | 50,238 | 1,083,793 | 2025/9/25  |
|       |      | 2.24 CHINA GOVT 250525   | 2.24        | 30,000      | 30,136 | 650,128   | 2025/5/25  |
|       |      | 2.28 CHINA GOVT 251125   | 2.28        | 34,000      | 34,211 | 738,054   | 2025/11/25 |
|       |      | 2.28 CHINA GOVT 310325   | 2.28        | 17,000      | 17,031 | 367,428   | 2031/3/25  |
|       |      | 2.3 CHINA GOVT 260515    | 2.3         | 30,000      | 30,216 | 651,862   | 2026/5/15  |
|       |      | 2.33 CHINA GOVT 251215   | 2.33        | 45,000      | 45,323 | 977,764   | 2025/12/15 |
|       |      | 2.35 CHINA GOVT 340225   | 2.35        | 21,000      | 21,109 | 455,404   | 2034/2/25  |
|       |      | 2.37 CHINA GOVT 270120   | 2.37        | 28,000      | 28,282 | 610,134   | 2027/1/20  |
|       |      | 2.37 CHINA GOVT 290115   | 2.37        | 58,000      | 58,692 | 1,266,182 | 2029/1/15  |
|       |      | 2.39 CHINA GOVT 261115   | 2.39        | 66,000      | 66,694 | 1,438,817 | 2026/11/15 |
|       |      | 2.4 CHINA GOVT 280715    | 2.4         | 58,000      | 58,630 | 1,264,849 | 2028/7/15  |
|       |      | 2.44 CHINA GOVT 271015   | 2.44        | 35,000      | 35,396 | 763,609   | 2027/10/15 |
|       |      | 2.46 CHINA GOVT 260215   | 2.46        | 86,000      | 86,796 | 1,872,479 | 2026/2/15  |
|       |      | 2.48 CHINA GOVT 270415   | 2.48        | 28,000      | 28,392 | 612,523   | 2027/4/15  |
|       |      | 2.48 CHINA GOVT 280925   | 2.48        | 18,000      | 18,262 | 393,970   | 2028/9/25  |
|       |      | 2.5 CHINA GOVT 270725    | 2.5         | 61,000      | 61,850 | 1,334,309 | 2027/7/25  |
|       |      | 2.52 CHINA GOVT 330825   | 2.52        | 52,000      | 52,831 | 1,139,735 | 2033/8/25  |
|       |      | 2.54 CHINA GOVT 301225   | 2.54        | 65,000      | 66,122 | 1,426,470 | 2030/12/25 |
|       |      | 2.55 CHINA GOVT 281015   | 2.55        | 50,000      | 50,919 | 1,098,492 | 2028/10/15 |
|       |      | 2.6 CHINA GOVT 300915    | 2.6         | 52,000      | 53,038 | 1,144,206 | 2030/9/15  |
|       |      | 2.6 CHINA GOVT 320901    | 2.6         | 37,000      | 37,769 | 814,808   | 2032/9/1   |
|       |      | 2.62 CHINA GOVT 280415   | 2.62        | 56,000      | 57,055 | 1,230,862 | 2028/4/15  |
|       |      | 2.62 CHINA GOVT 290925   | 2.62        | 29,000      | 29,639 | 639,416   | 2029/9/25  |

| 銘柄 |      |                        | 当 期 末 |        |        |           | 償還年月日      |
|----|------|------------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
|    |      |                        | 利 率   | 額面金額   | 評 価 額  |           |            |
|    |      |                        |       |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
|    |      |                        | 千中国元  | 千中国元   | 千円     |           |            |
| 中国 | 国債証券 | 2.62 CHINA GOVT 300625 | 2.62  | 60,000 | 61,269 | 1,321,772 | 2030/6/25  |
|    |      | 2.64 CHINA GOVT 280115 | 2.64  | 41,000 | 41,775 | 901,225   | 2028/1/15  |
|    |      | 2.67 CHINA GOVT 330525 | 2.67  | 52,000 | 53,332 | 1,150,542 | 2033/5/25  |
|    |      | 2.67 CHINA GOVT 331125 | 2.67  | 46,000 | 47,357 | 1,021,640 | 2033/11/25 |
|    |      | 2.68 CHINA GOVT 300521 | 2.68  | 55,000 | 56,363 | 1,215,925 | 2030/5/21  |
|    |      | 2.69 CHINA GOVT 260812 | 2.69  | 34,000 | 34,561 | 745,598   | 2026/8/12  |
|    |      | 2.69 CHINA GOVT 320815 | 2.69  | 48,000 | 49,302 | 1,063,615 | 2032/8/15  |
|    |      | 2.74 CHINA GOVT 260804 | 2.74  | 24,000 | 24,420 | 526,829   | 2026/8/4   |
|    |      | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 2.75  | 30,000 | 30,851 | 665,571   | 2029/6/15  |
|    |      | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 2.75  | 30,000 | 30,984 | 668,439   | 2032/2/17  |
|    |      | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 2.76  | 37,000 | 38,202 | 824,151   | 2032/5/15  |
|    |      | 2.79 CHINA GOVT 291215 | 2.79  | 31,000 | 31,952 | 689,314   | 2029/12/15 |
|    |      | 2.8 CHINA GOVT 290324  | 2.8   | 42,000 | 43,226 | 932,539   | 2029/3/24  |
|    |      | 2.8 CHINA GOVT 300325  | 2.8   | 45,000 | 46,428 | 1,001,614 | 2030/3/25  |
|    |      | 2.8 CHINA GOVT 321115  | 2.8   | 29,000 | 30,058 | 648,449   | 2032/11/15 |
|    |      | 2.85 CHINA GOVT 270604 | 2.85  | 32,000 | 32,814 | 707,916   | 2027/6/4   |
|    |      | 2.88 CHINA GOVT 330225 | 2.88  | 36,000 | 37,597 | 811,104   | 2033/2/25  |
|    |      | 2.89 CHINA GOVT 311118 | 2.89  | 23,000 | 24,001 | 517,780   | 2031/11/18 |
|    |      | 2.9 CHINA GOVT 260505  | 2.9   | 24,000 | 24,490 | 528,338   | 2026/5/5   |
|    |      | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 2.91  | 32,000 | 33,082 | 713,693   | 2028/10/14 |
|    |      | 2.99 CHINA GOVT 251015 | 2.99  | 39,000 | 39,671 | 855,844   | 2025/10/15 |
|    |      | 3 CHINA GOVT 531015    | 3.0   | 23,000 | 25,219 | 544,062   | 2053/10/15 |
|    |      | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 3.01  | 39,000 | 40,431 | 872,226   | 2028/5/13  |
|    |      | 3.02 CHINA GOVT 251022 | 3.02  | 36,000 | 36,641 | 790,470   | 2025/10/22 |
|    |      | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 3.02  | 39,000 | 40,982 | 884,111   | 2031/5/27  |
|    |      | 3.03 CHINA GOVT 260311 | 3.03  | 28,000 | 28,616 | 617,340   | 2026/3/11  |
|    |      | 3.12 CHINA GOVT 261205 | 3.12  | 37,000 | 38,217 | 824,460   | 2026/12/5  |
|    |      | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 3.12  | 21,000 | 23,121 | 498,807   | 2052/10/25 |
|    |      | 3.13 CHINA GOVT 291121 | 3.13  | 24,000 | 25,272 | 545,212   | 2029/11/21 |
|    |      | 3.19 CHINA GOVT 530415 | 3.19  | 19,000 | 21,231 | 458,034   | 2053/4/15  |
|    |      | 3.22 CHINA GOVT 251206 | 3.22  | 18,000 | 18,410 | 397,160   | 2025/12/6  |
|    |      | 3.25 CHINA GOVT 260606 | 3.25  | 28,000 | 28,831 | 621,993   | 2026/6/6   |
|    |      | 3.25 CHINA GOVT 281122 | 3.25  | 25,000 | 26,314 | 567,685   | 2028/11/22 |
|    |      | 3.27 CHINA GOVT 301119 | 3.27  | 35,000 | 37,402 | 806,878   | 2030/11/19 |
|    |      | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 3.28  | 24,000 | 25,114 | 541,801   | 2027/12/3  |
|    |      | 3.29 CHINA GOVT 290523 | 3.29  | 29,000 | 30,736 | 663,086   | 2029/5/23  |
|    |      | 3.32 CHINA GOVT 520415 | 3.32  | 21,000 | 23,922 | 516,090   | 2052/4/15  |
|    |      | 3.39 CHINA GOVT 500316 | 3.39  | 43,000 | 49,062 | 1,058,432 | 2050/3/16  |
|    |      | 3.52 CHINA GOVT 270504 | 3.52  | 7,000  | 7,360  | 158,795   | 2027/5/4   |
|    |      | 3.53 CHINA GOVT 511018 | 3.53  | 20,000 | 23,505 | 507,093   | 2051/10/18 |
|    |      | 3.54 CHINA GOVT 280816 | 3.54  | 13,000 | 13,845 | 298,682   | 2028/8/16  |
|    |      | 3.59 CHINA GOVT 270803 | 3.59  | 7,000  | 7,402  | 159,684   | 2027/8/3   |
|    |      | 3.6 CHINA GOVT 250906  | 3.6   | 8,000  | 8,216  | 177,249   | 2025/9/6   |
|    |      | 3.61 CHINA GOVT 250607 | 3.61  | 10,000 | 10,221 | 220,510   | 2025/6/7   |
|    |      | 3.69 CHINA GOVT 280517 | 3.69  | 15,000 | 16,059 | 346,448   | 2028/5/17  |
|    |      | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 3.72  | 22,000 | 26,593 | 573,707   | 2051/4/12  |
|    |      | 3.81 CHINA GOVT 500914 | 3.81  | 38,000 | 46,441 | 1,001,895 | 2050/9/14  |

| 銘     | 柄                        | 当 期 末                    |       |            |            | 償還年月日       |            |
|-------|--------------------------|--------------------------|-------|------------|------------|-------------|------------|
|       |                          | 利 率                      | 額面金額  | 評 価 額      |            |             |            |
|       |                          |                          |       | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |             |            |
| 中国    |                          |                          | %     | 千中国元       | 千中国元       | 千円          |            |
|       | 国債証券                     | 3.86 CHINA GOVT 490722   | 3.86  | 33,000     | 40,427     | 872,156     | 2049/7/22  |
|       |                          | 4.08 CHINA GOVT 481022   | 4.08  | 29,000     | 36,572     | 788,991     | 2048/10/22 |
| 小 計   |                          |                          |       |            |            | 59,846,705  |            |
| イスラエル |                          |                          |       | 千イスラエルシェケル | 千イスラエルシェケル |             |            |
|       | 国債証券                     | 0.5 ISRAEL FIXED 260227  | 0.5   | 5,800      | 5,463      | 229,470     | 2026/2/27  |
|       |                          | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 1.0   | 6,620      | 5,483      | 230,338     | 2030/3/31  |
|       |                          | 1.3 ISRAEL FIXED 320430  | 1.3   | 4,800      | 3,788      | 159,129     | 2032/4/30  |
|       |                          | 1.5 ISRAEL FIXED 370531  | 1.5   | 4,900      | 3,440      | 144,496     | 2037/5/31  |
|       |                          | 2 ISRAEL FIXED BO 270331 | 2.0   | 7,000      | 6,592      | 276,902     | 2027/3/31  |
|       |                          | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 2.25  | 3,080      | 2,886      | 121,235     | 2028/9/28  |
|       |                          | 2.8 ISRAEL FIXED 521129  | 2.8   | 1,900      | 1,282      | 53,874      | 2052/11/29 |
|       |                          | 3.75 ISRAEL FIXED 290228 | 3.75  | 4,600      | 4,538      | 190,649     | 2029/2/28  |
|       |                          | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 3.75  | 4,680      | 3,925      | 164,881     | 2047/3/31  |
|       |                          | 4 ISRAEL FIXED BO 350330 | 4.0   | 1,700      | 1,627      | 68,365      | 2035/3/30  |
|       | 5.5 ISRAEL FIXED 420131  | 5.5                      | 3,130 | 3,418      | 143,608    | 2042/1/31   |            |
|       | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 6.25                     | 5,000 | 5,393      | 226,529    | 2026/10/30  |            |
| 小 計   |                          |                          |       |            |            | 2,009,481   |            |
| 合 計   |                          |                          |       |            |            | 621,579,696 |            |

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

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>621,579,696 | %<br>97.0 |
| コール・ローン等、その他 | 19,241,364        | 3.0       |
| 投資信託財産総額     | 640,821,060       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産 (631,377,693千円) の投資信託財産総額 (640,821,060千円) に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                       |                     |                      |                    |
|-----------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=155.98円      | 1 カナダドル=114.02円     | 1 メキシコペソ=9.2996円     | 1 ユーロ=167.96円      |
| 1 イギリスポンド=195.24円     | 1 スウェーデンクローネ=14.38円 | 1 ノルウェークローネ=14.36円   | 1 デンマーククローネ=22.52円 |
| 1 ボーランドズロチ=39.032円    | 1 オーストラリアドル=102.88円 | 1 ニュージーランドドル=93.81円  | 1 シンガポールドル=115.13円 |
| 1 マレーシアリンギット=32.8846円 | 1 中国元=21.5731円      | 1 イスラエルシェケル=42.0043円 |                    |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 645,932,200,221  |
| コール・ローン等        | 8,213,049,473    |
| 公社債(評価額)        | 621,579,696,652  |
| 未収入金            | 10,096,429,878   |
| 未収利息            | 5,141,603,144    |
| 前払費用            | 901,421,074      |
| (B) 負債          | 12,247,373,336   |
| 前受収益            | 111,335          |
| 未払金             | 5,703,945,940    |
| 未払解約金           | 6,543,316,061    |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 633,684,826,885  |
| 元本              | 234,826,201,838  |
| 次期繰越損益金         | 398,858,625,047  |
| (D) 受益権総口数      | 234,826,201,838口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26,985円          |

○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | 13,690,786,610   |
| 受取利息             | 13,691,347,015   |
| その他収益金           | 170,720          |
| 支払利息             | △ 731,125        |
| (B) 有価証券売買損益     | 59,007,213,606   |
| 売買益              | 75,722,382,339   |
| 売買損              | △ 16,715,168,733 |
| (C) 保管費用等        | △ 54,555,199     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 72,643,445,017   |
| (E) 前期繰越損益金      | 251,534,600,483  |
| (F) 追加信託差損益金     | 115,683,853,191  |
| (G) 解約差損益金       | △ 41,003,273,644 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 398,858,625,047  |
| 次期繰越損益金(H)       | 398,858,625,047  |

<注記事項>

- ①期首元本額 187,414,503,873円  
 期中追加設定元本額 74,193,096,689円  
 期中一部解約元本額 26,781,398,724円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6985円です。

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、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) (G) 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。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

|                                     |                 |
|-------------------------------------|-----------------|
| MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)      | 49,105,890,786円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス             | 48,049,779,033円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(毎月分配型)               | 16,257,821,018円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド              | 15,416,262,306円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)            | 12,675,874,758円 |
| MUAM グローバルバランス(退職給付信託向け)(適格機関投資家限定) | 12,357,414,449円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス                  | 6,351,103,113円  |
| つみたて8資産均等バランス                       | 6,329,158,717円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)       | 6,235,501,124円  |
| 海外債券インデックスファンドS                     | 5,540,516,389円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)         | 5,166,547,355円  |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)    | 4,342,814,719円  |
| 海外債券セレクション(ラップ向け)                   | 3,525,643,331円  |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)              | 3,138,734,731円  |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券                  | 2,942,049,447円  |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)                 | 2,418,064,982円  |
| 三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)             | 2,405,637,592円  |
| つみたて4資産均等バランス                       | 2,346,077,233円  |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)        | 2,276,030,188円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)         | 2,068,100,881円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65)                | 2,040,597,578円  |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド            | 1,758,798,143円  |
| MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)            | 1,535,029,601円  |
| 三菱UFJ バランスファンド4 OVA(適格機関投資家限定)      | 1,428,002,895円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40)                | 1,258,746,734円  |

|  |                |
|--|----------------|
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)         | 1,191,054,652円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)       | 1,090,364,496円 |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)          | 1,054,740,906円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 1,022,914,625円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)           | 985,960,602円   |
| eMAXIS バランス (4資産均等型)                   | 980,146,585円   |
| ワールド・インカムオープン                          | 967,154,593円   |
| 三菱UFJ 外国債券オープン                         | 810,529,949円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15)                  | 775,136,896円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)              | 677,826,341円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)            | 559,426,267円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 549,008,624円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)             | 543,583,387円   |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)             | 530,155,597円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)   | 522,918,975円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)   | 457,887,268円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)                | 453,465,274円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)       | 446,352,042円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2030 (確定拠出年金)     | 420,043,104円   |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)           | 398,157,123円   |
| ファンド・マネジャー (海外債券)                      | 304,210,242円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)             | 298,249,453円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)                | 275,933,073円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2040 (確定拠出年金)     | 248,488,172円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2035 (確定拠出年金)     | 238,650,170円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフoward)              | 230,674,940円   |
| eMAXIS バランス (波乗り型)                     | 210,474,759円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)   | 191,864,608円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)   | 190,005,125円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25)                  | 178,894,500円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2050 (確定拠出年金)     | 171,209,004円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2045 (確定拠出年金)     | 166,682,843円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2055 (確定拠出年金)     | 96,444,871円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)                | 95,854,101円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2060 (確定拠出年金)     | 84,269,100円    |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)              | 83,142,554円    |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)      | 55,568,872円    |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)               | 43,862,810円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2065 (確定拠出年金)     | 40,452,442円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80)                  | 39,457,201円    |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)            | 34,365,210円    |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)       | 31,727,206円    |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                  | 24,018,105円    |
| 外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)            | 17,114,425円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)         | 11,201,400円    |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)          | 10,306,798円    |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)            | 8,805,293円     |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)            | 7,583,073円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                  | 4,833,103円     |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA                 | 4,344,917円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                  | 3,666,273円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)            | 3,507,655円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)            | 3,368,341円     |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)             | 2,970,438円     |

|                                       |                  |
|---------------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) V A       | 2,567,288円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) V A         | 1,590,011円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) V A         | 865,947円         |
| e M A X I S マイマネージャ－ 1990s            | 650,062円         |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) V A         | 507,380円         |
| 三菱U F J バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)   | 377,170円         |
| 三菱U F J ターゲット・イヤ－・ファンド2070 (確定拠出年金)   | 316,798円         |
| 三菱U F J バランスファンドV A 3 0 型 (適格機関投資家限定) | 101,696円         |
| 合計                                    | 234,826,201,838円 |

【お 知 ら せ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱U F J アセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)