

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   |                             |
| 信 託 期 間 | 信託期間は2003年3月27日から無期限です。   |                             |
| 運 用 方 針 | 日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。   |                             |
| 主要運用対象  | 外国債券オープン<br>(毎月決算型)   | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。  |
|         | 外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド   | 日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 組 入 制 限 | 外国債券オープン<br>(毎月決算型)   | 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。    |
|         | 外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド   | 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。     |
| 分 配 方 針 | 原則として、毎月19日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。<br>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。<br>分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                             |

# 外国債券オープン (毎月決算型)

## 運用報告書(全体版)

|                        |                        |
|------------------------|------------------------|
| 第264期 (決算日 2025年4月21日) | 第267期 (決算日 2025年7月22日) |
| 第265期 (決算日 2025年5月19日) | 第268期 (決算日 2025年8月19日) |
| 第266期 (決算日 2025年6月19日) | 第269期 (決算日 2025年9月19日) |

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。  
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。  
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

## 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル:0120-668001  
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期                | 基準価額       |           |           | 参考指数    |           | 債券組<br>比率 | 債券先<br>物比率 | 純資産<br>総額    |
|-----|--------------------|------------|-----------|-----------|---------|-----------|-----------|------------|--------------|
|     |                    | (分配落)      | 税込<br>分配金 | 期中<br>騰落率 |         | 期中<br>騰落率 |           |            |              |
| 第41 | 第240期(2023年 4月19日) | 円<br>8,028 | 円<br>10   | %<br>1.0  | 511.906 | %<br>1.5  | 98.7      | %<br>0.3   | 百万円<br>3,788 |
|     | 第241期(2023年 5月19日) | 8,183      | 10        | 2.1       | 524.337 | 2.4       | 94.2      | 0.5        | 3,843        |
|     | 第242期(2023年 6月19日) | 8,430      | 10        | 3.1       | 538.688 | 2.7       | 98.7      | 0.5        | 3,925        |
|     | 第243期(2023年 7月19日) | 8,356      | 10        | △0.8      | 535.816 | △0.5      | 98.6      | 0.6        | 3,851        |
|     | 第244期(2023年 8月21日) | 8,432      | 10        | 1.0       | 542.463 | 1.2       | 98.7      | 0.3        | 3,868        |
|     | 第245期(2023年 9月19日) | 8,478      | 10        | 0.7       | 546.522 | 0.7       | 98.4      | 0.6        | 3,867        |
| 第42 | 第246期(2023年10月19日) | 8,351      | 10        | △1.4      | 539.800 | △1.2      | 98.3      | 0.6        | 3,778        |
|     | 第247期(2023年11月20日) | 8,714      | 10        | 4.5       | 562.616 | 4.2       | 98.5      | 0.5        | 3,927        |
|     | 第248期(2023年12月19日) | 8,589      | 10        | △1.3      | 559.191 | △0.6      | 98.5      | 0.5        | 3,834        |
|     | 第249期(2024年 1月19日) | 8,799      | 10        | 2.6       | 571.887 | 2.3       | 98.1      | 0.8        | 3,892        |
|     | 第250期(2024年 2月19日) | 8,841      | 10        | 0.6       | 576.721 | 0.8       | 97.7      | 1.1        | 3,897        |
|     | 第251期(2024年 3月19日) | 8,834      | 10        | 0.0       | 576.945 | 0.0       | 98.4      | 0.5        | 3,884        |
| 第43 | 第252期(2024年 4月19日) | 8,979      | 10        | 1.8       | 587.633 | 1.9       | 97.9      | 0.7        | 3,900        |
|     | 第253期(2024年 5月20日) | 9,211      | 10        | 2.7       | 602.003 | 2.4       | 98.3      | 0.4        | 3,979        |
|     | 第254期(2024年 6月19日) | 9,347      | 10        | 1.6       | 614.212 | 2.0       | 98.1      | 0.6        | 4,025        |
|     | 第255期(2024年 7月19日) | 9,413      | 10        | 0.8       | 617.527 | 0.5       | 98.4      | 0.5        | 4,030        |
|     | 第256期(2024年 8月19日) | 9,018      | 10        | △4.1      | 593.858 | △3.8      | 98.0      | 0.8        | 3,847        |
|     | 第257期(2024年 9月19日) | 8,878      | 10        | △1.4      | 580.812 | △2.2      | 98.3      | 0.6        | 3,788        |
| 第44 | 第258期(2024年10月21日) | 9,072      | 10        | 2.3       | 601.278 | 3.5       | 98.3      | 0.5        | 3,859        |
|     | 第259期(2024年11月19日) | 9,146      | 10        | 0.9       | 608.132 | 1.1       | 98.6      | 0.2        | 3,876        |
|     | 第260期(2024年12月19日) | 9,115      | 10        | △0.2      | 604.999 | △0.5      | 98.1      | 0.6        | 3,851        |
|     | 第261期(2025年 1月20日) | 9,078      | 10        | △0.3      | 604.966 | △0.0      | 98.1      | 0.6        | 3,828        |
|     | 第262期(2025年 2月19日) | 8,966      | 10        | △1.1      | 596.524 | △1.4      | 98.1      | 0.6        | 3,771        |
|     | 第263期(2025年 3月19日) | 8,971      | 10        | 0.2       | 598.281 | 0.3       | 98.3      | 0.4        | 3,754        |
| 第45 | 第264期(2025年 4月21日) | 8,669      | 10        | △3.3      | 581.809 | △2.8      | 97.8      | 0.8        | 3,618        |
|     | 第265期(2025年 5月19日) | 8,808      | 10        | 1.7       | 593.490 | 2.0       | 98.4      | 0.4        | 3,660        |
|     | 第266期(2025年 6月19日) | 8,936      | 10        | 1.6       | 600.023 | 1.1       | 98.4      | 0.4        | 3,704        |
|     | 第267期(2025年 7月22日) | 9,149      | 10        | 2.5       | 615.062 | 2.5       | 98.4      | 0.4        | 3,775        |
|     | 第268期(2025年 8月19日) | 9,146      | 10        | 0.1       | 616.161 | 0.2       | 97.8      | 0.6        | 3,759        |
|     | 第269期(2025年 9月19日) | 9,281      | 10        | 1.6       | 625.636 | 1.5       | 97.9      | 0.7        | 3,798        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。  
(注2) 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3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

参考指数は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。  
【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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。

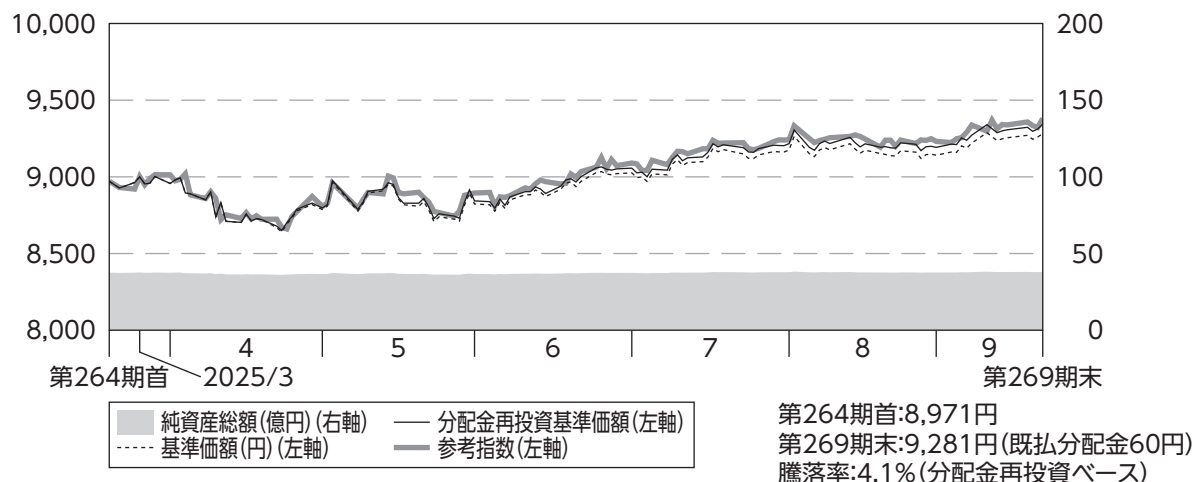
当作成期中の基準価額と市況の推移

| 決算期   | 年 月 日           | 基 準 価 額    |        | 参 考 指 数 |        | 債 券 組 比   | 債 券 先 比  | 債 券 物 率 |
|-------|-----------------|------------|--------|---------|--------|-----------|----------|---------|
|       |                 |            | 騰落率    |         | 騰落率    |           |          |         |
| 第264期 | (期 首)2025年3月19日 | 円<br>8,971 | %<br>— | 598.281 | %<br>— | %<br>98.3 | %<br>0.4 |         |
|       | (期 末)2025年4月21日 | 8,679      | △3.3   | 581.809 | △2.8   | 97.8      | 0.8      |         |
| 第265期 | (期 首)2025年4月21日 | 8,669      | —      | 581.809 | —      | 97.8      | 0.8      |         |
|       | (期 末)2025年5月19日 | 8,818      | 1.7    | 593.490 | 2.0    | 98.4      | 0.4      |         |
| 第266期 | (期 首)2025年5月19日 | 8,808      | —      | 593.490 | —      | 98.4      | 0.4      |         |
|       | (期 末)2025年6月19日 | 8,946      | 1.6    | 600.023 | 1.1    | 98.4      | 0.4      |         |
| 第267期 | (期 首)2025年6月19日 | 8,936      | —      | 600.023 | —      | 98.4      | 0.4      |         |
|       | (期 末)2025年7月22日 | 9,159      | 2.5    | 615.062 | 2.5    | 98.4      | 0.4      |         |
| 第268期 | (期 首)2025年7月22日 | 9,149      | —      | 615.062 | —      | 98.4      | 0.4      |         |
|       | (期 末)2025年8月19日 | 9,156      | 0.1    | 616.161 | 0.2    | 97.8      | 0.6      |         |
| 第269期 | (期 首)2025年8月19日 | 9,146      | —      | 616.161 | —      | 97.8      | 0.6      |         |
|       | (期 末)2025年9月19日 | 9,291      | 1.6    | 625.636 | 1.5    | 97.9      | 0.7      |         |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。  
 (注2) 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3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

## 当作成期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

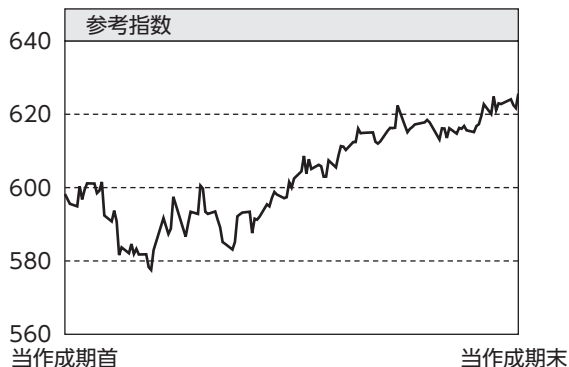


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかにについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及び参考指数は、2025年3月19日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債に投資した結果、当作成期の基準価額は上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場において、主要国の長期金利はレンジ内推移となりました。

FRB(米連邦準備理事会)理事が利下げについて言及したことや、トランプ政権の関税政策に伴う景気後退懸念の高まりなどが、長期金利の低下(債券価格は上昇)要因となりました。一方、米物価指標の高止まりなどが長期金利の上昇要因となりました。

外国為替市場では、日銀が早期に追加利上げに動くとの見方が後退したことなどをを受けて投資国通貨は対円で上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

### 【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

#### (1)債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

#### (2)ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

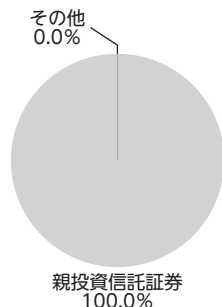
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

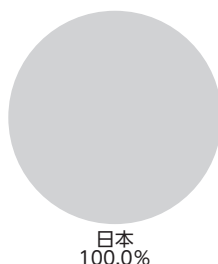
|                    | 当作成期末      |
|--------------------|------------|
|                    | 2025年9月19日 |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 100.0%     |
| その他                | 0.0%       |
| 組入ファンド数            | 1          |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

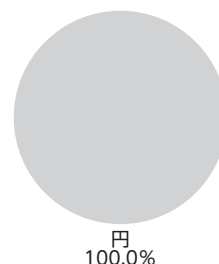
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

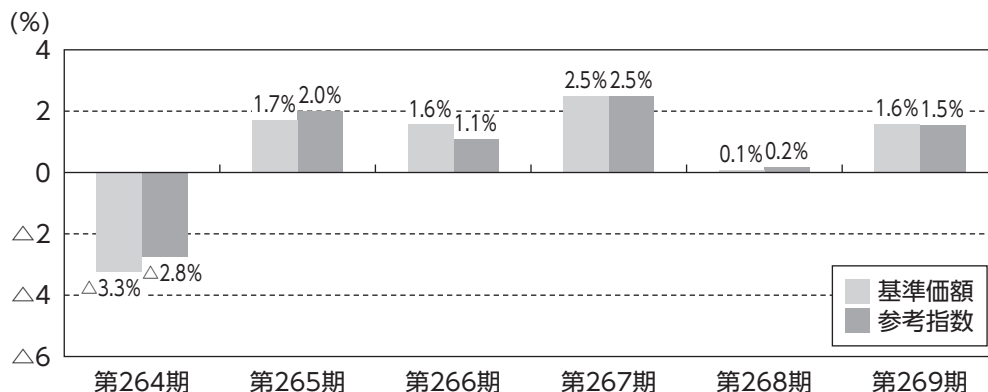


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。  
 その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)と参考指数の騰落率の対比です。



## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目            | 第264期                     | 第265期                     | 第266期                     | 第267期                     | 第268期                     | 第269期                     |
|---------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|               | 2025年3月20日～<br>2025年4月21日 | 2025年4月22日～<br>2025年5月19日 | 2025年5月20日～<br>2025年6月19日 | 2025年6月20日～<br>2025年7月22日 | 2025年7月23日～<br>2025年8月19日 | 2025年8月20日～<br>2025年9月19日 |
| 当期分配金 (円)     | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        |
| (対基準価額比率) (%) | (0.115)                   | (0.113)                   | (0.112)                   | (0.109)                   | (0.109)                   | (0.108)                   |
| 当期の収益 (円)     | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        |
| 当期の収益以外 (円)   | —                         | —                         | —                         | —                         | —                         | —                         |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 546                       | 554                       | 564                       | 577                       | 583                       | 594                       |

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)―印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。



# 1万口当たりの費用明細

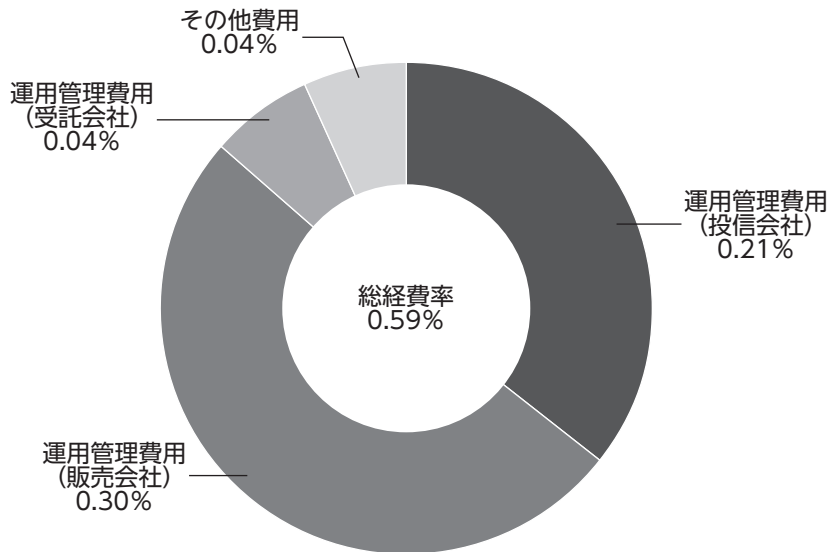
| 項目               | 当作成期                    |         | 項目の概要  |
|------------------|-------------------------|---------|--|
|                  | (2025年3月20日～2025年9月19日) |         |  |
|                  | 金額                      | 比率      |  |
| (a) 信託報酬         | 25円                     | 0.277%  | (a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は8,984円です。<br>信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています<br>委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価<br>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、<br>購入後の情報提供等の対価<br>運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投信会社)           | (9)                     | (0.105) | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| (販売会社)           | (13)                    | (0.150) |  |
| (受託会社)           | (2)                     | (0.022) |  |
| (株式)             | (－)                     | (－)     |  |
| (新株予約権証券)        | (－)                     | (－)     |  |
| (オプション証券等)       | (－)                     | (－)     | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                     | (－)     |  |
| (投資信託証券)         | (－)                     | (－)     |  |
| (商品)             | (－)                     | (－)     |  |
| (先物・オプション)       | (0)                     | (0.000) |  |
| (d) その他費用        | 2                       | 0.018   | (d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用                       |
| (保管費用)           | (1)                     | (0.015) | (e) 合計   |
| (監査費用)           | (0)                     | (0.003) |  |
| (その他)            | (－)                     | (－)     |  |
| 合計               | 27                      | 0.295   |  |

- (注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## <参考情報>

### 総経費率

当作成期中の運用・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0.59%です。



(注1) 各費用は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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                    | 当 作 成 期      |              |               |                |
|--------------------|--------------|--------------|---------------|----------------|
|                    | 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>2, 076 | 千円<br>7, 571 | 千口<br>34, 397 | 千円<br>125, 321 |

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当 作 成 期          |                  |             |                  |                  |             |
|---------------|------------------|------------------|-------------|------------------|------------------|-------------|
|               | 買付額等A            | うち利害関係人との取引状況B   | B<br>A      | 売付額等C            | うち利害関係人との取引状況D   | D<br>C      |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>0. 000302 | 百万円<br>0. 000302 | %<br>100. 0 | 百万円<br>0. 000302 | 百万円<br>0. 000302 | %<br>100. 0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 346              | 32               | 9. 2        | 346              | 32               | 9. 2        |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券インデックス マザーファンド>

| 区 分           | 当 作 成 期        |                |             |                |                |             |
|---------------|----------------|----------------|-------------|----------------|----------------|-------------|
|               | 買付額等A          | うち利害関係人との取引状況B | B<br>A      | 売付額等C          | うち利害関係人との取引状況D | D<br>C      |
| 為 替 先 物 取 引   | 百万円<br>41, 247 | 百万円<br>41, 247 | %<br>100. 0 | 百万円<br>39, 643 | 百万円<br>39, 643 | %<br>100. 0 |
| 為 替 直 物 取 引   | 26, 971        | 24, 599        | 91. 2       | 6, 369         | 6, 035         | 94. 8       |
| 金 銭 信 託       | 0. 442600      | 0. 442600      | 100. 0      | 0. 442600      | 0. 442600      | 100. 0      |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 440, 912       | 41, 350        | 9. 4        | 439, 064       | 41, 210        | 9. 4        |

<平均保有割合 0. 9%>

(注1) 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ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

| 種 類                | 前 作 成 期 末         | 当 作 成 期 末         | 評 価 額             |
|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                    | 口 数               | 口 数               | 千 円               |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 千口<br>1, 039, 727 | 千口<br>1, 007, 407 | 千円<br>3, 796, 616 |

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、112, 720, 031千口です。

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

# 投資信託財産の構成

| 項 目                     | 当 作 成 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>3,796,616 | %<br>99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 13,058          | 0.3       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 3,809,674       | 100.0     |

(注1) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(420,786,764千円)の投資信託財産総額(425,154,239千円)に対する比率は99.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当作成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。

|                      |                    |                     |
|----------------------|--------------------|---------------------|
| 1米ドル=148.05円         | 1カナダドル=107.29円     | 1メキシコペソ=8.0625円     |
| 1ユーロ=174.51円         | 1イギリスポンド=200.59円   | 1スウェーデンクローナ=15.83円  |
| 1ノルウェークローネ=14.98円    | 1デンマーククローネ=23.38円  | 1ポーランドズロチ=40.97円    |
| 1オーストラリアドル=97.88円    | 1ニュージーランドドル=87.17円 | 1シンガポールドル=115.46円   |
| 1マレーシアリンギット=35.2046円 | 1オフショア人民元=20.8152円 | 1イスラエルシェケル=44.3228円 |

# 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                        | 第 264 期 末<br>2025年4月21日現在 | 第 265 期 末<br>2025年5月19日現在 | 第 266 期 末<br>2025年6月19日現在 | 第 267 期 末<br>2025年7月22日現在 | 第 268 期 末<br>2025年8月19日現在 | 第 269 期 末<br>2025年9月19日現在 |
|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| (A)資 産                     | 3,624,950,490円            | 3,669,815,725円            | 3,711,708,734円            | 3,784,494,327円            | 3,766,409,108円            | 3,809,674,215円            |
| コール・ローン等                   | 3,532,181                 | 3,324,024                 | 3,557,429                 | 3,569,082                 | 3,323,176                 | 3,667,731                 |
| 外国債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 3,617,208,055             | 3,662,355,274             | 3,702,662,171             | 3,776,774,654             | 3,758,801,327             | 3,796,616,615             |
| 未 収 入 金                    | 4,210,209                 | 4,136,385                 | 5,489,089                 | 4,150,546                 | 4,284,563                 | 9,389,822                 |
| 未 収 利 息                    | 45                        | 42                        | 45                        | 45                        | 42                        | 47                        |
| (B)負 債                     | 6,918,182                 | 9,039,534                 | 7,269,089                 | 8,708,675                 | 6,612,198                 | 11,594,714                |
| 未 払 収 益 分 配 金              | 4,173,444                 | 4,156,286                 | 4,145,575                 | 4,126,809                 | 4,110,780                 | 4,092,413                 |
| 未 払 解 約 金                  | 883,378                   | 3,314,316                 | 1,394,385                 | 2,699,925                 | 889,974                   | 5,720,014                 |
| 未 払 信 託 報 酬                | 1,842,940                 | 1,553,407                 | 1,712,019                 | 1,863,317                 | 1,595,498                 | 1,764,652                 |
| そ の 他 未 払 費 用              | 18,420                    | 15,525                    | 17,110                    | 18,624                    | 15,946                    | 17,635                    |
| (C)純 資 産 総 額 (A-B)         | 3,618,032,308             | 3,660,776,191             | 3,704,439,645             | 3,775,785,652             | 3,759,796,910             | 3,798,079,501             |
| 元 本                        | 4,173,444,861             | 4,156,286,818             | 4,145,575,556             | 4,126,809,201             | 4,110,780,693             | 4,092,413,002             |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | △555,412,553              | △495,510,627              | △441,135,911              | △351,023,549              | △350,983,783              | △294,333,501              |
| (D)受 益 権 総 口 数             | 4,173,444,861口            | 4,156,286,818口            | 4,145,575,556口            | 4,126,809,201口            | 4,110,780,693口            | 4,092,413,002口            |
| 1万口当たり基準価額 (C/D)           | 8.669円                    | 8.808円                    | 8.936円                    | 9.149円                    | 9.146円                    | 9.281円                    |

## ■損益の状況

| 項 目                   | 第 264 期<br>自 2025年3月20日<br>至 2025年4月21日 | 第 265 期<br>自 2025年4月22日<br>至 2025年5月19日 | 第 266 期<br>自 2025年5月20日<br>至 2025年6月19日 | 第 267 期<br>自 2025年6月20日<br>至 2025年7月22日 | 第 268 期<br>自 2025年7月23日<br>至 2025年8月19日 | 第 269 期<br>自 2025年8月20日<br>至 2025年9月19日 |
|-----------------------|---|---|---|---|---|---|
| (A) 配 当 等 収 益         | 1,214円                                  | 919円                                    | 1,042円                                  | 1,202円                                  | 942円                                    | 1,135円                                  |
| 受 取 利 息               | 1,214                                   | 919                                     | 1,042                                   | 1,202                                   | 942                                     | 1,135                                   |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | △120,069,307                            | 63,318,604                              | 58,959,617                              | 94,077,878                              | 4,379,987                               | 60,929,020                              |
| 売 買 益                 | 128,603                                 | 63,654,660                              | 59,034,546                              | 94,355,779                              | 4,526,029                               | 61,205,967                              |
| 売 買 損                 | △120,197,910                            | △336,056                                | △74,929                                 | △277,901                                | △146,042                                | △276,947                                |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △1,861,360                              | △1,568,932                              | △1,729,129                              | △1,881,941                              | △1,611,444                              | △1,782,287                              |
| (D) 当 期 繰 上 金 (A+B+C) | △121,929,453                            | 61,750,591                              | 57,231,530                              | 92,197,139                              | 2,769,485                               | 59,147,868                              |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | △56,736,015                             | △181,989,678                            | △124,008,030                            | △70,535,366                             | 17,474,052                              | 16,056,292                              |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | △372,573,641                            | △371,115,254                            | △370,213,836                            | △368,558,513                            | △367,116,540                            | △365,445,248                            |
| (配 当 等 相 当 額)         | (80,520,632)                            | (80,259,895)                            | (80,123,404)                            | (79,873,067)                            | (79,634,873)                            | (79,503,229)                            |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△453,094,273)                          | (△451,375,149)                          | (△450,337,240)                          | (△448,431,580)                          | (△446,751,413)                          | (△444,948,477)                          |
| (G) 計 (D+E+F)         | △551,239,109                            | △491,354,341                            | △436,990,336                            | △346,896,740                            | △346,873,003                            | △290,241,088                            |
| (H) 収 益 分 配 金         | △4,173,444                              | △4,156,286                              | △4,145,575                              | △4,126,809                              | △4,110,780                              | △4,092,413                              |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)   | △555,412,553                            | △495,510,627                            | △441,135,911                            | △351,023,549                            | △350,983,783                            | △294,333,501                            |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | △372,573,641                            | △371,115,254                            | △370,213,836                            | △368,558,513                            | △367,116,540                            | △365,445,248                            |
| (配 当 等 相 当 額)         | (80,521,657)                            | (80,260,919)                            | (80,124,259)                            | (79,874,953)                            | (79,635,967)                            | (79,505,135)                            |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△453,095,298)                          | (△451,376,173)                          | (△450,338,095)                          | (△448,433,466)                          | (△446,752,507)                          | (△444,950,383)                          |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 147,429,568                             | 150,190,559                             | 154,043,779                             | 158,445,614                             | 160,245,113                             | 163,993,373                             |
| 繰 越 損 益 金             | △330,268,480                            | △274,585,932                            | △224,965,854                            | △140,910,650                            | △144,112,356                            | △92,881,626                             |

(注1) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

### <注記事項>

※当ファンドの第264期首元本額は4,184,500,180円、第264～269期中追加設定元本額は16,713,963円、第264～269期中一部解約元本額は108,801,141円です。

※分配金の計算過程

| 項 目                                 | 第 264 期        | 第 265 期        | 第 266 期        | 第 267 期        | 第 268 期        | 第 269 期        |
|-------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後)                   | 7,320,128円     | 7,581,077円     | 8,445,816円     | 9,323,136円     | 6,580,856円     | 8,761,682円     |
| (B) 有価証券売買等損益額<br>(費用控除後・繰越欠損金補填後)  | －円             | －円             | －円             | －円             | －円             | －円             |
| (C) 収益調整金額                          | 80,521,657円    | 80,260,919円    | 80,124,259円    | 79,874,953円    | 79,635,967円    | 79,505,135円    |
| (D) 分配準備積立金額                        | 144,282,884円   | 146,765,768円   | 149,743,538円   | 153,249,287円   | 157,775,037円   | 159,324,104円   |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D)                | 232,124,669円   | 234,607,764円   | 238,313,613円   | 242,447,376円   | 243,991,860円   | 247,590,921円   |
| (F) 期末残存口数                          | 4,173,444,861口 | 4,156,286,818口 | 4,145,575,556口 | 4,126,809,201口 | 4,110,780,693口 | 4,092,413,002口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり)<br>(E/F×10,000) | 556円           | 564円           | 574円           | 587円           | 593円           | 604円           |
| (H) 分配金額(1万口当たり)                    | 10円            | 10円            | 10円            | 10円            | 10円            | 10円            |
| (I) 収益分配金総額(F×H/10,000)             | 4,173,444円     | 4,156,286円     | 4,145,575円     | 4,126,809円     | 4,110,780円     | 4,092,413円     |

# 分配金のお知らせ

|                   | 第264期 | 第265期 | 第266期 | 第267期 | 第268期 | 第269期 |
|-------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 10円   | 10円   | 10円   | 10円   | 10円   | 10円   |

(注) 分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

## 【分配金の課税上の取扱いについて】

・収益分配金には、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)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

# お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。

本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。

今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第25期（決算日 2025年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 信託期間は2000年5月30日から無期限です。   |
| 運用方針   | 日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。   |
| 組入制限   | 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。   |

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額 |      | ベンチマーク  |      | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 率 比 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|------|---------|------|-------------|-------------|---------|
|                  | 期 騰 落 率 | 中 率  | 期 騰 落 率 | 中 率  |             |             |         |
| 第21期(2021年5月31日) | 円       | %    |         | %    | %           | %           | 百万円     |
|                  | 30,717  | 5.9  | 510.445 | 6.1  | 98.1        | 1.1         | 304,255 |
| 第22期(2022年5月30日) | 30,737  | 0.1  | 509.621 | △0.2 | 97.2        | 1.9         | 306,130 |
| 第23期(2023年5月29日) | 31,760  | 3.3  | 525.385 | 3.1  | 98.4        | 0.8         | 269,104 |
| 第24期(2024年5月29日) | 36,514  | 15.0 | 604.736 | 15.1 | 98.1        | 0.8         | 348,177 |
| 第25期(2025年5月29日) | 35,902  | △1.7 | 592.714 | △2.0 | 97.9        | 0.7         | 387,228 |

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額 |      | ベンチマーク  |      | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 率 比 |
|------------------------|---------|------|---------|------|-------------|-------------|
|                        | 騰 落 率   | 率    | 騰 落 率   | 率    |             |             |
| (当 期 首)<br>2024年 5月29日 | 円       | %    |         | %    | %           | %           |
|                        | 36,514  | －    | 604.736 | －    | 98.1        | 0.8         |
| 5月末                    | 36,255  | △0.7 | 601.573 | △0.5 | 97.7        | 0.8         |
| 6月末                    | 37,511  | 2.7  | 621.561 | 2.8  | 97.6        | 1.1         |
| 7月末                    | 36,151  | △1.0 | 608.326 | 0.6  | 97.8        | 0.9         |
| 8月末                    | 35,226  | △3.5 | 586.818 | △3.0 | 97.9        | 0.8         |
| 9月末                    | 35,307  | △3.3 | 586.361 | △3.0 | 97.7        | 0.9         |
| 10月末                   | 36,763  | 0.7  | 608.878 | 0.7  | 98.0        | 0.6         |
| 11月末                   | 36,014  | △1.4 | 600.817 | △0.6 | 96.7        | 1.7         |
| 12月末                   | 37,140  | 1.7  | 613.976 | 1.5  | 98.0        | 0.8         |
| 2025年 1月末              | 36,363  | △0.4 | 604.077 | △0.1 | 97.5        | 1.0         |
| 2月末                    | 35,655  | △2.4 | 593.912 | △1.8 | 97.5        | 1.1         |
| 3月末                    | 36,037  | △1.3 | 601.106 | △0.6 | 97.8        | 0.8         |
| 4月末                    | 35,409  | △3.0 | 587.354 | △2.9 | 97.5        | 1.2         |
| (当 期 末)<br>2025年 5月29日 | 35,902  | △1.7 | 592.714 | △2.0 | 97.9        | 0.7         |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

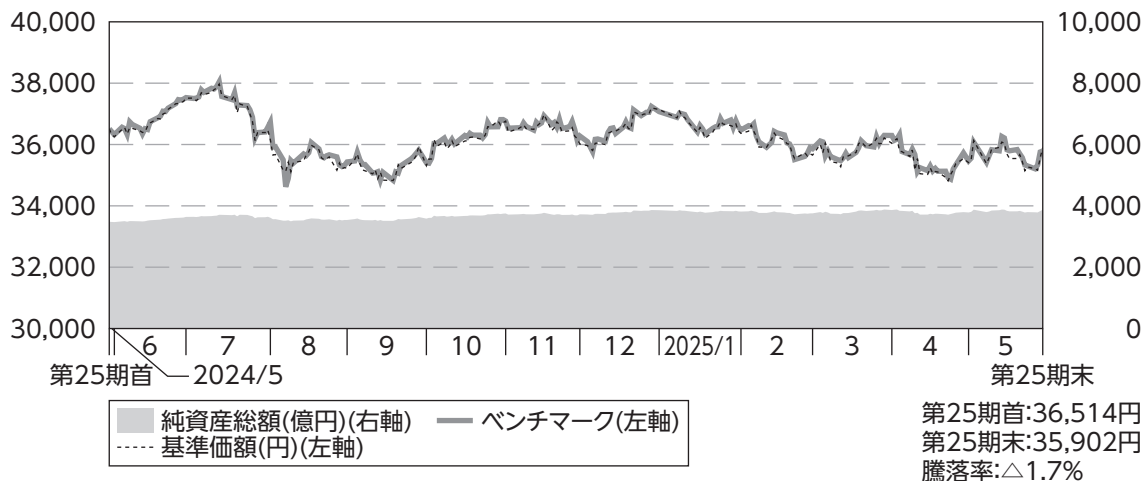
【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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。



## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

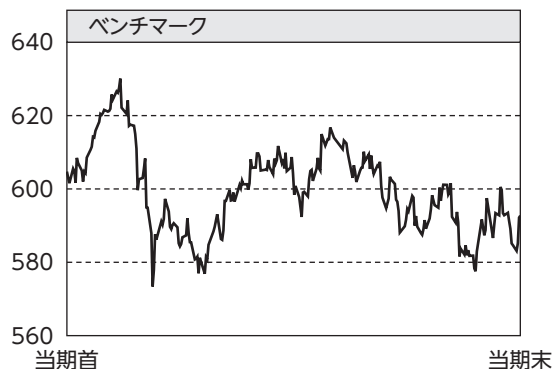


(注)ベンチマークは、2024年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、下落しました。

## 投資環境



外国債券市場では、2024年9月中旬にかけて、米雇用・物価指標の鈍化を背景にした早期利下げ観測の高まりを受けて、主要国の長期金利は低下（債券価格は上昇）しました。その後、2025年1月上旬にかけて、米次期政権下での財政悪化やインフレ再燃が警戒されたこと、米経済指標が相次いで景気の底堅さを示したことなどによる米利下げ観測の後退を受けて、米長期金利を中心に上昇（債券価格は下落）しました。そして、期末にかけて、米政権による相互関税政策によって短期間で乱高下する場面もありましたが、主要国の長期金利は横ばいとなりました。

外国為替市場では、日本と主要国の中央銀行の金融政策の違いを背景に、主要国通貨は対円で下落しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

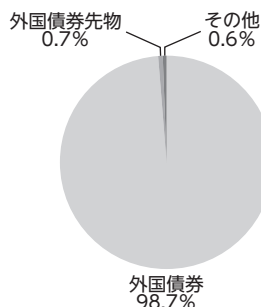
### ○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名               | 国・地域 | 組入比率 |
|----|-------------------|------|------|
| 1  | T 1.25% 12/31/26  | アメリカ | 0.7% |
| 2  | T 0.875% 09/30/26 | アメリカ | 0.6% |
| 3  | T 1.5% 08/15/26   | アメリカ | 0.6% |
| 4  | T 0.375% 07/31/27 | アメリカ | 0.6% |
| 5  | T 2.625% 07/31/29 | アメリカ | 0.5% |
| 6  | T 0.625% 11/30/27 | アメリカ | 0.5% |

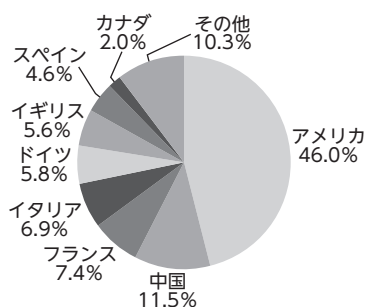
| 順位    | 銘柄名               | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|-------------------|------|------|
| 7     | T 3.875% 08/15/34 | アメリカ | 0.5% |
| 8     | T 4.375% 12/15/26 | アメリカ | 0.5% |
| 9     | T 4.375% 07/15/27 | アメリカ | 0.5% |
| 10    | T 2.875% 08/15/28 | アメリカ | 0.5% |
| 組入銘柄数 |                   |      | 926  |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

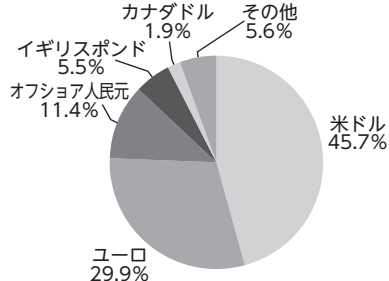
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

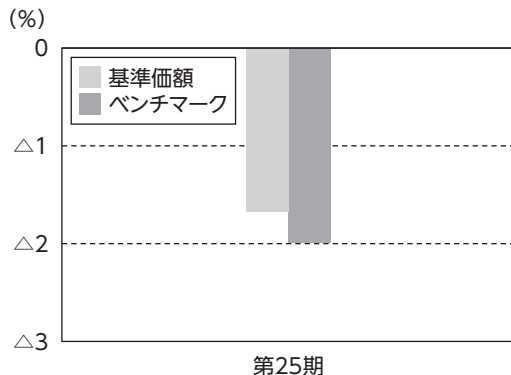


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.7%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主なプラス要因は、為替評価差\*等です。

\*当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

| 項目   | 当期  |   | 項目の概要  |
|--|---|---|--|
|  | (2024年5月30日~2025年5月29日)                             |   |  |
|  | 金額  | 比率  |  |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0) | 0.000%<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料= $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| (b) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)         | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)                 | (b) 有価証券取引税= $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (c) その他費用<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)   | 11<br><br>(11)<br><br>(-)<br>(0)                    | 0.031<br><br>(0.031)<br><br>(-)<br>(0.000)                  | (c) その他費用= $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計   | 11  | 0.031   |  |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(36,152円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

|     |                 |         | 当 期                    |                      |
|-----|-----------------|---------|------------------------|----------------------|
|     |                 |         | 買 付 額                  | 売 付 額                |
| 外 国 | ア メ リ カ         | 国 債 証 券 | 千米ドル<br>407,228        | 千米ドル<br>245,644      |
|     | カ ナ ダ           | 国 債 証 券 | 千カナダドル<br>31,123       | 千カナダドル<br>22,697     |
|     | メ キ シ コ         | 国 債 証 券 | 千メキシコペソ<br>115,838     | 千メキシコペソ<br>55,881    |
|     | ド イ ツ           | 国 債 証 券 | 千ユーロ<br>40,955         | 千ユーロ<br>32,141       |
|     | イ タ リ ア         | 国 債 証 券 | 42,908                 | 35,181               |
|     | フ ラ ン ス         | 国 債 証 券 | 41,681                 | 31,011               |
|     | オ ラ ン ダ         | 国 債 証 券 | 5,525                  | 5,381                |
|     | ス ペ イ ン         | 国 債 証 券 | 23,987                 | 18,049               |
|     | ベ ル ギ ー         | 国 債 証 券 | 5,282                  | 4,850                |
|     | オ ー ス ト リ ア     | 国 債 証 券 | 5,016                  | 2,823                |
|     | フ ィ ン ラ ン ド     | 国 債 証 券 | 2,704                  | 2,087                |
|     | ア イ ル ラ ン ド     | 国 債 証 券 | 842                    | 236                  |
|     | ポ ル ト ガ ル       | 国 債 証 券 | 14,325                 | 101                  |
|     | イ ギ リ ス         | 国 債 証 券 | 千イギリスポンド<br>37,447     | 千イギリスポンド<br>14,724   |
|     | ス ウ ェ ー デ ン     | 国 債 証 券 | 千スウェーデンクローナ<br>9,747   | 千スウェーデンクローナ<br>8,443 |
|     | ノ ル ウ ェ ー       | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ<br>11,005   | 千ノルウェークローネ<br>6,447  |
|     | デ ン マ ー ク       | 国 債 証 券 | 千デンマーククローネ<br>9,680    | 千デンマーククローネ<br>12,166 |
|     | ポ ー ラ ン ド       | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ<br>23,208    | 千ポーランドズロチ<br>10,474  |
|     | オ ー ス ト ラ リ ア   | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル<br>10,492   | 千オーストラリアドル<br>5,084  |
| 国   | ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド | 国 債 証 券 | 千ニュージーランドドル<br>4,048   | 千ニュージーランドドル<br>ー     |
|     | シ ン ガ ポ ー ル     | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル<br>2,798     | 千シンガポールドル<br>2,088   |
|     | マ レ ー シ ア       | 国 債 証 券 | 千マレーシアリンギット<br>11,102  | 千マレーシアリンギット<br>5,893 |
|     | 中 国 オ フ シ ョ ア   | 国 債 証 券 | 千オフショア人民元<br>1,007,092 | 千オフショア人民元<br>409,070 |
|     | イ ス ラ エ ル       | 国 債 証 券 | 千イスラエルシェケル<br>11,835   | 千イスラエルシェケル<br>8,862  |

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

＜先物取引の種類別取引状況＞

| 種 類 別 |        | 当 期           |               |           |          |
|-------|--------|---------------|---------------|-----------|----------|
|       |        | 買 建           |               | 売 建       |          |
|       |        | 新 規 買 付 額     | 決 済 額         | 新 規 売 付 額 | 決 済 額    |
| 外国    | 債券先物取引 | 百万円<br>42,740 | 百万円<br>42,801 | 百万円<br>ー  | 百万円<br>ー |

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当             |                    |               | 期             |                    |               |
|---------------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|               | 買付額等A         | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C         | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為 替 先 物 取 引   | 百万円<br>71,438 | 百万円<br>62,991      | %<br>88.2     | 百万円<br>71,312 | 百万円<br>59,502      | %<br>83.4     |
| 為 替 直 物 取 引   | 63,327        | 48,166             | 76.1          | 18,904        | 17,609             | 93.1          |
| 金 銭 信 託       | 3             | 3                  | 100.0         | 3             | 3                  | 100.0         |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 820,300       | 142,297            | 17.3          | 818,748       | 142,449            | 17.4          |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債>

#### (A) 債券種類別開示

| 区 分      | 当 期                    |                        |                   |           |                 |                   |           |          |
|----------|------------------------|------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------|----------|
|          | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |                   | 組 入 比 率   | うちＢＢ格<br>以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 |           |          |
|          |                        | 外 貨 建 金 額              | 邦 貨 換 算 金 額       |           |                 | 5 年 以 上           | 2 年 以 上   | 2 年 未 満  |
| ア メ リ カ  | 千米ドル<br>1,328,740      | 千米ドル<br>1,197,729      | 千円<br>174,928,324 | %<br>45.2 | %<br>—          | %<br>18.8         | %<br>16.9 | %<br>9.5 |
| カ ナ ダ    | 千カナダドル<br>74,030       | 千カナダドル<br>70,721       | 7,454,756         | 1.9       | —               | 1.1               | 0.5       | 0.4      |
| メ キ シ コ  | 千メキシコペソ<br>418,490     | 千メキシコペソ<br>386,407     | 2,911,967         | 0.8       | —               | 0.4               | 0.3       | 0.1      |
| ド イ ツ    | 千ユーロ<br>141,610        | 千ユーロ<br>133,042        | 21,838,977        | 5.6       | —               | 3.1               | 1.9       | 0.7      |
| イ タ リ ア  | 160,610                | 158,496                | 26,017,167        | 6.7       | —               | 3.9               | 2.0       | 0.8      |
| フ ラ ン ス  | 186,010                | 170,761                | 28,030,533        | 7.2       | —               | 4.0               | 2.4       | 0.9      |
| オ ラ ン ダ  | 33,120                 | 30,449                 | 4,998,358         | 1.3       | —               | 0.8               | 0.4       | 0.1      |
| ス ペ イ ン  | 110,670                | 105,814                | 17,369,417        | 4.5       | —               | 2.5               | 1.5       | 0.5      |
| ベ ル ギ ー  | 39,200                 | 35,986                 | 5,907,143         | 1.5       | —               | 1.1               | 0.4       | 0.1      |
| オーストリア   | 28,640                 | 25,690                 | 4,217,151         | 1.1       | —               | 0.7               | 0.3       | 0.1      |
| フィンランド   | 12,720                 | 11,319                 | 1,858,077         | 0.5       | —               | 0.3               | 0.1       | 0.0      |
| アイルランド   | 12,290                 | 10,958                 | 1,798,792         | 0.5       | —               | 0.3               | 0.1       | 0.1      |
| ポルトガル    | 14,710                 | 14,066                 | 2,308,984         | 0.6       | —               | 0.3               | 0.2       | 0.1      |
| イ ギ リ ス  | 千イギリスポンド<br>131,620    | 千イギリスポンド<br>107,147    | 21,021,235        | 5.4       | —               | 3.8               | 1.1       | 0.5      |
| スウェーデン   | 千スウェーデンクローナ<br>48,130  | 千スウェーデンクローナ<br>47,039  | 708,418           | 0.2       | —               | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| ノルウェー    | 千ノルウェークローネ<br>45,190   | 千ノルウェークローネ<br>41,989   | 600,446           | 0.2       | —               | 0.1               | 0.0       | 0.0      |
| デンマーク    | 千デンマーククローネ<br>39,280   | 千デンマーククローネ<br>37,289   | 820,362           | 0.2       | —               | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| ポーランド    | 千ポーランドズロチ<br>63,110    | 千ポーランドズロチ<br>60,153    | 2,331,541         | 0.6       | —               | 0.2               | 0.3       | 0.1      |
| オーストラリア  | 千オーストラリアドル<br>53,700   | 千オーストラリアドル<br>49,085   | 4,604,735         | 1.2       | —               | 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>14,100  | 千ニュージーランドドル<br>12,956  | 1,127,632         | 0.3       | —               | 0.2               | 0.1       | 0.0      |
| シンガポール   | 千シンガポールドル<br>13,530    | 千シンガポールドル<br>13,703    | 1,546,865         | 0.4       | —               | 0.2               | 0.1       | 0.1      |
| マレーシア    | 千マレーシアリンギット<br>54,660  | 千マレーシアリンギット<br>57,103  | 1,961,208         | 0.5       | —               | 0.3               | 0.1       | 0.0      |
| 中国オフショア  | 千オフショア人民元<br>2,032,570 | 千オフショア人民元<br>2,149,255 | 43,579,384        | 11.3      | —               | 4.9               | 4.1       | 2.3      |
| イスラエル    | 千イスラエルシェケル<br>34,300   | 千イスラエルシェケル<br>31,138   | 1,294,656         | 0.3       | —               | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| 合 計      | —                      | —                      | 379,236,139       | 97.9      | —               | 48.1              | 33.2      | 16.6     |

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 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) 個別銘柄開示

| 当        |          | 期          |        | 末      |                |            |
|----------|----------|------------|--------|--------|----------------|------------|
| 銘柄       | 柄        | 利 率<br>(%) | 額面金額   | 評 価    |                | 償還年月日      |
|          |          |            |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| (アメリカ)   |          |            | 千米ドル   | 千米ドル   |                |            |
| 国債証券     |          |            |        |        |                |            |
| T 0.375% | 07/31/27 | 0.375      | 16,100 | 14,898 | 2,175,876      | 2027/7/31  |
| T 0.375% | 09/30/27 | 0.375      | 8,260  | 7,601  | 1,110,193      | 2027/9/30  |
| T 0.5%   | 04/30/27 | 0.5        | 2,940  | 2,751  | 401,787        | 2027/4/30  |
| T 0.5%   | 05/31/27 | 0.5        | 3,500  | 3,265  | 476,920        | 2027/5/31  |
| T 0.5%   | 06/30/27 | 0.5        | 6,960  | 6,477  | 946,007        | 2027/6/30  |
| T 0.5%   | 08/31/27 | 0.5        | 4,660  | 4,313  | 629,920        | 2027/8/31  |
| T 0.5%   | 10/31/27 | 0.5        | 7,500  | 6,903  | 1,008,194      | 2027/10/31 |
| T 0.625% | 03/31/27 | 0.625      | 7,500  | 7,054  | 1,030,251      | 2027/3/31  |
| T 0.625% | 05/15/30 | 0.625      | 9,100  | 7,702  | 1,124,972      | 2030/5/15  |
| T 0.625% | 07/31/26 | 0.625      | 10,800 | 10,366 | 1,514,030      | 2026/7/31  |
| T 0.625% | 08/15/30 | 0.625      | 6,900  | 5,783  | 844,655        | 2030/8/15  |
| T 0.625% | 11/30/27 | 0.625      | 15,500 | 14,273 | 2,084,618      | 2027/11/30 |
| T 0.625% | 12/31/27 | 0.625      | 9,600  | 8,815  | 1,287,531      | 2027/12/31 |
| T 0.75%  | 01/31/28 | 0.75       | 8,500  | 7,812  | 1,140,947      | 2028/1/31  |
| T 0.75%  | 04/30/26 | 0.75       | 9,500  | 9,205  | 1,344,413      | 2026/4/30  |
| T 0.75%  | 05/31/26 | 0.75       | 4,000  | 3,865  | 564,483        | 2026/5/31  |
| T 0.75%  | 08/31/26 | 0.75       | 9,630  | 9,233  | 1,348,609      | 2026/8/31  |
| T 0.875% | 06/30/26 | 0.875      | 8,000  | 7,721  | 1,127,665      | 2026/6/30  |
| T 0.875% | 09/30/26 | 0.875      | 17,160 | 16,441 | 2,401,221      | 2026/9/30  |
| T 0.875% | 11/15/30 | 0.875      | 11,150 | 9,395  | 1,372,229      | 2030/11/15 |
| T 1%     | 07/31/28 | 1.0        | 10,120 | 9,230  | 1,348,063      | 2028/7/31  |
| T 1.125% | 02/15/31 | 1.125      | 4,080  | 3,465  | 506,198        | 2031/2/15  |
| T 1.125% | 02/29/28 | 1.125      | 8,000  | 7,411  | 1,082,458      | 2028/2/29  |
| T 1.125% | 05/15/40 | 1.125      | 1,710  | 1,027  | 150,120        | 2040/5/15  |
| T 1.125% | 08/15/40 | 1.125      | 5,200  | 3,092  | 451,656        | 2040/8/15  |
| T 1.125% | 08/31/28 | 1.125      | 12,030 | 10,988 | 1,604,892      | 2028/8/31  |
| T 1.25%  | 03/31/28 | 1.25       | 8,480  | 7,866  | 1,148,857      | 2028/3/31  |
| T 1.25%  | 04/30/28 | 1.25       | 8,000  | 7,404  | 1,081,408      | 2028/4/30  |
| T 1.25%  | 05/15/50 | 1.25       | 5,550  | 2,562  | 374,211        | 2050/5/15  |
| T 1.25%  | 05/31/28 | 1.25       | 6,000  | 5,541  | 809,345        | 2028/5/31  |
| T 1.25%  | 06/30/28 | 1.25       | 9,000  | 8,294  | 1,211,450      | 2028/6/30  |
| T 1.25%  | 08/15/31 | 1.25       | 9,230  | 7,746  | 1,131,433      | 2031/8/15  |
| T 1.25%  | 09/30/28 | 1.25       | 9,500  | 8,693  | 1,269,648      | 2028/9/30  |
| T 1.25%  | 11/30/26 | 1.25       | 7,000  | 6,712  | 980,377        | 2026/11/30 |
| T 1.25%  | 12/31/26 | 1.25       | 19,030 | 18,208 | 2,659,309      | 2026/12/31 |
| T 1.375% | 08/15/50 | 1.375      | 5,700  | 2,702  | 394,649        | 2050/8/15  |
| T 1.375% | 10/31/28 | 1.375      | 3,520  | 3,227  | 471,401        | 2028/10/31 |
| T 1.375% | 11/15/31 | 1.375      | 12,580 | 10,557 | 1,541,975      | 2031/11/15 |
| T 1.375% | 11/15/40 | 1.375      | 6,000  | 3,702  | 540,790        | 2040/11/15 |
| T 1.375% | 12/31/28 | 1.375      | 8,680  | 7,925  | 1,157,556      | 2028/12/31 |
| T 1.5%   | 01/31/27 | 1.5        | 6,000  | 5,753  | 840,340        | 2027/1/31  |
| T 1.5%   | 02/15/30 | 1.5        | 6,470  | 5,767  | 842,346        | 2030/2/15  |
| T 1.5%   | 08/15/26 | 1.5        | 15,500 | 15,019 | 2,193,562      | 2026/8/15  |
| T 1.5%   | 11/30/28 | 1.5        | 7,500  | 6,893  | 1,006,760      | 2028/11/30 |
| T 1.625% | 05/15/26 | 1.625      | 7,270  | 7,094  | 1,036,176      | 2026/5/15  |
| T 1.625% | 05/15/31 | 1.625      | 10,980 | 9,511  | 1,389,143      | 2031/5/15  |
| T 1.625% | 08/15/29 | 1.625      | 6,750  | 6,136  | 896,226        | 2029/8/15  |
| T 1.625% | 10/31/26 | 1.625      | 12,300 | 11,884 | 1,735,785      | 2026/10/31 |
| T 1.625% | 11/15/50 | 1.625      | 6,900  | 3,501  | 511,410        | 2050/11/15 |
| T 1.625% | 11/30/26 | 1.625      | 4,780  | 4,609  | 673,221        | 2026/11/30 |
| T 1.75%  | 01/31/29 | 1.75       | 10,200 | 9,421  | 1,376,061      | 2029/1/31  |
| T 1.75%  | 08/15/41 | 1.75       | 7,080  | 4,548  | 664,286        | 2041/8/15  |
| T 1.75%  | 11/15/29 | 1.75       | 3,000  | 2,725  | 397,997        | 2029/11/15 |
| T 1.875% | 02/15/32 | 1.875      | 11,720 | 10,100 | 1,475,142      | 2032/2/15  |
| T 1.875% | 02/15/41 | 1.875      | 7,900  | 5,269  | 769,549        | 2041/2/15  |
| T 1.875% | 02/15/51 | 1.875      | 6,600  | 3,572  | 521,821        | 2051/2/15  |
| T 1.875% | 02/28/27 | 1.875      | 6,500  | 6,263  | 914,763        | 2027/2/28  |
| T 1.875% | 02/28/29 | 1.875      | 8,470  | 7,847  | 1,146,173      | 2029/2/28  |
| T 1.875% | 07/31/26 | 1.875      | 5,190  | 5,055  | 738,368        | 2026/7/31  |

| 銘柄                | 利 率<br>(%) | 期      |        | 末              |            |
|-------------------|------------|--------|--------|----------------|------------|
|                   |            | 額面金額   | 評 価    |                | 償還年月日      |
|                   |            |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| T 1.875% 11/15/51 | 1.875      | 3,300  | 1,769  | 258,387        | 2051/11/15 |
| T 2% 02/15/50     | 2.0        | 2,750  | 1,557  | 227,497        | 2050/2/15  |
| T 2% 08/15/51     | 2.0        | 9,850  | 5,476  | 799,795        | 2051/8/15  |
| T 2% 11/15/26     | 2.0        | 6,320  | 6,133  | 895,759        | 2026/11/15 |
| T 2% 11/15/41     | 2.0        | 6,200  | 4,129  | 603,119        | 2041/11/15 |
| T 2.125% 05/31/26 | 2.125      | 3,600  | 3,526  | 515,060        | 2026/5/31  |
| T 2.25% 02/15/27  | 2.25       | 7,250  | 7,036  | 1,027,717      | 2027/2/15  |
| T 2.25% 02/15/52  | 2.25       | 4,300  | 2,534  | 370,136        | 2052/2/15  |
| T 2.25% 05/15/41  | 2.25       | 6,460  | 4,549  | 664,455        | 2041/5/15  |
| T 2.25% 08/15/27  | 2.25       | 7,530  | 7,255  | 1,059,675      | 2027/8/15  |
| T 2.25% 08/15/46  | 2.25       | 2,740  | 1,733  | 253,213        | 2046/8/15  |
| T 2.25% 08/15/49  | 2.25       | 5,500  | 3,330  | 466,389        | 2049/8/15  |
| T 2.25% 11/15/27  | 2.25       | 7,650  | 7,341  | 1,072,242      | 2027/11/15 |
| T 2.375% 02/15/42 | 2.375      | 5,500  | 3,875  | 565,995        | 2042/2/15  |
| T 2.375% 03/31/29 | 2.375      | 9,900  | 9,327  | 1,362,275      | 2029/3/31  |
| T 2.375% 04/30/26 | 2.375      | 2,600  | 2,557  | 373,450        | 2026/4/30  |
| T 2.375% 05/15/27 | 2.375      | 11,690 | 11,332 | 1,655,104      | 2027/5/15  |
| T 2.375% 05/15/29 | 2.375      | 6,010  | 5,652  | 825,489        | 2029/5/15  |
| T 2.375% 05/15/51 | 2.375      | 7,450  | 4,562  | 666,423        | 2051/5/15  |
| T 2.375% 11/15/49 | 2.375      | 4,100  | 2,546  | 371,984        | 2049/11/15 |
| T 2.5% 02/15/45   | 2.5        | 6,810  | 4,630  | 676,289        | 2045/2/15  |
| T 2.5% 02/15/46   | 2.5        | 2,450  | 1,641  | 239,796        | 2046/2/15  |
| T 2.5% 03/31/27   | 2.5        | 7,100  | 6,910  | 1,009,248      | 2027/3/31  |
| T 2.5% 05/15/46   | 2.5        | 1,450  | 968    | 141,432        | 2046/5/15  |
| T 2.625% 02/15/29 | 2.625      | 7,740  | 7,373  | 1,076,952      | 2029/2/15  |
| T 2.625% 05/31/27 | 2.625      | 2,400  | 2,336  | 341,305        | 2027/5/31  |
| T 2.625% 07/31/29 | 2.625      | 15,200 | 14,388 | 2,101,374      | 2029/7/31  |
| T 2.75% 02/15/28  | 2.75       | 8,550  | 8,282  | 1,209,655      | 2028/2/15  |
| T 2.75% 04/30/27  | 2.75       | 5,450  | 5,323  | 777,550        | 2027/4/30  |
| T 2.75% 05/31/29  | 2.75       | 5,700  | 5,434  | 793,673        | 2029/5/31  |
| T 2.75% 08/15/32  | 2.75       | 8,900  | 8,055  | 1,176,435      | 2032/8/15  |
| T 2.75% 08/15/42  | 2.75       | 7,100  | 5,265  | 769,007        | 2042/8/15  |
| T 2.75% 08/15/47  | 2.75       | 4,050  | 2,791  | 407,674        | 2047/8/15  |
| T 2.75% 11/15/42  | 2.75       | 6,020  | 4,443  | 648,957        | 2042/11/15 |
| T 2.75% 11/15/47  | 2.75       | 3,050  | 2,096  | 306,196        | 2047/11/15 |
| T 2.875% 04/30/29 | 2.875      | 11,300 | 10,836 | 1,582,462      | 2029/4/30  |
| T 2.875% 05/15/28 | 2.875      | 8,960  | 8,687  | 1,268,813      | 2028/5/15  |
| T 2.875% 05/15/32 | 2.875      | 10,100 | 9,256  | 1,351,910      | 2032/5/15  |
| T 2.875% 05/15/43 | 2.875      | 5,050  | 3,772  | 550,945        | 2043/5/15  |
| T 2.875% 05/15/49 | 2.875      | 5,080  | 3,527  | 515,122        | 2049/5/15  |
| T 2.875% 05/15/52 | 2.875      | 8,100  | 5,509  | 804,651        | 2052/5/15  |
| T 2.875% 08/15/28 | 2.875      | 13,220 | 12,780 | 1,866,597      | 2028/8/15  |
| T 2.875% 08/15/45 | 2.875      | 2,300  | 1,663  | 242,941        | 2045/8/15  |
| T 2.875% 11/15/46 | 2.875      | 940    | 669    | 97,833         | 2046/11/15 |
| T 3% 02/15/47     | 3.0        | 3,920  | 2,849  | 416,203        | 2047/2/15  |
| T 3% 02/15/48     | 3.0        | 1,000  | 719    | 105,027        | 2048/2/15  |
| T 3% 02/15/49     | 3.0        | 1,000  | 713    | 104,140        | 2049/2/15  |
| T 3% 05/15/42     | 3.0        | 2,450  | 1,897  | 277,074        | 2042/5/15  |
| T 3% 05/15/45     | 3.0        | 700    | 518    | 75,781         | 2045/5/15  |
| T 3% 05/15/47     | 3.0        | 4,710  | 3,414  | 498,670        | 2047/5/15  |
| T 3% 08/15/48     | 3.0        | 3,250  | 2,326  | 339,754        | 2048/8/15  |
| T 3% 08/15/52     | 3.0        | 5,200  | 3,628  | 529,990        | 2052/8/15  |
| T 3% 11/15/44     | 3.0        | 4,900  | 3,651  | 533,323        | 2044/11/15 |
| T 3% 11/15/45     | 3.0        | 2,300  | 1,695  | 247,592        | 2045/11/15 |
| T 3.125% 02/15/42 | 3.125      | 1,050  | 831    | 121,447        | 2042/2/15  |
| T 3.125% 02/15/43 | 3.125      | 3,800  | 2,962  | 432,740        | 2043/2/15  |
| T 3.125% 05/15/48 | 3.125      | 4,780  | 3,509  | 512,599        | 2048/5/15  |
| T 3.125% 08/15/44 | 3.125      | 5,040  | 3,847  | 561,988        | 2044/8/15  |
| T 3.125% 08/31/27 | 3.125      | 6,150  | 6,037  | 881,839        | 2027/8/31  |
| T 3.125% 08/31/29 | 3.125      | 7,150  | 6,896  | 1,007,218      | 2029/8/31  |
| T 3.125% 11/15/28 | 3.125      | 10,410 | 10,119 | 1,477,976      | 2028/11/15 |



外国債券インデックス マザーファンド ー第25期ー

| 銘柄       | 期        | 当     | 利<br>率<br>(%) | 額面金額   | 評 価 額     |                | 償還年月日 |
|----------|----------|-------|---------------|--------|-----------|----------------|-------|
|          |          |       |               |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額<br>(千円) |       |
| T 3.25%  | 05/15/42 | 3.25  | 4,150         | 3,332  | 486,697   | 2042/5/15      |       |
| T 3.25%  | 06/30/29 | 3.25  | 6,500         | 6,310  | 921,642   | 2029/6/30      |       |
| T 3.375% | 05/15/33 | 3.375 | 13,630        | 12,743 | 1,861,190 | 2033/5/15      |       |
| T 3.375% | 05/15/44 | 3.375 | 7,110         | 5,666  | 827,609   | 2044/5/15      |       |
| T 3.375% | 08/15/42 | 3.375 | 2,300         | 1,874  | 273,724   | 2042/8/15      |       |
| T 3.375% | 09/15/27 | 3.375 | 9,000         | 8,883  | 1,297,403 | 2027/9/15      |       |
| T 3.375% | 11/15/48 | 3.375 | 5,300         | 4,059  | 592,885   | 2048/11/15     |       |
| T 3.5%   | 01/31/30 | 3.5   | 9,000         | 8,786  | 1,283,308 | 2030/1/31      |       |
| T 3.5%   | 02/15/33 | 3.5   | 11,200        | 10,594 | 1,547,390 | 2033/2/15      |       |
| T 3.5%   | 02/15/39 | 3.5   | 770           | 675    | 98,677    | 2039/2/15      |       |
| T 3.5%   | 04/30/30 | 3.5   | 3,500         | 3,410  | 498,106   | 2030/4/30      |       |
| T 3.625% | 02/15/44 | 3.625 | 4,890         | 4,061  | 593,121   | 2044/2/15      |       |
| T 3.625% | 02/15/53 | 3.625 | 9,550         | 7,551  | 1,102,827 | 2053/2/15      |       |
| T 3.625% | 05/15/53 | 3.625 | 3,400         | 2,685  | 392,193   | 2053/5/15      |       |
| T 3.625% | 08/15/43 | 3.625 | 4,700         | 3,925  | 573,360   | 2043/8/15      |       |
| T 3.75%  | 06/30/30 | 3.75  | 3,000         | 2,953  | 431,338   | 2030/6/30      |       |
| T 3.75%  | 08/31/31 | 3.75  | 8,000         | 7,798  | 1,138,916 | 2031/8/31      |       |
| T 3.75%  | 11/15/43 | 3.75  | 6,130         | 5,199  | 759,349   | 2043/11/15     |       |
| T 3.75%  | 12/31/30 | 3.75  | 6,160         | 6,040  | 882,149   | 2030/12/31     |       |
| T 3.875% | 02/15/43 | 3.875 | 2,500         | 2,174  | 317,573   | 2043/2/15      |       |
| T 3.875% | 08/15/33 | 3.875 | 11,070        | 10,694 | 1,561,954 | 2033/8/15      |       |
| T 3.875% | 08/15/34 | 3.875 | 13,770        | 13,173 | 1,923,947 | 2034/8/15      |       |
| T 3.875% | 08/15/40 | 3.875 | 1,450         | 1,294  | 189,122   | 2040/8/15      |       |
| T 3.875% | 09/30/29 | 3.875 | 8,540         | 8,483  | 1,239,057 | 2029/9/30      |       |
| T 3.875% | 10/15/27 | 3.875 | 11,000        | 10,974 | 1,602,784 | 2027/10/15     |       |
| T 3.875% | 11/30/29 | 3.875 | 8,130         | 8,071  | 1,178,898 | 2029/11/30     |       |
| T 3.875% | 12/31/29 | 3.875 | 7,500         | 7,443  | 1,087,116 | 2029/12/31     |       |
| T 4%     | 01/15/27 | 4.0   | 7,200         | 7,192  | 1,050,430 | 2027/1/15      |       |
| T 4%     | 02/15/34 | 4.0   | 11,600        | 11,257 | 1,644,115 | 2034/2/15      |       |
| T 4%     | 02/28/30 | 4.0   | 10,350        | 10,327 | 1,508,310 | 2030/2/28      |       |
| T 4%     | 07/31/30 | 4.0   | 3,980         | 3,962  | 578,724   | 2030/7/31      |       |
| T 4%     | 10/31/29 | 4.0   | 6,550         | 6,537  | 954,815   | 2029/10/31     |       |
| T 4%     | 11/15/52 | 4.0   | 6,650         | 5,633  | 822,797   | 2052/11/15     |       |
| T 4.125% | 03/31/29 | 4.125 | 3,350         | 3,362  | 491,150   | 2029/3/31      |       |
| T 4.125% | 03/31/31 | 4.125 | 6,800         | 6,785  | 991,025   | 2031/3/31      |       |
| T 4.125% | 07/31/31 | 4.125 | 5,950         | 5,926  | 865,501   | 2031/7/31      |       |
| T 4.125% | 08/15/53 | 4.125 | 4,300         | 3,723  | 543,772   | 2053/8/15      |       |
| T 4.125% | 08/31/30 | 4.125 | 9,200         | 9,208  | 1,344,893 | 2030/8/31      |       |
| T 4.125% | 10/31/27 | 4.125 | 5,860         | 5,879  | 858,644   | 2027/10/31     |       |
| T 4.125% | 10/31/31 | 4.125 | 5,000         | 4,971  | 726,085   | 2031/10/31     |       |
| T 4.125% | 11/15/32 | 4.125 | 8,000         | 7,916  | 1,156,145 | 2032/11/15     |       |
| T 4.25%  | 02/15/54 | 4.25  | 10,550        | 9,328  | 1,362,368 | 2054/2/15      |       |
| T 4.25%  | 02/28/31 | 4.25  | 9,000         | 9,044  | 1,320,893 | 2031/2/28      |       |
| T 4.25%  | 05/15/39 | 4.25  | 900           | 852    | 124,580   | 2039/5/15      |       |
| T 4.25%  | 06/30/31 | 4.25  | 7,830         | 7,854  | 1,147,189 | 2031/6/30      |       |
| T 4.25%  | 08/15/54 | 4.25  | 4,400         | 3,894  | 568,794   | 2054/8/15      |       |
| T 4.25%  | 11/15/34 | 4.25  | 10,180        | 10,010 | 1,462,047 | 2034/11/15     |       |
| T 4.25%  | 11/15/40 | 4.25  | 740           | 688    | 100,617   | 2040/11/15     |       |
| T 4.375% | 01/31/32 | 4.375 | 1,960         | 1,973  | 288,265   | 2032/1/31      |       |
| T 4.375% | 02/15/38 | 4.375 | 1,000         | 974    | 142,318   | 2038/2/15      |       |
| T 4.375% | 05/15/34 | 4.375 | 9,830         | 9,790  | 1,429,839 | 2034/5/15      |       |
| T 4.375% | 05/15/40 | 4.375 | 1,900         | 1,806  | 263,847   | 2040/5/15      |       |
| T 4.375% | 05/15/41 | 4.375 | 650           | 612    | 89,433    | 2041/5/15      |       |
| T 4.375% | 07/15/27 | 4.375 | 12,800        | 12,898 | 1,883,752 | 2027/7/15      |       |
| T 4.375% | 08/15/26 | 4.375 | 6,000         | 6,015  | 878,559   | 2026/8/15      |       |
| T 4.375% | 08/15/43 | 4.375 | 1,500         | 1,389  | 202,952   | 2043/8/15      |       |
| T 4.375% | 08/31/28 | 4.375 | 10,420        | 10,542 | 1,539,675 | 2028/8/31      |       |
| T 4.375% | 11/15/39 | 4.375 | 960           | 915    | 133,767   | 2039/11/15     |       |
| T 4.375% | 11/30/30 | 4.375 | 4,500         | 4,554  | 665,170   | 2030/11/30     |       |
| T 4.375% | 12/15/26 | 4.375 | 13,000        | 13,056 | 1,906,882 | 2026/12/15     |       |
| T 4.5%   | 02/15/36 | 4.5   | 1,090         | 1,095  | 160,027   | 2036/2/15      |       |
| T 4.5%   | 04/15/27 | 4.5   | 9,150         | 9,228  | 1,347,815 | 2027/4/15      |       |
| T 4.5%   | 05/15/38 | 4.5   | 550           | 543    | 79,326    | 2038/5/15      |       |

| 当             |          | 期          |        | 末      |                |            |
|---------------|----------|------------|--------|--------|----------------|------------|
| 銘             | 柄        | 利 率<br>(%) | 額面金額   | 評 価    | 額              |            |
|               |          |            |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| T 4.5%        | 05/31/29 | 4.5        | 11,000 | 11,190 | 1,634,444      | 2029/5/31  |
| T 4.5%        | 07/15/26 | 4.5        | 10,000 | 10,037 | 1,465,919      | 2026/7/15  |
| T 4.5%        | 08/15/39 | 4.5        | 1,700  | 1,648  | 240,720        | 2039/8/15  |
| T 4.5%        | 11/15/33 | 4.5        | 9,270  | 9,345  | 1,364,857      | 2033/11/15 |
| T 4.5%        | 11/15/54 | 4.5        | 5,350  | 4,944  | 722,093        | 2054/11/15 |
| T 4.625%      | 02/15/35 | 4.625      | 5,990  | 6,060  | 885,159        | 2035/2/15  |
| T 4.625%      | 02/15/40 | 4.625      | 1,380  | 1,351  | 197,447        | 2040/2/15  |
| T 4.625%      | 02/15/55 | 4.625      | 2,600  | 2,454  | 358,488        | 2055/2/15  |
| T 4.625%      | 04/30/31 | 4.625      | 7,070  | 7,235  | 1,056,713      | 2031/4/30  |
| T 4.625%      | 05/15/54 | 4.625      | 9,450  | 8,899  | 1,299,815      | 2054/5/15  |
| T 4.625%      | 09/15/26 | 4.625      | 4,000  | 4,024  | 587,817        | 2026/9/15  |
| T 4.625%      | 09/30/30 | 4.625      | 3,010  | 3,082  | 450,265        | 2030/9/30  |
| T 4.625%      | 10/15/26 | 4.625      | 9,520  | 9,584  | 1,399,819      | 2026/10/15 |
| T 4.75%       | 02/15/41 | 4.75       | 750    | 738    | 107,855        | 2041/2/15  |
| T 4.75%       | 11/15/53 | 4.75       | 3,880  | 3,727  | 544,383        | 2053/11/15 |
| T 4.875%      | 05/31/26 | 4.875      | 3,400  | 3,421  | 499,768        | 2026/5/31  |
| T 4.875%      | 10/31/30 | 4.875      | 4,960  | 5,138  | 750,483        | 2030/10/31 |
| T 5.0%        | 05/15/37 | 5.0        | 400    | 415    | 60,718         | 2037/5/15  |
| T 5.25%       | 11/15/28 | 5.25       | 1,300  | 1,351  | 197,444        | 2028/11/15 |
| T 5.375%      | 02/15/31 | 5.375      | 1,950  | 2,070  | 302,463        | 2031/2/15  |
| T 6.125%      | 11/15/27 | 6.125      | 1,450  | 1,523  | 222,468        | 2027/11/15 |
| T 6.25%       | 05/15/30 | 6.25       | 1,050  | 1,152  | 168,256        | 2030/5/15  |
| 小 計           |          |            |        |        | 174,928,324    |            |
| (カナダ)<br>国債証券 |          |            | 千カナダドル | 千カナダドル |                |            |
| CAN 0.5%      | 12/01/30 | 0.5        | 2,320  | 2,035  | 214,515        | 2030/12/1  |
| CAN 1%        | 06/01/27 | 1.0        | 810    | 784    | 82,721         | 2027/6/1   |
| CAN 1%        | 09/01/26 | 1.0        | 1,530  | 1,499  | 158,112        | 2026/9/1   |
| CAN 1.25%     | 03/01/27 | 1.25       | 5,750  | 5,616  | 591,990        | 2027/3/1   |
| CAN 1.25%     | 06/01/30 | 1.25       | 3,950  | 3,651  | 384,921        | 2030/6/1   |
| CAN 1.5%      | 06/01/26 | 1.5        | 910    | 900    | 94,901         | 2026/6/1   |
| CAN 1.5%      | 06/01/31 | 1.5        | 3,500  | 3,215  | 338,996        | 2031/6/1   |
| CAN 1.5%      | 12/01/31 | 1.5        | 3,620  | 3,295  | 347,379        | 2031/12/1  |
| CAN 1.75%     | 12/01/53 | 1.75       | 2,920  | 1,985  | 209,260        | 2053/12/1  |
| CAN 2%        | 06/01/28 | 2.0        | 410    | 401    | 42,372         | 2028/6/1   |
| CAN 2%        | 06/01/32 | 2.0        | 1,420  | 1,324  | 139,609        | 2032/6/1   |
| CAN 2%        | 12/01/51 | 2.0        | 3,750  | 2,751  | 289,995        | 2051/12/1  |
| CAN 2.25%     | 06/01/29 | 2.25       | 240    | 235    | 24,816         | 2029/6/1   |
| CAN 2.5%      | 12/01/32 | 2.5        | 2,300  | 2,206  | 232,582        | 2032/12/1  |
| CAN 2.75%     | 03/01/30 | 2.75       | 2,560  | 2,548  | 268,677        | 2030/3/1   |
| CAN 2.75%     | 06/01/33 | 2.75       | 1,200  | 1,166  | 122,981        | 2033/6/1   |
| CAN 2.75%     | 09/01/27 | 2.75       | 2,350  | 2,355  | 248,312        | 2027/9/1   |
| CAN 2.75%     | 12/01/48 | 2.75       | 980    | 858    | 90,501         | 2048/12/1  |
| CAN 2.75%     | 12/01/55 | 2.75       | 2,600  | 2,220  | 234,051        | 2055/12/1  |
| CAN 2.75%     | 12/01/64 | 2.75       | 620    | 526    | 55,455         | 2064/12/1  |
| CAN 3%        | 06/01/34 | 3.0        | 4,000  | 3,935  | 414,835        | 2034/6/1   |
| CAN 3.25%     | 06/01/35 | 3.25       | 1,360  | 1,356  | 143,019        | 2035/6/1   |
| CAN 3.25%     | 09/01/28 | 3.25       | 1,890  | 1,920  | 202,467        | 2028/9/1   |
| CAN 3.25%     | 11/01/26 | 3.25       | 2,050  | 2,068  | 218,004        | 2026/11/1  |
| CAN 3.25%     | 12/01/33 | 3.25       | 1,810  | 1,820  | 191,894        | 2033/12/1  |
| CAN 3.25%     | 12/01/34 | 3.25       | 2,860  | 2,861  | 301,654        | 2034/12/1  |
| CAN 3.5%      | 03/01/28 | 3.5        | 1,600  | 1,634  | 172,307        | 2028/3/1   |
| CAN 3.5%      | 09/01/29 | 3.5        | 2,970  | 3,051  | 321,682        | 2029/9/1   |
| CAN 3.5%      | 12/01/45 | 3.5        | 960    | 964    | 101,337        | 2045/12/1  |
| CAN 3.5%      | 12/01/57 | 3.5        | 530    | 523    | 55,628         | 2057/12/1  |
| CAN 4%        | 03/01/29 | 4.0        | 2,180  | 2,275  | 239,830        | 2029/3/1   |
| CAN 4%        | 05/01/26 | 4.0        | 2,250  | 2,279  | 240,233        | 2026/5/1   |
| CAN 4%        | 08/01/26 | 4.0        | 1,490  | 1,514  | 159,604        | 2026/8/1   |
| CAN 4%        | 06/01/41 | 4.0        | 740    | 793    | 83,628         | 2041/6/1   |
| CAN 5%        | 06/01/37 | 5.0        | 490    | 570    | 60,136         | 2037/6/1   |
| CAN 5.75%     | 06/01/29 | 5.75       | 1,490  | 1,658  | 174,825        | 2029/6/1   |
| CAN 5.75%     | 06/01/33 | 5.75       | 1,620  | 1,912  | 201,068        | 2033/6/1   |
| 小 計           |          |            |        |        | 7,454,756      |            |

| 当                    |      | 期          |         | 未       |                |            |
|----------------------|------|------------|---------|---------|----------------|------------|
| 銘                    | 柄    | 利 率<br>(%) | 額面金額    | 評 価 額   |                | 償還年月日      |
|                      |      |            |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| (メキシコ)               |      |            | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ |                |            |
| 国債証券                 |      |            |         |         |                |            |
| MBONO 10% 11/20/36   |      | 10.0       | 8,550   | 8,898   | 67,056         | 2036/11/20 |
| MBONO 5.5% 03/04/27  |      | 5.5        | 33,260  | 31,805  | 239,686        | 2027/3/4   |
| MBONO 7% 09/03/26    |      | 7.0        | 12,380  | 12,201  | 91,949         | 2026/9/3   |
| MBONO 7.5% 05/26/33  |      | 7.5        | 30,430  | 27,395  | 206,454        | 2033/5/26  |
| MBONO 7.5% 06/03/27  |      | 7.5        | 53,140  | 52,435  | 395,155        | 2027/6/3   |
| MBONO 7.75% 05/29/31 |      | 7.75       | 43,580  | 41,076  | 309,550        | 2031/5/2/5 |
| MBONO 7.75% 11/13/42 |      | 7.75       | 41,240  | 33,613  | 253,310        | 2042/11/13 |
| MBONO 7.75% 11/23/34 |      | 7.75       | 34,230  | 30,733  | 231,610        | 2034/11/23 |
| MBONO 8% 07/31/53    |      | 8.0        | 32,730  | 26,479  | 199,551        | 2053/7/31  |
| MBONO 8% 11/07/47    |      | 8.0        | 24,600  | 20,133  | 151,728        | 2047/11/7  |
| MBONO 8.5% 03/01/29  |      | 8.5        | 38,390  | 38,098  | 287,111        | 2029/3/1   |
| MBONO 8.5% 05/31/29  |      | 8.5        | 44,530  | 44,117  | 332,469        | 2029/5/31  |
| MBONO 8.5% 11/18/38  |      | 8.5        | 21,430  | 19,417  | 146,333        | 2038/11/18 |
| 小 計                  |      |            |         |         | 2,911,967      |            |
| (ドイツ)                |      |            | 千ユーロ    | 千ユーロ    |                |            |
| 国債証券                 |      |            |         |         |                |            |
| BKO 2.2% 03/11/27    |      | 2.2        | 1,490   | 1,500   | 246,317        | 2027/3/11  |
| BKO 2.7% 09/17/26    |      | 2.7        | 2,650   | 2,680   | 439,978        | 2026/9/17  |
| BKO 2.9% 06/18/26    |      | 2.9        | 1,290   | 1,304   | 214,137        | 2026/6/18  |
| DBR 0% 02/15/30      |      | —          | 3,500   | 3,179   | 521,867        | 2030/2/15  |
| DBR 0% 02/15/31      |      | —          | 1,660   | 1,469   | 241,234        | 2031/2/15  |
| DBR 0% 02/15/32      |      | —          | 3,620   | 3,114   | 511,260        | 2032/2/15  |
| DBR 0% 05/15/35      |      | —          | 2,260   | 1,751   | 287,573        | 2035/5/15  |
| DBR 0% 05/15/36      |      | —          | 2,430   | 1,819   | 298,634        | 2036/5/15  |
| DBR 0% 08/15/26      |      | —          | 2,920   | 2,859   | 469,355        | 2026/8/15  |
| DBR 0% 08/15/29      |      | —          | 2,360   | 2,172   | 356,550        | 2029/8/15  |
| DBR 0% 08/15/30      |      | —          | 3,050   | 2,737   | 449,367        | 2030/8/15  |
| DBR 0% 08/15/30      |      | —          | 1,280   | 1,149   | 188,653        | 2030/8/15  |
| DBR 0% 08/15/31      |      | —          | 3,490   | 3,047   | 500,282        | 2031/8/15  |
| DBR 0% 08/15/50      |      | —          | 5,240   | 2,505   | 411,280        | 2050/8/15  |
| DBR 0% 08/15/52      |      | —          | 3,020   | 1,360   | 223,305        | 2052/8/15  |
| DBR 0% 11/15/27      |      | —          | 3,340   | 3,196   | 524,660        | 2027/11/15 |
| DBR 0% 11/15/28      |      | —          | 1,990   | 1,864   | 306,052        | 2028/11/15 |
| DBR 0.25% 02/15/27   | 0.25 | 2,490      | 2,427   | 398,445 | 2027/2/15      |            |
| DBR 0.25% 02/15/29   | 0.25 | 1,970      | 1,852   | 304,105 | 2029/2/15      |            |
| DBR 0.25% 08/15/28   | 0.25 | 2,090      | 1,984   | 325,816 | 2028/8/15      |            |
| DBR 0.5% 02/15/28    | 0.5  | 1,360      | 1,312   | 215,459 | 2028/2/15      |            |
| DBR 0.5% 08/15/27    | 0.5  | 350        | 340     | 55,862  | 2027/8/15      |            |
| DBR 1% 05/15/38      | 1.0  | 2,610      | 2,107   | 345,928 | 2038/5/15      |            |
| DBR 1.25% 08/15/48   | 1.25 | 3,480      | 2,484   | 407,853 | 2048/8/15      |            |
| DBR 1.7% 08/15/32    | 1.7  | 2,600      | 2,496   | 409,812 | 2032/8/15      |            |
| DBR 1.8% 08/15/53    | 1.8  | 4,080      | 3,145   | 516,326 | 2053/8/15      |            |
| DBR 2.1% 11/15/29    | 2.1  | 2,680      | 2,684   | 440,677 | 2029/11/15     |            |
| DBR 2.2% 02/15/34    | 2.2  | 3,210      | 3,142   | 515,852 | 2034/2/15      |            |
| DBR 2.3% 02/15/33    | 2.3  | 4,320      | 4,298   | 705,622 | 2033/2/15      |            |
| DBR 2.4% 11/15/30    | 2.4  | 3,220      | 3,258   | 534,945 | 2030/11/15     |            |
| DBR 2.5% 02/15/35    | 2.5  | 2,100      | 2,090   | 343,216 | 2035/2/15      |            |
| DBR 2.5% 07/04/44    | 2.5  | 2,930      | 2,742   | 450,103 | 2044/7/4       |            |
| DBR 2.5% 08/15/46    | 2.5  | 3,120      | 2,893   | 474,910 | 2046/8/15      |            |
| DBR 2.5% 08/15/54    | 2.5  | 2,270      | 2,040   | 334,931 | 2054/8/15      |            |
| DBR 2.6% 05/15/41    | 2.6  | 1,030      | 991     | 162,680 | 2041/5/15      |            |
| DBR 2.6% 08/15/33    | 2.6  | 2,890      | 2,927   | 480,614 | 2033/8/15      |            |
| DBR 2.6% 08/15/34    | 2.6  | 3,560      | 3,585   | 588,596 | 2034/8/15      |            |
| DBR 2.9% 08/15/56    | 2.9  | 700        | 679     | 111,599 | 2056/8/15      |            |
| DBR 3.25% 07/04/42   | 3.25 | 1,950      | 2,037   | 334,522 | 2042/7/4       |            |
| DBR 4.0% 01/04/37    | 4.0  | 2,570      | 2,902   | 476,450 | 2037/1/4       |            |
| DBR 4.25% 07/04/39   | 4.25 | 1,810      | 2,108   | 346,135 | 2039/7/4       |            |
| DBR 4.75% 07/04/28   | 4.75 | 1,430      | 1,552   | 254,838 | 2028/7/4       |            |
| DBR 4.75% 07/04/34   | 4.75 | 2,500      | 2,962   | 486,228 | 2034/7/4       |            |
| DBR 4.75% 07/04/40   | 4.75 | 2,060      | 2,535   | 416,167 | 2040/7/4       |            |
| DBR 5.5% 01/04/31    | 5.5  | 1,850      | 2,171   | 356,447 | 2031/1/4       |            |

| 当          |          | 期       |       | 未           |         |            |
|------------|----------|---------|-------|-------------|---------|------------|
| 銘          | 柄        | 利 率 (%) | 額面金額  | 評 価 額       | 償還年月日   |            |
|            |          |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 (千円) |         |            |
| DBR 5.625% | 01/04/28 | 5.625   | 2,510 | 2,750       | 451,556 | 2028/1/4   |
| DBR 6.25%  | 01/04/30 | 6.25    | 1,850 | 2,187       | 359,066 | 2030/1/4   |
| DBR 6.5%   | 07/04/27 | 6.5     | 2,690 | 2,949       | 484,219 | 2027/7/4   |
| OBL 0%     | 04/16/27 | —       | 2,920 | 2,824       | 463,692 | 2027/4/16  |
| OBL 0%     | 10/09/26 | —       | 2,680 | 2,616       | 429,546 | 2026/10/9  |
| OBL 1.3%   | 10/15/27 | 1.3     | 3,550 | 3,510       | 576,178 | 2027/10/15 |
| OBL 2.1%   | 04/12/29 | 2.1     | 3,360 | 3,372       | 553,616 | 2029/4/12  |
| OBL 2.2%   | 04/13/28 | 2.2     | 2,870 | 2,897       | 475,585 | 2028/4/13  |
| OBL 2.4%   | 10/19/28 | 2.4     | 4,270 | 4,334       | 711,450 | 2028/10/19 |
| OBL 2.5%   | 10/11/29 | 2.5     | 2,090 | 2,128       | 349,398 | 2029/10/11 |
| (イタリア)     |          |         |       |             |         |            |
| 国債証券       |          |         |       |             |         |            |
| BTPS 0%    | 08/01/26 | —       | 3,010 | 2,946       | 483,603 | 2026/8/1   |
| BTPS 0.25% | 03/15/28 | 0.25    | 2,030 | 1,927       | 316,449 | 2028/3/15  |
| BTPS 0.45% | 02/15/29 | 0.45    | 1,640 | 1,532       | 251,495 | 2029/2/15  |
| BTPS 0.5%  | 07/15/28 | 0.5     | 1,300 | 1,234       | 202,629 | 2028/7/15  |
| BTPS 0.6%  | 08/01/31 | 0.6     | 1,960 | 1,711       | 280,901 | 2031/8/1   |
| BTPS 0.85% | 01/15/27 | 0.85    | 2,340 | 2,302       | 377,896 | 2027/1/15  |
| BTPS 0.9%  | 04/01/31 | 0.9     | 2,920 | 2,622       | 430,564 | 2031/4/1   |
| BTPS 0.95% | 03/01/37 | 0.95    | 2,420 | 1,803       | 296,102 | 2037/3/1   |
| BTPS 0.95% | 06/01/32 | 0.95    | 2,090 | 1,821       | 299,051 | 2032/6/1   |
| BTPS 0.95% | 08/01/30 | 0.95    | 1,180 | 1,083       | 177,796 | 2030/8/1   |
| BTPS 0.95% | 09/15/27 | 0.95    | 2,040 | 1,992       | 327,107 | 2027/9/15  |
| BTPS 0.95% | 12/01/31 | 0.95    | 1,630 | 1,441       | 236,615 | 2031/12/1  |
| BTPS 1.1%  | 04/01/27 | 1.1     | 2,350 | 2,314       | 379,854 | 2027/4/1   |
| BTPS 1.25% | 12/01/26 | 1.25    | 1,670 | 1,654       | 271,833 | 2026/12/1  |
| BTPS 1.35% | 04/01/30 | 1.35    | 2,250 | 2,127       | 349,210 | 2030/4/1   |
| BTPS 1.45% | 03/01/36 | 1.45    | 1,730 | 1,409       | 231,339 | 2036/3/1   |
| BTPS 1.5%  | 04/30/45 | 1.5     | 1,250 | 823         | 135,140 | 2045/4/30  |
| BTPS 1.6%  | 06/01/26 | 1.6     | 1,080 | 1,076       | 176,778 | 2026/6/1   |
| BTPS 1.65% | 03/01/32 | 1.65    | 2,670 | 2,458       | 403,627 | 2032/3/1   |
| BTPS 1.65% | 12/01/30 | 1.65    | 2,540 | 2,400       | 394,045 | 2030/12/1  |
| BTPS 1.7%  | 09/01/51 | 1.7     | 1,520 | 935         | 153,573 | 2051/9/1   |
| BTPS 1.8%  | 03/01/41 | 1.8     | 1,210 | 908         | 149,085 | 2041/3/1   |
| BTPS 2%    | 02/01/28 | 2.0     | 2,260 | 2,256       | 370,324 | 2028/2/1   |
| BTPS 2.05% | 08/01/27 | 2.05    | 1,280 | 1,281       | 210,437 | 2027/8/1   |
| BTPS 2.1%  | 07/15/26 | 2.1     | 1,440 | 1,443       | 236,915 | 2026/7/15  |
| BTPS 2.15% | 03/01/72 | 2.15    | 690   | 412         | 67,759  | 2072/3/1   |
| BTPS 2.15% | 09/01/52 | 2.15    | 1,020 | 685         | 112,444 | 2052/9/1   |
| BTPS 2.2%  | 06/01/27 | 2.2     | 2,280 | 2,292       | 376,260 | 2027/6/1   |
| BTPS 2.25% | 09/01/36 | 2.25    | 1,650 | 1,450       | 238,106 | 2036/9/1   |
| BTPS 2.45% | 09/01/33 | 2.45    | 2,310 | 2,187       | 359,146 | 2033/9/1   |
| BTPS 2.45% | 09/01/50 | 2.45    | 1,530 | 1,120       | 183,958 | 2050/9/1   |
| BTPS 2.5%  | 12/01/32 | 2.5     | 2,520 | 2,422       | 397,654 | 2032/12/1  |
| BTPS 2.65% | 12/01/27 | 2.65    | 2,860 | 2,899       | 475,983 | 2027/12/1  |
| BTPS 2.7%  | 03/01/47 | 2.7     | 1,470 | 1,176       | 193,200 | 2047/3/1   |
| BTPS 2.7%  | 10/15/27 | 2.7     | 1,200 | 1,217       | 199,779 | 2027/10/15 |
| BTPS 2.8%  | 03/01/67 | 2.8     | 1,050 | 751         | 123,331 | 2067/3/1   |
| BTPS 2.8%  | 06/15/29 | 2.8     | 2,610 | 2,649       | 434,867 | 2029/6/15  |
| BTPS 2.8%  | 12/01/28 | 2.8     | 2,070 | 2,109       | 346,280 | 2028/12/1  |
| BTPS 2.95% | 02/15/27 | 2.95    | 2,920 | 2,966       | 487,009 | 2027/2/15  |
| BTPS 2.95% | 09/01/38 | 2.95    | 1,380 | 1,266       | 207,827 | 2038/9/1   |
| BTPS 3%    | 08/01/29 | 3.0     | 1,150 | 1,177       | 193,255 | 2029/8/1   |
| BTPS 3.1%  | 03/01/40 | 3.1     | 1,040 | 951         | 156,128 | 2040/3/1   |
| BTPS 3.1%  | 08/28/26 | 3.1     | 1,210 | 1,226       | 201,357 | 2026/8/28  |
| BTPS 3.15% | 11/15/31 | 3.15    | 2,170 | 2,193       | 360,018 | 2031/11/15 |
| BTPS 3.25% | 03/01/38 | 3.25    | 2,080 | 1,977       | 324,566 | 2038/3/1   |
| BTPS 3.25% | 09/01/46 | 3.25    | 2,270 | 1,996       | 327,783 | 2046/9/1   |
| BTPS 3.35% | 03/01/35 | 3.35    | 2,330 | 2,320       | 380,965 | 2035/3/1   |
| BTPS 3.35% | 07/01/29 | 3.35    | 2,620 | 2,708       | 444,555 | 2029/7/1   |
| BTPS 3.4%  | 04/01/28 | 3.4     | 1,550 | 1,602       | 263,076 | 2028/4/1   |
| BTPS 3.45% | 03/01/48 | 3.45    | 1,820 | 1,637       | 268,750 | 2048/3/1   |
| BTPS 3.45% | 07/15/31 | 3.45    | 2,670 | 2,751       | 451,740 | 2031/7/15  |

| 銘柄                  | 利 率<br>(%) | 期 末   |       |                |            |
|---------------------|------------|-------|-------|----------------|------------|
|                     |            | 額面金額  | 評 価 額 |                | 償還年月日      |
|                     |            |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| BTPS 3.5% 02/15/31  | 3.5        | 2,120 | 2,195 | 360,402        | 2031/2/15  |
| BTPS 3.5% 03/01/30  | 3.5        | 2,360 | 2,465 | 404,661        | 2030/3/1   |
| BTPS 3.65% 08/01/35 | 3.65       | 1,260 | 1,276 | 209,479        | 2035/8/1   |
| BTPS 3.7% 06/15/30  | 3.7        | 2,030 | 2,128 | 349,375        | 2030/6/15  |
| BTPS 3.8% 08/01/28  | 3.8        | 2,260 | 2,367 | 388,668        | 2028/8/1   |
| BTPS 3.85% 02/01/35 | 3.85       | 1,230 | 1,272 | 208,824        | 2035/2/1   |
| BTPS 3.85% 07/01/34 | 3.85       | 1,480 | 1,537 | 252,405        | 2034/7/1   |
| BTPS 3.85% 09/01/49 | 3.85       | 1,940 | 1,844 | 302,845        | 2049/9/1   |
| BTPS 3.85% 09/15/26 | 3.85       | 860   | 880   | 144,530        | 2026/9/15  |
| BTPS 3.85% 10/01/40 | 3.85       | 1,300 | 1,283 | 210,679        | 2040/10/1  |
| BTPS 3.85% 12/15/29 | 3.85       | 2,860 | 3,020 | 495,738        | 2029/12/15 |
| BTPS 4% 02/01/37    | 4.0        | 3,070 | 3,193 | 524,146        | 2037/2/1   |
| BTPS 4% 04/30/35    | 4.0        | 880   | 927   | 152,198        | 2035/4/30  |
| BTPS 4% 10/30/31    | 4.0        | 1,250 | 1,332 | 218,688        | 2031/10/30 |
| BTPS 4% 11/15/30    | 4.0        | 2,310 | 2,455 | 403,000        | 2030/11/15 |
| BTPS 4.1% 02/01/29  | 4.1        | 2,070 | 2,194 | 360,308        | 2029/2/1   |
| BTPS 4.15% 10/01/39 | 4.15       | 1,790 | 1,843 | 302,623        | 2039/10/1  |
| BTPS 4.2% 03/01/34  | 4.2        | 2,980 | 3,184 | 522,755        | 2034/3/1   |
| BTPS 4.3% 10/01/54  | 4.3        | 1,120 | 1,113 | 182,752        | 2054/10/1  |
| BTPS 4.35% 11/01/33 | 4.35       | 2,090 | 2,259 | 370,939        | 2033/11/1  |
| BTPS 4.4% 05/01/33  | 4.4        | 1,660 | 1,803 | 296,023        | 2033/5/1   |
| BTPS 4.45% 09/01/43 | 4.45       | 1,140 | 1,195 | 196,318        | 2043/9/1   |
| BTPS 4.5% 10/01/53  | 4.5        | 1,290 | 1,329 | 218,277        | 2053/10/1  |
| BTPS 4.75% 09/01/28 | 4.75       | 2,630 | 2,837 | 465,755        | 2028/9/1   |
| BTPS 4.75% 09/01/44 | 4.75       | 1,850 | 2,021 | 331,789        | 2044/9/1   |
| BTPS 5% 08/01/34    | 5.0        | 2,830 | 3,203 | 525,806        | 2034/8/1   |
| BTPS 5% 09/01/40    | 5.0        | 2,640 | 2,971 | 487,832        | 2040/9/1   |
| BTPS 5.0% 08/01/39  | 5.0        | 2,680 | 3,026 | 496,735        | 2039/8/1   |
| BTPS 5.25% 11/01/29 | 5.25       | 2,930 | 3,275 | 537,693        | 2029/11/1  |
| BTPS 5.75% 02/01/33 | 5.75       | 2,180 | 2,566 | 421,311        | 2033/2/1   |
| BTPS 6% 05/01/31    | 6.0        | 1,140 | 1,340 | 219,984        | 2031/5/1   |
| BTPS 6.5% 11/01/27  | 6.5        | 2,700 | 2,982 | 489,539        | 2027/11/1  |
| BTPS 7.25% 11/01/26 | 7.25       | 1,400 | 1,505 | 247,085        | 2026/11/1  |
| (フランス)              |            |       |       |                |            |
| 国債証券                |            |       |       |                |            |
| FRTR 0% 02/25/27    | —          | 5,200 | 5,030 | 825,675        | 2027/2/25  |
| FRTR 0% 05/25/32    | —          | 3,780 | 3,110 | 510,588        | 2032/5/25  |
| FRTR 0% 11/25/29    | —          | 4,820 | 4,328 | 710,478        | 2029/11/25 |
| FRTR 0% 11/25/30    | —          | 6,120 | 5,318 | 873,040        | 2030/11/25 |
| FRTR 0% 11/25/31    | —          | 5,540 | 4,647 | 762,890        | 2031/11/25 |
| FRTR 0.25% 11/25/26 | 0.25       | 3,700 | 3,611 | 592,766        | 2026/11/25 |
| FRTR 0.5% 05/25/26  | 0.5        | 2,860 | 2,822 | 463,364        | 2026/5/25  |
| FRTR 0.5% 05/25/29  | 0.5        | 5,230 | 4,864 | 798,535        | 2029/5/25  |
| FRTR 0.5% 05/25/40  | 0.5        | 3,140 | 2,026 | 332,689        | 2040/5/25  |
| FRTR 0.5% 05/25/72  | 0.5        | 1,290 | 375   | 61,667         | 2072/5/25  |
| FRTR 0.5% 06/25/44  | 0.5        | 2,030 | 1,152 | 189,232        | 2044/6/25  |
| FRTR 0.75% 02/25/28 | 0.75       | 5,200 | 5,012 | 822,790        | 2028/2/25  |
| FRTR 0.75% 05/25/28 | 0.75       | 5,290 | 5,075 | 833,190        | 2028/5/25  |
| FRTR 0.75% 05/25/52 | 0.75       | 2,950 | 1,423 | 233,707        | 2052/5/25  |
| FRTR 0.75% 05/25/53 | 0.75       | 3,040 | 1,428 | 234,496        | 2053/5/25  |
| FRTR 0.75% 11/25/28 | 0.75       | 5,220 | 4,957 | 813,825        | 2028/11/25 |
| FRTR 1% 05/25/27    | 1.0        | 4,970 | 4,877 | 800,655        | 2027/5/25  |
| FRTR 1.25% 05/25/34 | 1.25       | 5,510 | 4,720 | 774,799        | 2034/5/25  |
| FRTR 1.25% 05/25/36 | 1.25       | 4,950 | 4,018 | 659,671        | 2036/5/25  |
| FRTR 1.25% 05/25/38 | 1.25       | 3,080 | 2,367 | 388,680        | 2038/5/25  |
| FRTR 1.5% 05/25/31  | 1.5        | 5,970 | 5,591 | 917,884        | 2031/5/25  |
| FRTR 1.5% 05/25/50  | 1.5        | 3,050 | 1,905 | 312,793        | 2050/5/25  |
| FRTR 1.75% 05/25/66 | 1.75       | 1,760 | 971   | 159,480        | 2066/5/25  |
| FRTR 1.75% 06/25/39 | 1.75       | 3,570 | 2,882 | 473,141        | 2039/6/25  |
| FRTR 2% 05/25/48    | 2.0        | 2,610 | 1,895 | 311,103        | 2048/5/25  |
| FRTR 2% 11/25/32    | 2.0        | 3,660 | 3,441 | 564,890        | 2032/11/25 |
| FRTR 2.5% 05/25/30  | 2.5        | 5,570 | 5,570 | 914,425        | 2030/5/25  |
| FRTR 2.5% 05/25/43  | 2.5        | 2,410 | 2,034 | 333,970        | 2043/5/25  |

| 銘柄                    | 利 率<br>(%) | 期 末   |       |                |            |
|-----------------------|------------|-------|-------|----------------|------------|
|                       |            | 額面金額  | 評 価 額 |                | 償還年月日      |
|                       |            |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| FRTR 2.5% 09/24/26    | 2.5        | 3,690 | 3,719 | 610,572        | 2026/9/24  |
| FRTR 2.5% 09/24/27    | 2.5        | 4,040 | 4,082 | 670,100        | 2027/9/24  |
| FRTR 2.75% 02/25/29   | 2.75       | 6,950 | 7,056 | 1,158,262      | 2029/2/25  |
| FRTR 2.75% 02/25/30   | 2.75       | 4,280 | 4,331 | 711,081        | 2030/2/25  |
| FRTR 2.75% 10/25/27   | 2.75       | 4,380 | 4,451 | 730,651        | 2027/10/25 |
| FRTR 3% 05/25/33      | 3.0        | 4,210 | 4,218 | 692,408        | 2033/5/25  |
| FRTR 3% 05/25/54      | 3.0        | 2,450 | 2,054 | 337,254        | 2054/5/25  |
| FRTR 3% 06/25/49      | 3.0        | 1,000 | 871   | 143,122        | 2049/6/25  |
| FRTR 3% 11/25/34      | 3.0        | 4,450 | 4,392 | 720,980        | 2034/11/25 |
| FRTR 3.2% 05/25/35    | 3.2        | 2,380 | 2,376 | 390,025        | 2035/5/25  |
| FRTR 3.25% 05/25/45   | 3.25       | 2,980 | 2,780 | 456,439        | 2045/5/25  |
| FRTR 3.25% 05/25/55   | 3.25       | 2,040 | 1,785 | 293,085        | 2055/5/25  |
| FRTR 3.5% 11/25/33    | 3.5        | 4,970 | 5,141 | 843,968        | 2033/11/25 |
| FRTR 3.6% 05/25/42    | 3.6        | 1,050 | 1,039 | 170,689        | 2042/5/25  |
| FRTR 3.75% 05/25/56   | 3.75       | 1,230 | 1,177 | 193,252        | 2056/5/25  |
| FRTR 4% 04/25/55      | 4.0        | 2,540 | 2,561 | 420,449        | 2055/4/25  |
| FRTR 4% 04/25/60      | 4.0        | 1,970 | 1,968 | 323,068        | 2060/4/25  |
| FRTR 4% 10/25/38      | 4.0        | 2,140 | 2,258 | 370,730        | 2038/10/25 |
| FRTR 4.5% 04/25/41    | 4.5        | 3,490 | 3,862 | 633,984        | 2041/4/25  |
| FRTR 4.75% 04/25/35   | 4.75       | 2,960 | 3,349 | 549,792        | 2035/4/25  |
| FRTR 5.5% 04/25/29    | 5.5        | 5,920 | 6,613 | 1,085,563      | 2029/4/25  |
| FRTR 5.75% 10/25/32   | 5.75       | 4,370 | 5,206 | 854,612        | 2032/10/25 |
| (オランダ)                |            |       |       |                |            |
| 国債証券                  |            |       |       |                |            |
| NETHER 0% 01/15/27    | —          | 1,640 | 1,592 | 261,408        | 2027/1/15  |
| NETHER 0% 01/15/29    | —          | 1,770 | 1,642 | 269,662        | 2029/1/15  |
| NETHER 0% 01/15/38    | —          | 1,340 | 927   | 152,182        | 2038/1/15  |
| NETHER 0% 01/15/52    | —          | 1,810 | 811   | 133,201        | 2052/1/15  |
| NETHER 0% 07/15/30    | —          | 1,350 | 1,203 | 197,633        | 2030/7/15  |
| NETHER 0% 07/15/31    | —          | 1,370 | 1,186 | 194,803        | 2031/7/15  |
| NETHER 0.25% 07/15/29 | 0.25       | 1,390 | 1,287 | 211,389        | 2029/7/15  |
| NETHER 0.5% 01/15/40  | 0.5        | 1,470 | 1,039 | 170,595        | 2040/1/15  |
| NETHER 0.5% 07/15/26  | 0.5        | 1,750 | 1,724 | 283,404        | 2026/7/15  |
| NETHER 0.5% 07/15/32  | 0.5        | 1,300 | 1,133 | 186,015        | 2032/7/15  |
| NETHER 0.75% 07/15/27 | 0.75       | 1,060 | 1,035 | 170,003        | 2027/7/15  |
| NETHER 0.75% 07/15/28 | 0.75       | 1,540 | 1,482 | 243,373        | 2028/7/15  |
| NETHER 2% 01/15/54    | 2.0        | 1,490 | 1,176 | 193,043        | 2054/1/15  |
| NETHER 2.5% 01/15/30  | 2.5        | 1,080 | 1,093 | 179,544        | 2030/1/15  |
| NETHER 2.5% 01/15/33  | 2.5        | 1,430 | 1,227 | 234,328        | 2033/1/15  |
| NETHER 2.5% 07/15/33  | 2.5        | 1,170 | 1,162 | 190,799        | 2033/7/15  |
| NETHER 2.5% 07/15/34  | 2.5        | 1,260 | 1,241 | 203,843        | 2034/7/15  |
| NETHER 2.5% 07/15/35  | 2.5        | 940   | 918   | 150,801        | 2035/7/15  |
| NETHER 2.75% 01/15/47 | 2.75       | 2,160 | 2,051 | 336,830        | 2047/1/15  |
| NETHER 3.25% 01/15/44 | 3.25       | 840   | 862   | 141,531        | 2044/1/15  |
| NETHER 3.75% 01/15/42 | 3.75       | 1,700 | 1,857 | 304,932        | 2042/1/15  |
| NETHER 4% 01/15/37    | 4.0        | 1,660 | 1,845 | 302,950        | 2037/1/15  |
| NETHER 5.5% 01/15/28  | 5.5        | 1,600 | 1,745 | 286,444        | 2028/1/15  |
| (スペイン)                |            |       |       |                |            |
| 国債証券                  |            |       |       |                |            |
| SPGB 0% 01/31/27      | —          | 2,910 | 2,819 | 462,767        | 2027/1/31  |
| SPGB 0% 01/31/28      | —          | 3,050 | 2,889 | 474,229        | 2028/1/31  |
| SPGB 0.1% 04/30/31    | 0.1        | 3,160 | 2,733 | 448,681        | 2031/4/30  |
| SPGB 0.5% 04/30/30    | 0.5        | 2,930 | 2,670 | 438,343        | 2030/4/30  |
| SPGB 0.5% 10/31/31    | 0.5        | 2,570 | 2,244 | 368,404        | 2031/10/31 |
| SPGB 0.6% 10/31/29    | 0.6        | 2,930 | 2,716 | 445,852        | 2029/10/31 |
| SPGB 0.7% 04/30/32    | 0.7        | 2,560 | 2,232 | 366,546        | 2032/4/30  |
| SPGB 0.8% 07/30/27    | 0.8        | 2,440 | 2,380 | 390,707        | 2027/7/30  |
| SPGB 0.8% 07/30/29    | 0.8        | 2,810 | 2,640 | 433,444        | 2029/7/30  |
| SPGB 0.85% 07/30/37   | 0.85       | 1,940 | 1,451 | 238,245        | 2037/7/30  |
| SPGB 1% 07/30/42      | 1.0        | 1,550 | 1,025 | 168,355        | 2042/7/30  |
| SPGB 1% 10/31/50      | 1.0        | 2,290 | 1,244 | 204,349        | 2050/10/31 |
| SPGB 1.2% 10/31/40    | 1.2        | 1,810 | 1,297 | 212,982        | 2040/10/31 |
| SPGB 1.25% 10/31/30   | 1.25       | 2,760 | 2,584 | 424,219        | 2030/10/31 |

| 当          |          | 期          |       | 末     |                |            |
|------------|----------|------------|-------|-------|----------------|------------|
| 銘          | 柄        | 利 率<br>(%) | 額面金額  | 評 価 額 |                | 償還年月日      |
|            |          |            |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額<br>(千円) |            |
| SPGB 1.3%  | 10/31/26 | 1.3        | 1,870 | 1,855 | 304,542        | 2026/10/31 |
| SPGB 1.4%  | 04/30/28 | 1.4        | 3,780 | 3,708 | 608,806        | 2028/4/30  |
| SPGB 1.4%  | 07/30/28 | 1.4        | 3,300 | 3,225 | 529,477        | 2028/7/30  |
| SPGB 1.45% | 04/30/29 | 1.45       | 2,690 | 2,608 | 428,135        | 2029/4/30  |
| SPGB 1.45% | 10/31/27 | 1.45       | 2,610 | 2,576 | 422,942        | 2027/10/31 |
| SPGB 1.45% | 10/31/71 | 1.45       | 660   | 309   | 50,837         | 2071/10/31 |
| SPGB 1.5%  | 04/30/27 | 1.5        | 1,400 | 1,389 | 228,079        | 2027/4/30  |
| SPGB 1.85% | 07/30/35 | 1.85       | 2,190 | 1,943 | 319,080        | 2035/7/30  |
| SPGB 1.9%  | 10/31/52 | 1.9        | 1,890 | 1,254 | 205,992        | 2052/10/31 |
| SPGB 1.95% | 04/30/26 | 1.95       | 2,300 | 2,301 | 377,813        | 2026/4/30  |
| SPGB 1.95% | 07/30/30 | 1.95       | 2,020 | 1,970 | 323,455        | 2030/7/30  |
| SPGB 2.35% | 07/30/33 | 2.35       | 2,180 | 2,090 | 343,204        | 2033/7/30  |
| SPGB 2.5%  | 05/31/27 | 2.5        | 2,330 | 2,354 | 386,437        | 2027/5/31  |
| SPGB 2.55% | 10/31/32 | 2.55       | 2,500 | 2,455 | 403,010        | 2032/10/31 |
| SPGB 2.7%  | 10/31/48 | 2.7        | 1,860 | 1,537 | 252,410        | 2048/10/31 |
| SPGB 2.8%  | 05/31/26 | 2.8        | 2,040 | 2,057 | 337,669        | 2026/5/31  |
| SPGB 2.9%  | 10/31/46 | 2.9        | 1,930 | 1,681 | 275,964        | 2046/10/31 |
| SPGB 3.1%  | 07/30/31 | 3.1        | 1,110 | 1,138 | 186,837        | 2031/7/30  |
| SPGB 3.15% | 04/30/33 | 3.15       | 2,170 | 2,208 | 362,587        | 2033/4/30  |
| SPGB 3.15% | 04/30/35 | 3.15       | 1,980 | 1,979 | 324,971        | 2035/4/30  |
| SPGB 3.25% | 04/30/34 | 3.25       | 2,150 | 2,185 | 358,731        | 2034/4/30  |
| SPGB 3.45% | 07/30/43 | 3.45       | 1,720 | 1,650 | 270,973        | 2043/7/30  |
| SPGB 3.45% | 07/30/66 | 3.45       | 1,530 | 1,348 | 221,344        | 2066/7/30  |
| SPGB 3.45% | 10/31/34 | 3.45       | 2,610 | 2,684 | 440,639        | 2034/10/31 |
| SPGB 3.5%  | 01/31/41 | 3.5        | 700   | 686   | 112,708        | 2041/1/31  |
| SPGB 3.5%  | 05/31/29 | 3.5        | 2,500 | 2,613 | 429,003        | 2029/5/31  |
| SPGB 3.55% | 10/31/33 | 3.55       | 2,270 | 2,367 | 388,648        | 2033/10/31 |
| SPGB 3.9%  | 07/30/39 | 3.9        | 1,550 | 1,610 | 264,319        | 2039/7/30  |
| SPGB 4%    | 10/31/54 | 4.0        | 1,110 | 1,109 | 182,076        | 2054/10/31 |
| SPGB 4.2%  | 01/31/37 | 4.2        | 2,320 | 2,515 | 412,842        | 2037/1/31  |
| SPGB 4.7%  | 07/30/41 | 4.7        | 1,990 | 2,244 | 368,430        | 2041/7/30  |
| SPGB 4.9%  | 07/30/40 | 4.9        | 1,880 | 2,163 | 355,213        | 2040/7/30  |
| SPGB 5.15% | 10/31/28 | 5.15       | 2,710 | 2,972 | 487,919        | 2028/10/31 |
| SPGB 5.15% | 10/31/44 | 5.15       | 1,640 | 1,953 | 320,725        | 2044/10/31 |
| SPGB 5.75% | 07/30/32 | 5.75       | 2,250 | 2,683 | 440,548        | 2032/7/30  |
| SPGB 5.9%  | 07/30/26 | 5.9        | 2,310 | 2,416 | 396,718        | 2026/7/30  |
| SPGB 6.0%  | 01/31/29 | 6.0        | 910   | 1,030 | 169,186        | 2029/1/31  |
| (ベルギー)     |          |            |       |       |                |            |
| 国債証券       |          |            |       |       |                |            |
| BGB 0%     | 10/22/27 | —          | 900   | 858   | 140,998        | 2027/10/22 |
| BGB 0%     | 10/22/31 | —          | 1,460 | 1,239 | 203,487        | 2031/10/22 |
| BGB 0.1%   | 06/22/30 | 0.1        | 1,420 | 1,265 | 207,745        | 2030/6/22  |
| BGB 0.35%  | 06/22/32 | 0.35       | 1,810 | 1,538 | 252,590        | 2032/6/22  |
| BGB 0.4%   | 06/22/40 | 0.4        | 1,020 | 654   | 107,360        | 2040/6/22  |
| BGB 0.65%  | 06/22/71 | 0.65       | 530   | 174   | 28,589         | 2071/6/22  |
| BGB 0.8%   | 06/22/27 | 0.8        | 1,510 | 1,476 | 242,309        | 2027/6/22  |
| BGB 0.8%   | 06/22/28 | 0.8        | 1,600 | 1,540 | 252,815        | 2028/6/22  |
| BGB 0.9%   | 06/22/29 | 0.9        | 1,790 | 1,697 | 278,670        | 2029/6/22  |
| BGB 1%     | 06/22/26 | 1.0        | 1,560 | 1,545 | 253,765        | 2026/6/22  |
| BGB 1%     | 06/22/31 | 1.0        | 1,670 | 1,527 | 250,662        | 2031/6/22  |
| BGB 1.25%  | 04/22/33 | 1.25       | 1,310 | 1,171 | 192,383        | 2033/4/22  |
| BGB 1.4%   | 06/22/53 | 1.4        | 1,050 | 616   | 101,189        | 2053/6/22  |
| BGB 1.45%  | 06/22/37 | 1.45       | 800   | 657   | 107,982        | 2037/6/22  |
| BGB 1.6%   | 06/22/47 | 1.6        | 950   | 650   | 106,741        | 2047/6/22  |
| BGB 1.7%   | 06/22/50 | 1.7        | 1,100 | 730   | 119,930        | 2050/6/22  |
| BGB 1.9%   | 06/22/38 | 1.9        | 950   | 807   | 132,500        | 2038/6/22  |
| BGB 2.15%  | 06/22/66 | 2.15       | 880   | 564   | 92,603         | 2066/6/22  |
| BGB 2.25%  | 06/22/57 | 2.25       | 670   | 469   | 77,105         | 2057/6/22  |
| BGB 2.7%   | 10/22/29 | 2.7        | 840   | 853   | 140,156        | 2029/10/22 |
| BGB 2.75%  | 04/22/39 | 2.75       | 730   | 679   | 111,469        | 2039/4/22  |
| BGB 2.85%  | 10/22/34 | 2.85       | 1,260 | 1,245 | 204,469        | 2034/10/22 |
| BGB 3%     | 06/22/33 | 3.0        | 1,450 | 1,468 | 241,077        | 2033/6/22  |
| BGB 3%     | 06/22/34 | 3.0        | 1,220 | 1,226 | 201,293        | 2034/6/22  |

| 当           |          | 期          |       | 末                             |         |            |
|-------------|----------|------------|-------|-------------------------------|---------|------------|
| 銘           | 柄        | 利 率<br>(%) | 額面金額  | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日   |            |
| BGB 3.1%    | 06/22/35 | 3.1        | 520   | 521                           | 85,553  | 2035/6/22  |
| BGB 3.3%    | 06/22/54 | 3.3        | 1,020 | 922                           | 151,376 | 2054/6/22  |
| BGB 3.45%   | 06/22/42 | 3.45       | 540   | 531                           | 87,166  | 2042/6/22  |
| BGB 3.45%   | 06/22/43 | 3.45       | 440   | 431                           | 70,787  | 2043/6/22  |
| BGB 3.5%    | 06/22/55 | 3.5        | 690   | 643                           | 105,691 | 2055/6/22  |
| BGB 3.75%   | 06/22/45 | 3.75       | 930   | 943                           | 154,804 | 2045/6/22  |
| BGB 4%      | 03/28/32 | 4.0        | 880   | 952                           | 156,419 | 2032/3/28  |
| BGB 4.25%   | 03/28/41 | 4.25       | 1,580 | 1,720                         | 282,362 | 2041/3/28  |
| BGB 5%      | 03/28/35 | 5.0        | 2,080 | 2,429                         | 398,734 | 2035/3/28  |
| BGB 5.5%    | 03/28/28 | 5.5        | 2,040 | 2,231                         | 366,350 | 2028/3/28  |
| (オーストラリア)   |          |            |       |                               |         |            |
| 国債証券        |          |            |       |                               |         |            |
| RAGB 0%     | 02/20/30 | —          | 1,790 | 1,605                         | 263,575 | 2030/2/20  |
| RAGB 0%     | 02/20/31 | —          | 1,670 | 1,451                         | 238,285 | 2031/2/20  |
| RAGB 0%     | 10/20/28 | —          | 1,340 | 1,247                         | 204,848 | 2028/10/20 |
| RAGB 0%     | 10/20/40 | —          | 650   | 392                           | 64,505  | 2040/10/20 |
| RAGB 0.25%  | 10/20/36 | 0.25       | 720   | 524                           | 86,124  | 2036/10/20 |
| RAGB 0.5%   | 02/20/29 | 0.5        | 1,800 | 1,694                         | 278,078 | 2029/2/20  |
| RAGB 0.5%   | 04/20/27 | 0.5        | 1,690 | 1,646                         | 270,317 | 2027/4/20  |
| RAGB 0.7%   | 04/20/71 | 0.7        | 540   | 202                           | 33,242  | 2071/4/20  |
| RAGB 0.75%  | 02/20/28 | 0.75       | 1,010 | 976                           | 160,316 | 2028/2/20  |
| RAGB 0.75%  | 03/20/51 | 0.75       | 930   | 509                           | 83,584  | 2051/3/20  |
| RAGB 0.75%  | 10/20/26 | 0.75       | 1,480 | 1,458                         | 239,333 | 2026/10/20 |
| RAGB 0.85%  | 06/30/20 | 0.85       | 230   | 77                            | 12,670  | 2120/6/30  |
| RAGB 0.9%   | 02/20/32 | 0.9        | 1,740 | 1,557                         | 255,725 | 2032/2/20  |
| RAGB 1.5%   | 02/20/47 | 1.5        | 1,080 | 763                           | 125,319 | 2047/2/20  |
| RAGB 1.5%   | 11/02/86 | 1.5        | 440   | 220                           | 36,276  | 2086/11/2  |
| RAGB 1.85%  | 05/23/49 | 1.85       | 660   | 490                           | 80,569  | 2049/5/23  |
| RAGB 2.1%   | 09/20/17 | 2.1        | 650   | 408                           | 67,109  | 2117/9/20  |
| RAGB 2.4%   | 05/23/34 | 2.4        | 710   | 685                           | 112,485 | 2034/5/23  |
| RAGB 2.9%   | 02/20/33 | 2.9        | 1,650 | 1,670                         | 274,225 | 2033/2/20  |
| RAGB 2.9%   | 02/20/34 | 2.9        | 1,240 | 1,246                         | 204,656 | 2034/2/20  |
| RAGB 2.9%   | 05/23/29 | 2.9        | 350   | 359                           | 58,982  | 2029/5/23  |
| RAGB 2.95%  | 02/20/35 | 2.95       | 860   | 860                           | 141,320 | 2035/2/20  |
| RAGB 3.15%  | 06/20/44 | 3.15       | 960   | 930                           | 152,734 | 2044/6/20  |
| RAGB 3.15%  | 10/20/53 | 3.15       | 640   | 598                           | 98,195  | 2053/10/20 |
| RAGB 3.2%   | 07/15/39 | 3.2        | 330   | 327                           | 53,816  | 2039/7/15  |
| RAGB 3.45%  | 10/20/30 | 3.45       | 330   | 347                           | 56,972  | 2030/10/20 |
| RAGB 3.8%   | 01/26/62 | 3.8        | 420   | 443                           | 72,855  | 2062/1/26  |
| RAGB 4.15%  | 03/15/37 | 4.15       | 1,550 | 1,705                         | 279,977 | 2037/3/15  |
| RAGB 6.25%  | 07/15/27 | 6.25       | 1,180 | 1,285                         | 211,047 | 2027/7/15  |
| (フィンランド)    |          |            |       |                               |         |            |
| 国債証券        |          |            |       |                               |         |            |
| RFGB 0%     | 09/15/26 | —          | 460   | 449                           | 73,774  | 2026/9/15  |
| RFGB 0%     | 09/15/30 | —          | 560   | 493                           | 80,950  | 2030/9/15  |
| RFGB 0.125% | 04/15/36 | 0.125      | 440   | 320                           | 52,660  | 2036/4/15  |
| RFGB 0.125% | 04/15/52 | 0.125      | 460   | 197                           | 32,408  | 2052/4/15  |
| RFGB 0.125% | 09/15/31 | 0.125      | 710   | 610                           | 100,263 | 2031/9/15  |
| RFGB 0.25%  | 09/15/40 | 0.25       | 350   | 221                           | 36,430  | 2040/9/15  |
| RFGB 0.5%   | 04/15/43 | 0.5        | 490   | 302                           | 49,658  | 2043/4/15  |
| RFGB 0.5%   | 09/15/27 | 0.5        | 540   | 522                           | 85,831  | 2027/9/15  |
| RFGB 0.5%   | 09/15/28 | 0.5        | 780   | 740                           | 121,575 | 2028/9/15  |
| RFGB 0.5%   | 09/15/29 | 0.5        | 610   | 566                           | 92,993  | 2029/9/15  |
| RFGB 0.75%  | 04/15/31 | 0.75       | 510   | 462                           | 75,847  | 2031/4/15  |
| RFGB 1.125% | 04/15/34 | 1.125      | 640   | 553                           | 90,822  | 2034/4/15  |
| RFGB 1.375% | 04/15/27 | 1.375      | 350   | 346                           | 56,930  | 2027/4/15  |
| RFGB 1.375% | 04/15/47 | 1.375      | 570   | 390                           | 64,037  | 2047/4/15  |
| RFGB 1.5%   | 09/15/32 | 1.5        | 380   | 350                           | 57,479  | 2032/9/15  |
| RFGB 2.5%   | 04/15/30 | 2.5        | 460   | 462                           | 76,000  | 2030/4/15  |
| RFGB 2.625% | 07/04/42 | 2.625      | 470   | 426                           | 69,956  | 2042/7/4   |
| RFGB 2.75%  | 04/15/38 | 2.75       | 470   | 447                           | 73,473  | 2038/4/15  |
| RFGB 2.75%  | 07/04/28 | 2.75       | 680   | 694                           | 113,930 | 2028/7/4   |
| RFGB 2.875% | 04/15/29 | 2.875      | 520   | 532                           | 87,439  | 2029/4/15  |

| 当                    |            | 期     |              | 末                   |            |
|----------------------|------------|-------|--------------|---------------------|------------|
| 銘柄                   | 利 率<br>(%) | 額面金額  | 評 価<br>外貨建金額 | 額<br>邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日      |
| RFGB 2.95% 04/15/55  | 2.95       | 500   | 448          | 73,576              | 2055/4/15  |
| RFGB 3% 09/15/33     | 3.0        | 790   | 801          | 131,598             | 2033/9/15  |
| RFGB 3% 09/15/34     | 3.0        | 710   | 715          | 117,519             | 2034/9/15  |
| RFGB 3.2% 04/15/45   | 3.2        | 270   | 261          | 42,918              | 2045/4/15  |
| (アイルランド)             |            |       |              |                     |            |
| 国債証券                 |            |       |              |                     |            |
| IRISH 0% 10/18/31    | —          | 950   | 812          | 133,355             | 2031/10/18 |
| IRISH 0.2% 05/15/27  | 0.2        | 670   | 649          | 106,605             | 2027/5/15  |
| IRISH 0.2% 10/18/30  | 0.2        | 910   | 811          | 133,152             | 2030/10/18 |
| IRISH 0.35% 10/18/32 | 0.35       | 600   | 510          | 83,725              | 2032/10/18 |
| IRISH 0.4% 05/15/35  | 0.4        | 690   | 542          | 89,019              | 2035/5/15  |
| IRISH 0.55% 04/22/41 | 0.55       | 410   | 274          | 45,057              | 2041/4/22  |
| IRISH 0.9% 05/15/28  | 0.9        | 770   | 747          | 122,683             | 2028/5/15  |
| IRISH 1% 05/15/26    | 1.0        | 1,000 | 991          | 162,821             | 2026/5/15  |
| IRISH 1.1% 05/15/29  | 1.1        | 980   | 941          | 154,605             | 2029/5/15  |
| IRISH 1.3% 05/15/33  | 1.3        | 610   | 552          | 90,627              | 2033/5/15  |
| IRISH 1.35% 03/18/31 | 1.35       | 370   | 349          | 57,396              | 2031/3/18  |
| IRISH 1.5% 05/15/50  | 1.5        | 800   | 556          | 91,308              | 2050/5/15  |
| IRISH 1.7% 05/15/37  | 1.7        | 740   | 642          | 105,442             | 2037/5/15  |
| IRISH 2% 02/18/45    | 2.0        | 1,010 | 823          | 135,122             | 2045/2/18  |
| IRISH 2.4% 05/15/30  | 2.4        | 930   | 935          | 153,620             | 2030/5/15  |
| IRISH 2.6% 10/18/34  | 2.6        | 200   | 196          | 32,196              | 2034/10/18 |
| IRISH 3% 10/18/43    | 3.0        | 370   | 357          | 58,606              | 2043/10/18 |
| IRISH 3.15% 10/18/55 | 3.15       | 280   | 264          | 43,443              | 2055/10/18 |
| (ポルトガル)              |            |       |              |                     |            |
| 国債証券                 |            |       |              |                     |            |
| PGB 0.3% 10/17/31    | 0.3        | 840   | 732          | 120,248             | 2031/10/17 |
| PGB 0.475% 10/18/30  | 0.475      | 1,000 | 907          | 148,973             | 2030/10/18 |
| PGB 0.7% 10/15/27    | 0.7        | 700   | 681          | 111,879             | 2027/10/15 |
| PGB 0.9% 10/12/35    | 0.9        | 640   | 519          | 85,304              | 2035/10/12 |
| PGB 1% 04/12/52      | 1.0        | 640   | 346          | 56,887              | 2052/4/12  |
| PGB 1.15% 04/11/42   | 1.15       | 470   | 329          | 54,010              | 2042/4/11  |
| PGB 1.65% 07/16/32   | 1.65       | 780   | 731          | 120,047             | 2032/7/16  |
| PGB 1.95% 06/15/29   | 1.95       | 1,250 | 1,241        | 203,813             | 2029/6/15  |
| PGB 2.125% 10/17/28  | 2.125      | 1,450 | 1,455        | 238,859             | 2028/10/17 |
| PGB 2.25% 04/18/34   | 2.25       | 790   | 752          | 123,469             | 2034/4/18  |
| PGB 2.875% 07/21/26  | 2.875      | 950   | 961          | 157,801             | 2026/7/21  |
| PGB 2.875% 10/20/34  | 2.875      | 810   | 805          | 132,238             | 2034/10/20 |
| PGB 3% 06/15/35      | 3.0        | 470   | 468          | 76,914              | 2035/6/15  |
| PGB 3.5% 06/18/38    | 3.5        | 440   | 448          | 73,625              | 2038/6/18  |
| PGB 3.625% 06/12/54  | 3.625      | 290   | 279          | 45,916              | 2054/6/12  |
| PGB 3.875% 02/15/30  | 3.875      | 700   | 750          | 123,251             | 2030/2/15  |
| PGB 4.1% 02/15/45    | 4.1        | 710   | 754          | 123,865             | 2045/2/15  |
| PGB 4.1% 04/15/37    | 4.1        | 980   | 1,066        | 175,058             | 2037/4/15  |
| PGB 4.125% 04/14/27  | 4.125      | 800   | 833          | 136,816             | 2027/4/14  |
| ユ ー ロ 計              |            |       |              | 114,344,603         |            |
| (イギリス)               |            |       |              |                     |            |
| 国債証券                 |            |       |              |                     |            |
| UKT 0.125% 01/31/28  | 0.125      | 1,510 | 1,370        | 268,832             | 2028/1/31  |
| UKT 0.25% 07/31/31   | 0.25       | 2,490 | 1,963        | 385,212             | 2031/7/31  |
| UKT 0.375% 10/22/26  | 0.375      | 2,930 | 2,797        | 548,830             | 2026/10/22 |
| UKT 0.375% 10/22/30  | 0.375      | 780   | 640          | 125,695             | 2030/10/22 |
| UKT 0.5% 01/31/29    | 0.5        | 2,990 | 2,638        | 517,611             | 2029/1/31  |
| UKT 0.5% 10/22/61    | 0.5        | 2,420 | 622          | 122,208             | 2061/10/22 |
| UKT 0.625% 07/31/35  | 0.625      | 2,250 | 1,513        | 296,992             | 2035/7/31  |
| UKT 0.625% 10/22/50  | 0.625      | 1,850 | 659          | 129,355             | 2050/10/22 |
| UKT 0.875% 01/31/46  | 0.875      | 1,530 | 683          | 134,146             | 2046/1/31  |
| UKT 0.875% 07/31/33  | 0.875      | 2,790 | 2,100        | 412,093             | 2033/7/31  |
| UKT 0.875% 10/22/29  | 0.875      | 1,460 | 1,277        | 250,667             | 2029/10/22 |
| UKT 1% 01/31/32      | 1.0        | 3,700 | 2,995        | 587,712             | 2032/1/31  |
| UKT 1.125% 01/31/39  | 1.125      | 2,030 | 1,258        | 246,845             | 2039/1/31  |
| UKT 1.125% 10/22/73  | 1.125      | 1,050 | 334          | 65,631              | 2073/10/22 |
| UKT 1.25% 07/22/27   | 1.25       | 1,250 | 1,182        | 232,049             | 2027/7/22  |

| 当                   |            | 期               |                 | 末                   |            |
|---------------------|------------|-----------------|-----------------|---------------------|------------|
| 銘柄                  | 利 率<br>(%) | 額面金額            | 評 価<br>外貨建金額    | 額<br>邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日      |
| UKT 1.25% 07/31/51  | 1.25       | 2,690           | 1,136           | 222,974             | 2051/7/31  |
| UKT 1.25% 10/22/41  | 1.25       | 2,190           | 1,250           | 245,247             | 2041/10/22 |
| UKT 1.5% 07/22/26   | 1.5        | 1,400           | 1,362           | 267,404             | 2026/7/22  |
| UKT 1.5% 07/22/47   | 1.5        | 1,740           | 876             | 171,880             | 2047/7/22  |
| UKT 1.5% 07/31/53   | 1.5        | 1,680           | 736             | 144,500             | 2053/7/31  |
| UKT 1.625% 10/22/28 | 1.625      | 1,460           | 1,355           | 265,976             | 2028/10/22 |
| UKT 1.625% 10/22/54 | 1.625      | 1,640           | 735             | 144,369             | 2054/10/22 |
| UKT 1.625% 10/22/71 | 1.625      | 1,930           | 755             | 148,202             | 2071/10/22 |
| UKT 1.75% 01/22/49  | 1.75       | 1,230           | 638             | 125,183             | 2049/1/22  |
| UKT 1.75% 07/22/57  | 1.75       | 1,900           | 856             | 168,077             | 2057/7/22  |
| UKT 1.75% 09/07/37  | 1.75       | 2,400           | 1,710           | 335,484             | 2037/9/7   |
| UKT 2.5% 07/22/65   | 2.5        | 1,420           | 762             | 149,547             | 2065/7/22  |
| UKT 3.25% 01/22/44  | 3.25       | 2,430           | 1,835           | 360,035             | 2044/1/22  |
| UKT 3.25% 01/31/33  | 3.25       | 3,760           | 3,460           | 678,850             | 2033/1/31  |
| UKT 3.5% 01/22/45   | 3.5        | 2,000           | 1,551           | 304,369             | 2045/1/22  |
| UKT 3.5% 07/22/68   | 3.5        | 1,600           | 1,111           | 218,069             | 2068/7/22  |
| UKT 3.75% 01/29/38  | 3.75       | 2,780           | 2,466           | 483,959             | 2038/1/29  |
| UKT 3.75% 03/07/27  | 3.75       | 2,540           | 2,526           | 495,791             | 2027/3/7   |
| UKT 3.75% 07/22/52  | 3.75       | 1,400           | 1,065           | 209,060             | 2052/7/22  |
| UKT 3.75% 10/22/53  | 3.75       | 3,260           | 2,455           | 481,714             | 2053/10/22 |
| UKT 4% 01/22/60     | 4.0        | 1,250           | 972             | 190,868             | 2060/1/22  |
| UKT 4% 10/22/31     | 4.0        | 2,140           | 2,097           | 411,566             | 2031/10/22 |
| UKT 4% 10/22/63     | 4.0        | 1,610           | 1,242           | 243,816             | 2063/10/22 |
| UKT 4.125% 01/29/27 | 4.125      | 3,630           | 3,633           | 712,793             | 2027/1/29  |
| UKT 4.125% 07/22/29 | 4.125      | 3,410           | 3,409           | 668,961             | 2029/7/22  |
| UKT 4.25% 03/07/36  | 4.25       | 2,160           | 2,061           | 404,446             | 2036/3/7   |
| UKT 4.25% 06/07/32  | 4.25       | 1,470           | 1,462           | 286,894             | 2032/6/7   |
| UKT 4.25% 07/31/34  | 4.25       | 3,390           | 3,288           | 645,201             | 2034/7/31  |
| UKT 4.25% 09/07/39  | 4.25       | 1,270           | 1,163           | 228,356             | 2039/9/7   |
| UKT 4.25% 12/07/27  | 4.25       | 2,860           | 2,884           | 565,869             | 2027/12/7  |
| UKT 4.25% 12/07/40  | 4.25       | 1,500           | 1,356           | 266,033             | 2040/12/7  |
| UKT 4.25% 12/07/46  | 4.25       | 1,830           | 1,563           | 306,753             | 2046/12/7  |
| UKT 4.25% 12/07/49  | 4.25       | 1,370           | 1,152           | 226,044             | 2049/12/7  |
| UKT 4.25% 12/07/55  | 4.25       | 1,700           | 1,396           | 274,017             | 2055/12/7  |
| UKT 4.375% 01/31/40 | 4.375      | 2,260           | 2,087           | 409,514             | 2040/1/31  |
| UKT 4.375% 03/07/28 | 4.375      | 1,950           | 1,964           | 385,478             | 2028/3/7   |
| UKT 4.375% 03/07/30 | 4.375      | 1,300           | 1,309           | 256,978             | 2030/3/7   |
| UKT 4.375% 07/31/54 | 4.375      | 2,870           | 2,413           | 473,425             | 2054/7/31  |
| UKT 4.5% 03/07/35   | 4.5        | 2,210           | 2,172           | 426,135             | 2035/3/7   |
| UKT 4.5% 06/07/28   | 4.5        | 2,570           | 2,602           | 510,594             | 2028/6/7   |
| UKT 4.5% 09/07/34   | 4.5        | 1,390           | 1,377           | 270,154             | 2034/9/7   |
| UKT 4.5% 12/07/42   | 4.5        | 1,940           | 1,772           | 347,762             | 2042/12/7  |
| UKT 4.625% 01/31/34 | 4.625      | 3,290           | 3,293           | 646,220             | 2034/1/31  |
| UKT 4.75% 10/22/43  | 4.75       | 2,700           | 2,519           | 494,275             | 2043/10/22 |
| UKT 4.75% 12/07/30  | 4.75       | 3,260           | 3,356           | 658,440             | 2030/12/7  |
| UKT 4.75% 12/07/38  | 4.75       | 1,800           | 1,756           | 344,525             | 2038/12/7  |
| UKT 6.0% 12/07/28   | 6.0        | 2,010           | 2,148           | 421,530             | 2028/12/7  |
| 小 計                 |            |                 |                 | 21,021,235          |            |
| (スウェーデン)            |            | キスウェーデン<br>クローナ | キスウェーデン<br>クローナ |                     |            |
| 国債証券                |            |                 |                 |                     |            |
| SGB 0.125% 05/12/31 | 0.125      | 5,280           | 4,704           | 70,844              | 2031/5/12  |
| SGB 0.75% 05/12/28  | 0.75       | 7,340           | 7,104           | 106,986             | 2028/5/12  |
| SGB 0.75% 11/12/29  | 0.75       | 8,250           | 7,812           | 117,660             | 2029/11/12 |
| SGB 1% 11/12/26     | 1.0        | 8,340           | 8,235           | 124,030             | 2026/11/12 |
| SGB 1.75% 11/11/33  | 1.75       | 5,050           | 4,847           | 73,007              | 2033/11/11 |
| SGB 2.25% 05/11/35  | 2.25       | 4,300           | 4,258           | 64,127              | 2035/5/11  |
| SGB 2.25% 06/01/32  | 2.25       | 5,300           | 5,323           | 80,173              | 2032/6/1   |
| SGB 3.5% 03/30/39   | 3.5        | 4,270           | 4,753           | 71,588              | 2039/3/30  |
| 小 計                 |            |                 |                 | 708,418             |            |
| (ノルウェー)             |            | 千ノルウェー<br>クローネ  | 千ノルウェー<br>クローネ  |                     |            |
| 国債証券                |            |                 |                 |                     |            |
| NGB 1.25% 09/17/31  | 1.25       | 4,780           | 4,081           | 58,366              | 2031/9/17  |

| 当         |                 | 期       |                | 末                          |           |            |
|-----------|-----------------|---------|----------------|----------------------------|-----------|------------|
| 銘         | 柄               | 利 率 (%) | 額面金額           | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額 (千円) | 償還年月日     |            |
| NGB       | 1.375% 08/19/30 | 1.375   | 4,830          | 4,270                      | 61,067    | 2030/8/19  |
| NGB       | 1.75% 02/17/27  | 1.75    | 5,340          | 5,169                      | 73,929    | 2027/2/17  |
| NGB       | 1.75% 09/06/29  | 1.75    | 4,100          | 3,771                      | 53,932    | 2029/9/6   |
| NGB       | 2% 04/26/28     | 2.0     | 4,330          | 4,131                      | 59,080    | 2028/4/26  |
| NGB       | 2.125% 05/18/32 | 2.125   | 4,480          | 3,993                      | 57,111    | 2032/5/18  |
| NGB       | 3% 08/15/33     | 3.0     | 5,180          | 4,830                      | 69,072    | 2033/8/15  |
| NGB       | 3.5% 10/06/42   | 3.5     | 1,860          | 1,750                      | 25,037    | 2042/10/6  |
| NGB       | 3.625% 04/13/34 | 3.625   | 5,910          | 5,742                      | 82,121    | 2034/4/13  |
| NGB       | 3.625% 05/31/39 | 3.625   | 1,390          | 1,327                      | 18,986    | 2039/5/31  |
| NGB       | 3.75% 06/12/35  | 3.75    | 2,990          | 2,919                      | 41,742    | 2035/6/12  |
| 小         | 計               |         |                |                            | 600,446   |            |
| (デンマーク)   |                 |         | 千デンマーク<br>クローネ | 千デンマーク<br>クローネ             |           |            |
| 国債証券      |                 |         |                |                            |           |            |
| DGB       | 0% 11/15/31     | —       | 4,160          | 3,625                      | 79,757    | 2031/11/15 |
| DGB       | 0.25% 11/15/52  | 0.25    | 6,290          | 3,283                      | 72,246    | 2052/11/15 |
| DGB       | 0.5% 11/15/27   | 0.5     | 5,760          | 5,599                      | 123,186   | 2027/11/15 |
| DGB       | 0.5% 11/15/29   | 0.5     | 4,560          | 4,282                      | 94,209    | 2029/11/15 |
| DGB       | 2.25% 11/15/26  | 2.25    | 2,280          | 2,303                      | 50,679    | 2026/11/15 |
| DGB       | 2.25% 11/15/33  | 2.25    | 6,800          | 6,760                      | 148,736   | 2033/11/15 |
| DGB       | 4.5% 11/15/39   | 4.5     | 9,430          | 11,433                     | 251,546   | 2039/11/15 |
| 小         | 計               |         |                |                            | 820,362   |            |
| (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      |                 |         |                |                            |           |            |
| POLGB     | 0.25% 10/25/26  | 0.25    | 4,500          | 4,219                      | 163,537   | 2026/10/25 |
| POLGB     | 1.25% 10/25/30  | 1.25    | 6,680          | 5,519                      | 213,932   | 2030/10/25 |
| POLGB     | 1.75% 04/25/32  | 1.75    | 4,610          | 3,695                      | 143,238   | 2032/4/25  |
| POLGB     | 2.5% 07/25/26   | 2.5     | 4,650          | 4,521                      | 175,237   | 2026/7/25  |
| POLGB     | 2.5% 07/25/27   | 2.5     | 4,530          | 4,308                      | 166,991   | 2027/7/25  |
| POLGB     | 2.75% 04/25/28  | 2.75    | 3,100          | 2,925                      | 113,393   | 2028/4/25  |
| POLGB     | 2.75% 10/25/29  | 2.75    | 6,000          | 5,462                      | 211,733   | 2029/10/25 |
| POLGB     | 3.75% 05/25/27  | 3.75    | 2,510          | 2,464                      | 95,518    | 2027/5/25  |
| POLGB     | 4.75% 07/25/29  | 4.75    | 3,470          | 3,444                      | 133,518   | 2029/7/25  |
| POLGB     | 5% 01/25/30     | 5.0     | 2,210          | 2,206                      | 85,515    | 2030/1/25  |
| POLGB     | 5% 10/25/34     | 5.0     | 4,720          | 4,552                      | 176,465   | 2034/10/25 |
| POLGB     | 5.75% 04/25/29  | 5.75    | 7,310          | 7,507                      | 290,976   | 2029/4/25  |
| POLGB     | 6% 10/25/33     | 6.0     | 4,350          | 4,521                      | 175,251   | 2033/10/25 |
| POLGB     | 7.5% 07/25/28   | 7.5     | 4,470          | 4,804                      | 186,230   | 2028/7/25  |
| 小         | 計               |         |                |                            | 2,331,541 |            |
| (オーストラリア) |                 |         | 千オーストラリア<br>ドル | 千オーストラリア<br>ドル             |           |            |
| 国債証券      |                 |         |                |                            |           |            |
| ACGB      | 0.5% 09/21/26   | 0.5     | 2,390          | 2,301                      | 215,934   | 2026/9/21  |
| ACGB      | 1% 11/21/31     | 1.0     | 2,550          | 2,130                      | 199,905   | 2031/11/21 |
| ACGB      | 1% 12/21/30     | 1.0     | 1,890          | 1,632                      | 153,175   | 2030/12/21 |
| ACGB      | 1.25% 05/21/32  | 1.25    | 2,590          | 2,163                      | 202,972   | 2032/5/21  |
| ACGB      | 1.5% 06/21/31   | 1.5     | 3,070          | 2,689                      | 252,325   | 2031/6/21  |
| ACGB      | 1.75% 06/21/51  | 1.75    | 1,860          | 981                        | 92,074    | 2051/6/21  |
| ACGB      | 1.75% 11/21/32  | 1.75    | 2,760          | 2,354                      | 220,829   | 2032/11/21 |
| ACGB      | 2.25% 05/21/28  | 2.25    | 2,040          | 1,973                      | 185,124   | 2028/5/21  |
| ACGB      | 2.5% 05/21/30   | 2.5     | 2,340          | 2,220                      | 208,276   | 2030/5/21  |
| ACGB      | 2.75% 05/21/41  | 2.75    | 1,410          | 1,106                      | 103,764   | 2041/5/21  |
| ACGB      | 2.75% 06/21/35  | 2.75    | 1,950          | 1,701                      | 159,576   | 2035/6/21  |
| ACGB      | 2.75% 11/21/27  | 2.75    | 1,530          | 1,507                      | 141,399   | 2027/11/21 |
| ACGB      | 2.75% 11/21/28  | 2.75    | 1,740          | 1,700                      | 159,509   | 2028/11/21 |
| ACGB      | 2.75% 11/21/29  | 2.75    | 2,160          | 2,088                      | 195,884   | 2029/11/21 |
| ACGB      | 3% 03/21/47     | 3.0     | 1,350          | 1,008                      | 94,611    | 2047/3/21  |
| ACGB      | 3% 11/21/33     | 3.0     | 2,330          | 2,136                      | 200,431   | 2033/11/21 |
| ACGB      | 3.25% 04/21/29  | 3.25    | 2,110          | 2,091                      | 196,173   | 2029/4/21  |
| ACGB      | 3.25% 06/21/39  | 3.25    | 940            | 813                        | 76,268    | 2039/6/21  |
| ACGB      | 3.5% 12/21/34   | 3.5     | 2,070          | 1,945                      | 182,510   | 2034/12/21 |
| ACGB      | 3.75% 04/21/37  | 3.75    | 1,440          | 1,349                      | 126,584   | 2037/4/21  |
| ACGB      | 3.75% 05/21/34  | 3.75    | 2,340          | 2,258                      | 211,863   | 2034/5/21  |
| ACGB      | 4.25% 03/21/36  | 4.25    | 1,710          | 1,693                      | 158,892   | 2036/3/21  |

| 当          |                 | 期          |                 | 末                             |           |            |
|------------|-----------------|------------|-----------------|-------------------------------|-----------|------------|
| 銘          | 柄               | 利 率<br>(%) | 額面金額            | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日     |            |
| ACGB       | 4.25% 06/21/34  | 4.25       | 960             | 962                           | 90,287    | 2034/6/21  |
| ACGB       | 4.25% 12/21/35  | 4.25       | 1,890           | 1,875                         | 175,926   | 2035/12/21 |
| ACGB       | 4.5% 04/21/33   | 4.5        | 2,720           | 2,796                         | 262,340   | 2033/4/21  |
| ACGB       | 4.75% 04/21/27  | 4.75       | 2,840           | 2,911                         | 273,155   | 2027/4/21  |
| ACGB       | 4.75% 06/21/54  | 4.75       | 720             | 692                           | 64,938    | 2054/6/21  |
| 小 計        |                 |            |                 |                               | 4,604,735 |            |
| (ニュージーランド) |                 |            | 千ニュージーランド<br>ドル | 千ニュージーランド<br>ドル               |           |            |
| 国債証券       |                 |            |                 |                               |           |            |
| NZGB       | 0.25% 05/15/28  | 0.25       | 1,340           | 1,215                         | 105,765   | 2028/5/15  |
| NZGB       | 0.5% 05/15/26   | 0.5        | 730             | 711                           | 61,884    | 2026/5/15  |
| NZGB       | 1.5% 05/15/31   | 1.5        | 1,000           | 861                           | 74,952    | 2031/5/15  |
| NZGB       | 1.75% 05/15/41  | 1.75       | 560             | 355                           | 30,958    | 2041/5/15  |
| NZGB       | 2% 05/15/32     | 2.0        | 1,130           | 974                           | 84,783    | 2032/5/15  |
| NZGB       | 2.75% 04/15/37  | 2.75       | 630             | 511                           | 44,507    | 2037/4/15  |
| NZGB       | 2.75% 05/15/51  | 2.75       | 600             | 384                           | 33,464    | 2051/5/15  |
| NZGB       | 3% 04/20/29     | 3.0        | 1,180           | 1,147                         | 99,878    | 2029/4/20  |
| NZGB       | 3.5% 04/14/33   | 3.5        | 1,810           | 1,699                         | 147,922   | 2033/4/14  |
| NZGB       | 4.25% 05/15/34  | 4.25       | 750             | 734                           | 63,957    | 2034/5/15  |
| NZGB       | 4.25% 05/15/36  | 4.25       | 610             | 585                           | 50,937    | 2036/5/15  |
| NZGB       | 4.5% 04/15/27   | 4.5        | 930             | 948                           | 82,550    | 2027/4/15  |
| NZGB       | 4.5% 05/15/30   | 4.5        | 1,210           | 1,239                         | 107,858   | 2030/5/15  |
| NZGB       | 4.5% 05/15/35   | 4.5        | 1,240           | 1,227                         | 106,867   | 2035/5/15  |
| NZGB       | 5% 05/15/54     | 5.0        | 380             | 360                           | 31,344    | 2054/5/15  |
| 小 計        |                 |            |                 |                               | 1,127,632 |            |
| (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       |                 |            |                 |                               |           |            |
| SIGB       | 1.25% 11/01/26  | 1.25       | 870             | 861                           | 97,201    | 2026/11/1  |
| SIGB       | 1.625% 07/01/31 | 1.625      | 450             | 434                           | 49,043    | 2031/7/1   |
| SIGB       | 1.875% 03/01/50 | 1.875      | 690             | 607                           | 68,618    | 2050/3/1   |
| SIGB       | 1.875% 10/01/51 | 1.875      | 480             | 417                           | 47,084    | 2051/10/1  |
| SIGB       | 2.125% 06/01/26 | 2.125      | 1,030           | 1,031                         | 116,405   | 2026/6/1   |
| SIGB       | 2.25% 08/01/36  | 2.25       | 760             | 746                           | 84,244    | 2036/8/1   |
| SIGB       | 2.375% 07/01/39 | 2.375      | 560             | 551                           | 62,278    | 2039/7/1   |
| SIGB       | 2.625% 05/01/28 | 2.625      | 720             | 732                           | 82,736    | 2028/5/1   |
| SIGB       | 2.625% 08/01/32 | 2.625      | 660             | 674                           | 76,102    | 2032/8/1   |
| SIGB       | 2.75% 03/01/35  | 2.75       | 190             | 195                           | 22,049    | 2035/3/1   |
| SIGB       | 2.75% 03/01/46  | 2.75       | 820             | 847                           | 95,681    | 2046/3/1   |
| SIGB       | 2.75% 04/01/42  | 2.75       | 630             | 650                           | 73,390    | 2042/4/1   |
| SIGB       | 2.875% 07/01/29 | 2.875      | 1,040           | 1,072                         | 121,093   | 2029/7/1   |
| SIGB       | 2.875% 08/01/28 | 2.875      | 610             | 626                           | 70,715    | 2028/8/1   |
| SIGB       | 2.875% 09/01/27 | 2.875      | 420             | 428                           | 48,357    | 2027/9/1   |
| SIGB       | 2.875% 09/01/30 | 2.875      | 840             | 871                           | 98,327    | 2030/9/1   |
| SIGB       | 3% 04/01/29     | 3.0        | 150             | 155                           | 17,528    | 2029/4/1   |
| SIGB       | 3% 08/01/72     | 3.0        | 620             | 681                           | 76,949    | 2072/8/1   |
| SIGB       | 3.25% 06/01/54  | 3.25       | 210             | 239                           | 27,065    | 2054/6/1   |
| SIGB       | 3.375% 05/01/34 | 3.375      | 160             | 172                           | 19,483    | 2034/5/1   |
| SIGB       | 3.375% 09/01/33 | 3.375      | 880             | 945                           | 106,764   | 2033/9/1   |
| SIGB       | 3.5% 03/01/27   | 3.5        | 740             | 759                           | 85,742    | 2027/3/1   |
| 小 計        |                 |            |                 |                               | 1,546,865 |            |
| (マレーシア)    |                 |            | 千マレーシア<br>リンギット | 千マレーシア<br>リンギット               |           |            |
| 国債証券       |                 |            |                 |                               |           |            |
| MGS        | 2.632% 04/15/31 | 2.632      | 1,650           | 1,587                         | 54,538    | 2031/4/15  |
| MGS        | 3.502% 05/31/27 | 3.502      | 1,510           | 1,523                         | 52,325    | 2027/5/31  |
| MGS        | 3.519% 04/20/28 | 3.519      | 2,340           | 2,363                         | 81,168    | 2028/4/20  |
| MGS        | 3.582% 07/15/32 | 3.582      | 1,570           | 1,588                         | 54,570    | 2032/7/15  |
| MGS        | 3.733% 06/15/28 | 3.733      | 2,930           | 2,976                         | 102,229   | 2028/6/15  |
| MGS        | 3.757% 05/22/40 | 3.757      | 2,950           | 2,952                         | 101,415   | 2040/5/22  |
| MGS        | 3.828% 07/05/34 | 3.828      | 1,770           | 1,809                         | 62,140    | 2034/7/5   |
| MGS        | 3.844% 04/15/33 | 3.844      | 1,830           | 1,870                         | 64,258    | 2033/4/15  |
| MGS        | 3.885% 08/15/29 | 3.885      | 2,460           | 2,524                         | 86,698    | 2029/8/15  |
| MGS        | 3.892% 03/15/27 | 3.892      | 1,130           | 1,146                         | 39,390    | 2027/3/15  |
| MGS        | 3.899% 11/16/27 | 3.899      | 1,970           | 2,007                         | 68,940    | 2027/11/16 |



| 当                 |                 | 期          |           | 末            |                     |            |
|-------------------|-----------------|------------|-----------|--------------|---------------------|------------|
| 銘                 | 柄               | 利 率<br>(%) | 額面金額      | 評 価<br>外貨建金額 | 額<br>邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日      |
| MGS               | 3.9% 11/30/26   | 3.9        | 2,470     | 2,503        | 85,997              | 2026/11/30 |
| MGS               | 3.906% 07/15/26 | 3.906      | 1,210     | 1,223        | 42,005              | 2026/7/15  |
| MGS               | 4.054% 04/18/39 | 4.054      | 1,380     | 1,433        | 49,229              | 2039/4/18  |
| MGS               | 4.065% 06/15/50 | 4.065      | 3,070     | 3,093        | 106,262             | 2050/6/15  |
| MGS               | 4.18% 05/16/44  | 4.18       | 810       | 850          | 29,219              | 2044/5/16  |
| MGS               | 4.232% 06/30/31 | 4.232      | 2,490     | 2,604        | 89,448              | 2031/6/30  |
| MGS               | 4.254% 05/31/35 | 4.254      | 1,750     | 1,850        | 63,545              | 2035/5/31  |
| MGS               | 4.457% 03/31/53 | 4.457      | 2,090     | 2,232        | 76,690              | 2053/3/31  |
| MGS               | 4.498% 04/15/30 | 4.498      | 2,930     | 3,092        | 106,209             | 2030/4/15  |
| MGS               | 4.504% 04/30/29 | 4.504      | 940       | 983          | 33,785              | 2029/4/30  |
| MGS               | 4.642% 11/07/33 | 4.642      | 3,210     | 3,472        | 119,260             | 2033/11/7  |
| MGS               | 4.696% 10/15/42 | 4.696      | 1,970     | 2,186        | 75,095              | 2042/10/15 |
| MGS               | 4.736% 03/15/46 | 4.736      | 980       | 1,086        | 37,301              | 2046/3/15  |
| MGS               | 4.762% 04/07/37 | 4.762      | 2,410     | 2,658        | 91,291              | 2037/4/7   |
| MGS               | 4.893% 06/08/38 | 4.893      | 2,130     | 2,391        | 82,132              | 2038/6/8   |
| MGS               | 4.921% 07/06/48 | 4.921      | 1,680     | 1,915        | 65,773              | 2048/7/6   |
| MGS               | 4.935% 09/30/43 | 4.935      | 1,030     | 1,172        | 40,282              | 2043/9/30  |
| 小 計               |                 |            |           |              | 1,961,208           |            |
| (中国オフショア)<br>国債証券 |                 |            | 千オフショア人民元 | 千オフショア人民元    |                     |            |
| CGB               | 1.06% 12/15/26  | 1.06       | 37,470    | 37,225       | 754,794             | 2026/12/15 |
| CGB               | 1.35% 09/25/26  | 1.35       | 40,940    | 40,870       | 828,713             | 2026/9/25  |
| CGB               | 1.43% 01/25/30  | 1.43       | 10,000    | 9,950        | 201,764             | 2030/1/25  |
| CGB               | 1.45% 02/25/28  | 1.45       | 27,600    | 27,558       | 558,785             | 2028/2/25  |
| CGB               | 1.49% 12/25/31  | 1.49       | 30,690    | 30,375       | 615,906             | 2031/12/25 |
| CGB               | 1.61% 02/15/35  | 1.61       | 14,500    | 14,368       | 291,347             | 2035/2/15  |
| CGB               | 1.62% 08/15/27  | 1.62       | 29,950    | 30,039       | 609,090             | 2027/8/15  |
| CGB               | 1.67% 06/15/26  | 1.67       | 34,680    | 34,746       | 704,535             | 2026/6/15  |
| CGB               | 1.74% 10/15/29  | 1.74       | 36,760    | 37,073       | 751,717             | 2029/10/15 |
| CGB               | 1.85% 05/15/27  | 1.85       | 42,700    | 42,997       | 871,845             | 2027/5/15  |
| CGB               | 1.87% 09/15/31  | 1.87       | 27,620    | 27,998       | 567,708             | 2031/9/15  |
| CGB               | 1.91% 07/15/29  | 1.91       | 23,000    | 23,309       | 472,628             | 2029/7/15  |
| CGB               | 1.92% 01/15/55  | 1.92       | 5,850     | 5,793        | 117,467             | 2055/1/15  |
| CGB               | 2.04% 02/25/27  | 2.04       | 38,210    | 38,581       | 782,293             | 2027/2/25  |
| CGB               | 2.04% 11/25/34  | 2.04       | 46,000    | 47,229       | 957,643             | 2034/11/25 |
| CGB               | 2.05% 04/15/29  | 2.05       | 36,880    | 37,557       | 761,525             | 2029/4/15  |
| CGB               | 2.11% 08/25/34  | 2.11       | 27,200    | 28,072       | 569,203             | 2034/8/25  |
| CGB               | 2.12% 06/25/31  | 2.12       | 32,000    | 32,882       | 666,732             | 2031/6/25  |
| CGB               | 2.18% 08/15/26  | 2.18       | 35,600    | 35,901       | 727,954             | 2026/8/15  |
| CGB               | 2.27% 05/25/34  | 2.27       | 38,000    | 39,709       | 805,179             | 2034/5/25  |
| CGB               | 2.28% 03/25/31  | 2.28       | 50,700    | 52,508       | 1,064,691           | 2031/3/25  |
| CGB               | 2.3% 05/15/26   | 2.3        | 47,100    | 47,496       | 963,054             | 2026/5/15  |
| CGB               | 2.35% 02/25/34  | 2.35       | 36,110    | 37,925       | 769,000             | 2034/2/25  |
| CGB               | 2.37% 01/15/29  | 2.37       | 39,430    | 40,567       | 822,573             | 2029/1/15  |
| CGB               | 2.37% 10/20/27  | 2.37       | 43,880    | 44,518       | 902,685             | 2027/10/20 |
| CGB               | 2.39% 11/15/26  | 2.39       | 46,200    | 46,827       | 949,502             | 2026/11/15 |
| CGB               | 2.4% 07/15/28   | 2.4        | 38,310    | 39,347       | 797,834             | 2028/7/15  |
| CGB               | 2.44% 10/15/27  | 2.44       | 39,500    | 40,317       | 817,494             | 2027/10/15 |
| CGB               | 2.48% 04/15/27  | 2.48       | 20,000    | 20,379       | 413,229             | 2027/4/15  |
| CGB               | 2.48% 09/25/28  | 2.48       | 26,500    | 27,310       | 553,769             | 2028/9/25  |
| CGB               | 2.5% 07/25/27   | 2.5        | 26,760    | 27,276       | 553,062             | 2027/7/25  |
| CGB               | 2.52% 08/25/33  | 2.52       | 31,870    | 33,825       | 685,853             | 2033/8/25  |
| CGB               | 2.54% 12/25/30  | 2.54       | 30,500    | 31,994       | 648,745             | 2030/12/25 |
| CGB               | 2.55% 10/15/28  | 2.55       | 42,250    | 43,652       | 885,115             | 2028/10/15 |
| CGB               | 2.6% 09/01/32   | 2.6        | 27,890    | 29,683       | 601,876             | 2032/9/1   |
| CGB               | 2.6% 09/15/30   | 2.6        | 30,500    | 32,049       | 649,844             | 2030/9/15  |
| CGB               | 2.62% 04/15/28  | 2.62       | 34,000    | 35,076       | 711,219             | 2028/4/15  |
| CGB               | 2.62% 06/25/30  | 2.62       | 29,780    | 31,256       | 633,766             | 2030/6/25  |
| CGB               | 2.62% 09/25/29  | 2.62       | 20,940    | 21,854       | 443,140             | 2029/9/25  |
| CGB               | 2.64% 01/15/28  | 2.64       | 38,220    | 39,358       | 798,060             | 2028/1/15  |
| CGB               | 2.67% 05/25/33  | 2.67       | 34,280    | 36,721       | 744,580             | 2033/5/25  |
| CGB               | 2.67% 11/25/33  | 2.67       | 23,400    | 25,133       | 509,610             | 2033/11/25 |
| CGB               | 2.68% 05/21/30  | 2.68       | 30,700    | 32,297       | 654,876             | 2030/5/21  |
| CGB               | 2.69% 08/12/26  | 2.69       | 39,900    | 40,527       | 821,762             | 2026/8/12  |
| CGB               | 2.69% 08/15/32  | 2.69       | 19,420    | 20,769       | 421,142             | 2032/8/15  |

| 当               |                | 期          |                | 末              |                     |            |
|-----------------|----------------|------------|----------------|----------------|---------------------|------------|
| 銘               | 柄              | 利 率<br>(%) | 額面金額           | 評 価<br>外貨建金額   | 額<br>邦貨換算金額<br>(千円) | 償還年月日      |
| CGB             | 2.75% 02/17/32 | 2.75       | 39,430         | 42,136         | 854,389             | 2032/2/17  |
| CGB             | 2.75% 06/15/29 | 2.75       | 28,340         | 29,654         | 601,283             | 2029/6/15  |
| CGB             | 2.76% 05/15/32 | 2.76       | 13,150         | 14,119         | 286,290             | 2032/5/15  |
| CGB             | 2.79% 12/15/29 | 2.79       | 30,300         | 31,926         | 647,348             | 2029/12/15 |
| CGB             | 2.8% 03/24/29  | 2.8        | 23,080         | 24,147         | 489,626             | 2029/3/24  |
| CGB             | 2.8% 03/25/30  | 2.8        | 39,490         | 41,757         | 846,689             | 2030/3/25  |
| CGB             | 2.8% 11/15/32  | 2.8        | 24,600         | 26,544         | 538,233             | 2032/11/15 |
| CGB             | 2.85% 06/04/27 | 2.85       | 31,030         | 31,918         | 647,201             | 2027/6/4   |
| CGB             | 2.88% 02/25/33 | 2.88       | 11,300         | 12,284         | 249,086             | 2033/2/25  |
| CGB             | 2.89% 11/18/31 | 2.89       | 24,210         | 26,051         | 528,223             | 2031/11/18 |
| CGB             | 2.91% 10/14/28 | 2.91       | 24,320         | 25,451         | 516,067             | 2028/10/14 |
| CGB             | 3% 10/15/53    | 3.0        | 18,270         | 22,516         | 456,563             | 2053/10/15 |
| CGB             | 3.01% 05/13/28 | 3.01       | 11,590         | 12,119         | 245,737             | 2028/5/13  |
| CGB             | 3.02% 05/27/31 | 3.02       | 14,560         | 15,751         | 319,395             | 2031/5/27  |
| CGB             | 3.12% 10/25/52 | 3.12       | 12,970         | 16,016         | 324,767             | 2052/10/25 |
| CGB             | 3.19% 04/15/53 | 3.19       | 18,360         | 22,984         | 466,049             | 2053/4/15  |
| CGB             | 3.27% 11/19/30 | 3.27       | 6,850          | 7,499          | 152,060             | 2030/11/19 |
| CGB             | 3.28% 12/03/27 | 3.28       | 27,290         | 28,615         | 580,226             | 2027/12/3  |
| CGB             | 3.29% 05/23/29 | 3.29       | 35,000         | 37,598         | 762,373             | 2029/5/23  |
| CGB             | 3.32% 04/15/52 | 3.32       | 15,490         | 19,714         | 399,744             | 2052/4/15  |
| CGB             | 3.39% 03/16/50 | 3.39       | 25,610         | 32,463         | 658,241             | 2050/3/16  |
| CGB             | 3.53% 10/18/51 | 3.53       | 12,850         | 16,862         | 341,904             | 2051/10/18 |
| CGB             | 3.72% 04/12/51 | 3.72       | 15,140         | 20,452         | 414,702             | 2051/4/12  |
| CGB             | 3.81% 09/14/50 | 3.81       | 26,020         | 35,572         | 721,276             | 2050/9/14  |
| CGB             | 3.86% 07/22/49 | 3.86       | 20,160         | 27,278         | 553,119             | 2049/7/22  |
| CGB             | 4.08% 10/22/48 | 4.08       | 19,370         | 26,900         | 545,448             | 2048/10/22 |
| 小 計             |                |            |                |                | 43,579,384          |            |
| (イスラエル)<br>国債証券 |                |            | 千イスラエル<br>シェケル | 千イスラエル<br>シェケル |                     |            |
| ILGOV           | 1% 03/31/30    | 1.0        | 3,530          | 3,031          | 126,053             | 2030/3/31  |
| ILGOV           | 1.3% 04/30/32  | 1.3        | 2,970          | 2,432          | 101,147             | 2032/4/30  |
| ILGOV           | 1.5% 05/31/37  | 1.5        | 2,880          | 2,075          | 86,285              | 2037/5/31  |
| ILGOV           | 2% 03/31/27    | 2.0        | 3,040          | 2,922          | 121,498             | 2027/3/31  |
| ILGOV           | 2.25% 09/28/28 | 2.25       | 3,790          | 3,558          | 147,948             | 2028/9/28  |
| ILGOV           | 2.8% 11/29/52  | 2.8        | 2,260          | 1,550          | 64,460              | 2052/11/29 |
| ILGOV           | 3.75% 02/28/29 | 3.75       | 2,940          | 2,887          | 120,046             | 2029/2/28  |
| ILGOV           | 3.75% 03/31/47 | 3.75       | 2,570          | 2,205          | 91,700              | 2047/3/31  |
| ILGOV           | 3.75% 09/30/27 | 3.75       | 2,410          | 2,382          | 99,052              | 2027/9/30  |
| ILGOV           | 4% 03/30/35    | 4.0        | 2,960          | 2,851          | 118,561             | 2035/3/30  |
| ILGOV           | 4.6% 08/31/29  | 4.6        | 1,120          | 1,139          | 47,392              | 2029/8/31  |
| ILGOV           | 5.5% 01/31/42  | 5.5        | 2,490          | 2,723          | 113,224             | 2042/1/31  |
| ILGOV           | 6.25% 10/30/26 | 6.25       | 1,340          | 1,377          | 57,283              | 2026/10/30 |
| 小 計             |                |            |                |                | 1,294,656           |            |
| 合 計             |                |            |                |                | 379,236,139         |            |

(注) 邦貨換算金額は、当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。

## <先物取引の銘柄別期末残高>

| 銘 柄 別 |              | 当              | 期              | 末 |
|-------|--------------|----------------|----------------|---|
|       |              | 買 建 額<br>(百万円) | 売 建 額<br>(百万円) |   |
| 外 国   | EURO-SCHATZ  | 246            | —              |   |
|       | US 5YR NOTE  | 582            | —              |   |
|       | EURO-BOBL FU | 332            | —              |   |
|       | EURO-BUND    | 708            | —              |   |
|       | US 10YR NOTE | 386            | —              |   |
|       | US LONG BOND | 425            | —              |   |

(注) 外貨建資産は、当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

| 項 目                     | 当 期 末             |           |
|-------------------------|-------------------|-----------|
|                         | 評 価 額             | 比 率       |
| 公 社 債                   | 千円<br>379,236,139 | %<br>97.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 8,551,824         | 2.2       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 387,787,963       | 100.0     |

(注1) 当期末における外貨建純資産(383,926,534千円)の投資信託財産総額(387,787,963千円)に対する比率は99.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当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。

|                      |                    |                     |
|----------------------|--------------------|---------------------|
| 1米ドル=146.05円         | 1カナダドル=105.41円     | 1メキシコペソ=7.536円      |
| 1ユーロ=164.15円         | 1イギリスポンド=196.19円   | 1スウェーデンクローナ=15.06円  |
| 1ノルウェークローネ=14.30円    | 1デンマーククローネ=22.00円  | 1ポーランドズロチ=38.76円    |
| 1オーストラリアドル=93.81円    | 1ニュージーランドドル=87.03円 | 1シンガポールドル=112.88円   |
| 1マレーシアリンギット=34.3449円 | 1オフショア人民元=20.2765円 | 1イスラエルシェケル=41.5771円 |

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目               | 当 期 末<br>2025年5月29日現在 |
|-------------------|-----------------------|
| (A)資 産            | 391,129,652,299円      |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等   | 5,205,315,604         |
| 公 社 債(評価額)        | 379,236,139,360       |
| 未 収 入 金           | 3,355,824,190         |
| 未 収 利 息           | 2,870,643,539         |
| 前 払 費 用           | 220,662,611           |
| 差 入 委 託 証 拠 金     | 241,066,995           |
| (B)負 債            | 3,901,506,792         |
| 未 払 金             | 3,362,060,777         |
| 未 払 解 約 金         | 539,446,015           |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 387,228,145,507       |
| 元 本               | 107,857,258,331       |
| 次 期 繰 越 損 益 金     | 279,370,887,176       |
| (D)受 益 権 総 口 数    | 107,857,258,331口      |
| 1万口当たり基準価額(C/D)   | 35,902円               |

■損益の状況

| 項 目                   | 当 期<br>自 2024年5月30日<br>至 2025年5月29日 |
|-----------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益          | 9,772,215,189円                      |
| 受 取 利 息               | 9,764,839,693                       |
| そ の 他 収 益 金           | 7,375,496                           |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益    | △16,153,688,366                     |
| 売 買 益                 | 9,898,351,013                       |
| 売 買 損                 | △26,052,039,379                     |
| (C)先 物 取 引 等 取 引 損 益  | 33,372,634                          |
| 取 引 益                 | 226,987,919                         |
| 取 引 損                 | △193,615,285                        |
| (D)そ の 他 費 用          | △111,462,241                        |
| (E)当 期 損 益 金(A+B+C+D) | △6,459,562,784                      |
| (F)前 期 繰 越 損 益 金      | 252,823,816,139                     |
| (G)追 加 信 託 差 損 益 金    | 53,435,833,754                      |
| (H)解 約 差 損 益 金        | △20,429,199,933                     |
| (I)計 (E+F+G+H)        | 279,370,887,176                     |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)      | 279,370,887,176                     |

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。



〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は95,353,277,023円、期中追加設定元本額は20,381,098,856円、期中一部解約元本額は7,877,117,548円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

|                                       |                 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 世界経済インデックスファンド                        | 28,671,837,731円 |
| DC世界経済インデックスファンド                      | 16,509,193,188円 |
| FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)     | 15,442,232,029円 |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン                | 7,862,108,002円  |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)              | 4,768,188,900円  |
| SBI資産設計オープン(資産成長型)                    | 2,318,688,203円  |
| DC外国債券インデックス・オープン                     | 2,206,556,899円  |
| DCマイセクション25                           | 1,800,793,415円  |
| DCマイセクション50                           | 1,723,170,016円  |
| 分散投資コア戦略ファンドS                         | 1,685,946,645円  |
| グローバル経済コア                             | 1,593,826,378円  |
| DCマイセクションS25                          | 1,452,132,479円  |
| DCマイセクション75                           | 1,377,893,309円  |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)               | 1,372,804,032円  |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)       | 1,333,260,039円  |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)           | 1,239,726,459円  |
| DCマイセクションS50                          | 1,232,043,283円  |
| My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)           | 1,224,826,429円  |
| グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)          | 1,086,081,346円  |
| 外国債券オープン(毎月決算型)                       | 1,028,415,068円  |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)              | 921,976,824円    |
| DCマイセクションS75                          | 856,473,274円    |
| DCマイセクションS50(2024-2026リスク抑制型)         | 846,553,493円    |
| 分散投資コア戦略ファンドA                         | 838,576,134円    |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)           | 824,772,634円    |
| 外国債券ファンド・シリーズ1                        | 818,455,399円    |
| 外国債券インデックス・オープン(SMA専用)                | 743,150,659円    |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1                  | 660,231,349円    |
| FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)             | 573,630,484円    |
| SMT 世界経済インデックス・オープン                   | 554,070,905円    |
| グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)                 | 443,060,985円    |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)               | 425,882,326円    |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)             | 312,923,096円    |
| 財産四分法ファンド(毎月決算型)                      | 295,418,218円    |
| FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)           | 293,595,713円    |
| 外国債券インデックスファンドT(一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付) | 285,010,970円    |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)               | 281,659,616円    |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)                | 226,473,524円    |
| SMT インデックスバランス・オープン                   | 155,388,020円    |
| SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)        | 148,464,857円    |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)               | 145,807,793円    |
| 私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)             | 142,911,366円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040        | 134,543,893円    |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)               | 108,209,292円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060        | 104,173,397円    |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)                | 103,365,625円    |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035                  | 102,641,629円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030        | 76,926,140円     |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050        | 72,716,870円     |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045                  | 58,957,663円     |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)                  | 46,646,678円     |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用)                  | 45,410,099円     |

|                                       |             |
|---------------------------------------|-------------|
| グローバル10資産バランスファンド                     | 45,053,302円 |
| バランス25VA2(適格機関投資家専用)                  | 38,761,628円 |
| 10資産分散投資ファンド                          | 36,856,471円 |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用)                  | 30,354,951円 |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)              | 27,415,392円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)                  | 21,849,196円 |
| バランス30VA1(適格機関投資家専用)                  | 16,289,970円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン                | 10,694,383円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035       | 10,292,006円 |
| SBI資産設計オープン(分配型)                      | 8,601,465円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040       | 7,862,831円  |
| 外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)         | 6,696,477円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045       | 3,573,828円  |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025                  | 3,508,373円  |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055                  | 3,144,870円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050       | 2,801,652円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055       | 1,630,689円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065       | 1,188,231円  |
| DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060       | 973,430円    |
| マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)              | 937,552円    |
| マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)              | 895,349円    |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2(適格機関投資家専用) | 22,489円     |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1(適格機関投資家専用) | 17,520円     |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3(適格機関投資家専用) | 17,373円     |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6(適格機関投資家専用) | 9,245円      |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5(適格機関投資家専用) | 3,464円      |
| グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4(適格機関投資家専用) | 3,419円      |

## お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。

本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。

今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。