

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2010年4月28日設定）	
運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA外国債券インデックスマザーファンド」に投資します。	
主要投資対象	東京海上セレクション・外国債券インデックス	主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか外国の公社債等に直接投資することがあります。
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	主として外国の公社債に投資します。
投資制限	東京海上セレクション・外国債券インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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	<p>毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。</p> <p>ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配に充当せず、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。</p>	

東京海上セレクション・外国債券インデックス

第12期 運用報告書（全体版）

（決算日 2022年4月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京海上セレクション・外国債券インデックス」は、このたび、第12期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。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		債 組 入 比 率	純 資 産 額	
		税 分 配	込 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
	円		円		%		%	百万円	
8期(2018年4月16日)	13,840		0		7.7	263.212	7.8	98.4	1,668
9期(2019年4月15日)	14,137		0		2.1	269.451	2.4	98.2	2,646
10期(2020年4月15日)	14,500		0		2.6	277.171	2.9	98.1	3,999
11期(2021年4月15日)	15,276		0		5.4	292.944	5.7	99.0	5,462
12期(2022年4月15日)	15,636		0		2.4	300.586	2.6	99.1	7,007

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 騰 落	基準価額		ベンチ 騰 落	マ 騰 落	債 組 入 比 率	券 率
		騰 落	率				
(期首) 2021年4月15日	円		%		%		%
	15,276		—	292.944	—		99.0
4月末	15,334		0.4	294.142	0.4		98.4
5月末	15,536		1.7	297.961	1.7		98.8
6月末	15,509		1.5	297.603	1.6		98.5
7月末	15,612		2.2	299.643	2.3		99.1
8月末	15,603		2.1	299.594	2.3		99.0
9月末	15,498		1.5	297.537	1.6		98.8
10月末	15,821		3.6	303.904	3.7		99.0
11月末	15,644		2.4	300.520	2.6		99.2
12月末	15,744		3.1	302.422	3.2		99.0
2022年1月末	15,467		1.3	297.286	1.5		99.0
2月末	15,186		△0.6	291.915	△0.4		98.7
3月末	15,685		2.7	301.548	2.9		98.9
(期末) 2022年4月15日	円		%		%		%
	15,636		2.4	300.586	2.6		99.1

(注) 騰落率は期首比です。

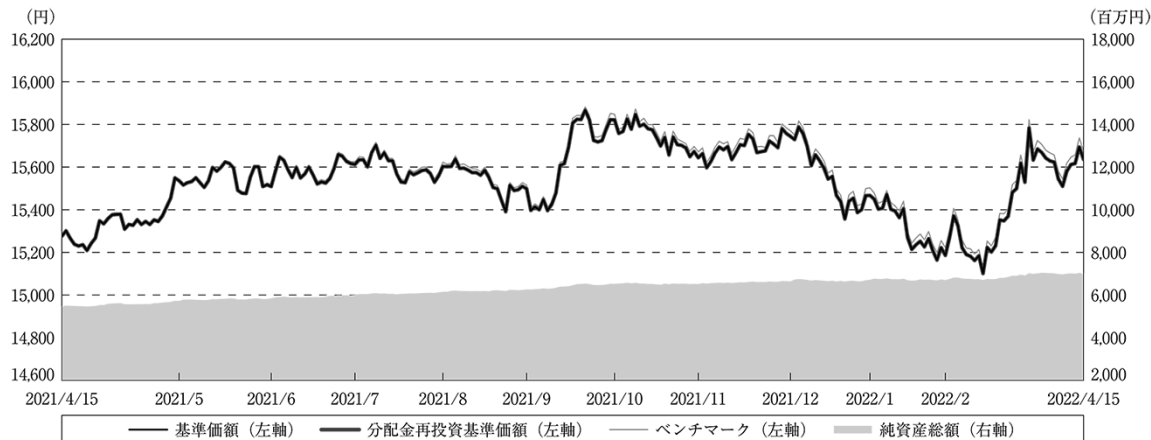
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合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。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

○運用経過

(2021年4月16日～2022年4月15日)

■期中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2021年4月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有債券の利息収入
- ・米国の金利上昇を受けた日米短期金利差の拡大による円安米ドル高の進行

マイナス要因

- ・世界的な国債利回りの上昇による債券価格の下落

■投資環境

【外国債券市場】

米国債利回りは上昇しました。

期初、FRB（米連邦準備制度理事会）が物価上昇は一時的との認識を示したことや新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから、米国債利回りは低下基調で推移しました。その後は、世界的にインフレの高止まりが懸念されるなか、FRBによる2022年以降の利上げなどが市場で意識され、米国債利回りは上昇基調で推移しました。期末にかけて、ウクライナ情勢の悪化を背景に米国債利回りは低下する局面もありましたが、FRBが金融引き締め姿勢を強めたことを受けて、一段と上昇しました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。

期初、新型コロナウイルスワクチン接種の進展などを受けてドイツ国債利回りは上昇基調で推移しましたが、その後は欧州における変異株の感染拡大などを背景に、大きく低下しました。期半ば以降、ECB（欧州中央銀行）の金融政策正常化へ向けた動きが市場で意識されるなか、ドイツ国債利回りは上昇基調が継続しプラス圏を回復しました。期末にかけては、ウクライナ情勢の悪化などを背景にドイツ国債利回りは低下する局面もありましたが、ECBが金融引き締め姿勢を強めるなか、一段と上昇しました。

【為替市場】

米ドル円相場は、米国債利回りが低下基調で推移するなか、期半ばにかけておおむね横ばいで推移しました。期後半は、FRBによる政策金利の引き上げが市場で織り込まれるなか、日銀が緩和的な金融政策を継続したことから日米短期金利差が拡大し、円安米ドル高基調となりました。期末にかけては、FRBが政策金利の引き上げに踏み切るなか、円安米ドル高が一段と進行しました。

ユーロ円相場は、新型コロナウイルス変異株の感染拡大やウクライナ情勢の悪化などを受けて円高ユーロ安が進行する場面もありましたが、ECBによる金融政策正常化に向けた動きなどを背景に円安ユーロ高が進行しました。

■ポートフォリオについて

<東京海上セレクション・外国債券インデックス>

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、2.4%上昇しました。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

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

以上の運用の結果、基準価額は2.6%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+2.4%となり、ベンチマークの騰落率+2.6%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

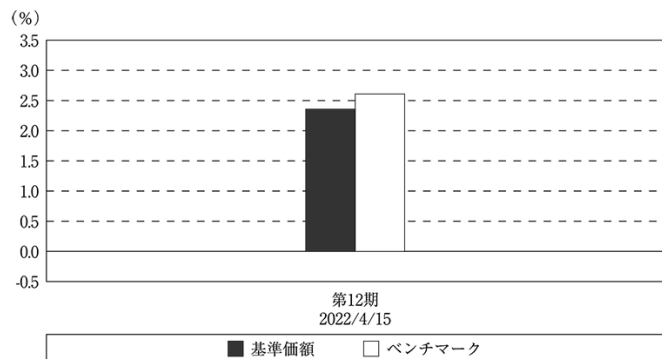
プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・取引および信託報酬などのコスト

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

■分配金

当期においては、当ファンドが確定拠出年金向けに設定されたファンドであるという性格を鑑み、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第12期
	2021年4月16日～ 2022年4月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,568

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

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

○今後の運用方針

<東京海上セレクション・外国債券インデックス>

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

ファンドの基本方針に基づき、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年4月16日～2022年4月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.198	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(16)	(0.102)	* 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(12)	(0.074)	* 購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.022)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	4	0.023	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.017)	* 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
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.005)	* 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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	* その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	35	0.221	
期中の平均基準価額は、15,553円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

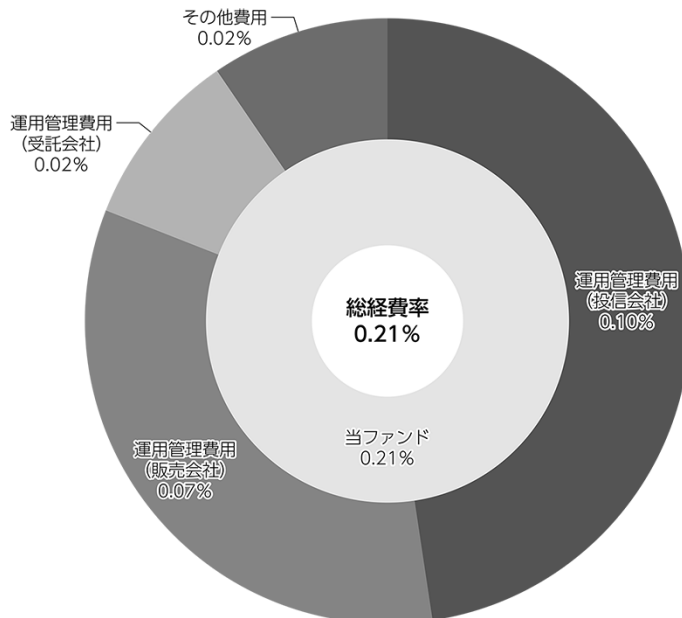
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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0.21%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2021年4月16日～2022年4月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
TMA外国債券インデックスマザーファンド		1,499,808	2,594,393	693,910	1,200,171

○利害関係人との取引状況等

(2021年4月16日～2022年4月15日)

該当事項はございません。

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

(2022年4月15日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
TMA外国債券インデックスマザーファンド		3,214,196	4,020,095	7,007,025

○投資信託財産の構成

(2022年4月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
TMA外国債券インデックスマザーファンド	千円 7,007,025	% 99.8
コール・ローン等、その他	12,823	0.2
投資信託財産総額	7,019,848	100.0

(注) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(10,942,042千円)の投資信託財産総額(10,957,799千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=126.37円、1カナダドル=100.13円、1メキシコペソ=6.335円、1ユーロ=136.53円、1英ポンド=164.99円、1スウェーデンクローナ=13.25円、1ノルウェークローネ=14.37円、1デンマーククローネ=18.36円、1ポーランドズロチ=29.4606円、1豪ドル=93.51円、1シンガポールドル=93.17円、1マレーシアリンギット=29.8498円、1イスラエルシケル=39.2401円、1オフショア元=19.7748円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,019,848,416
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	7,007,025,740
未収入金	12,822,676
(B) 負債	12,822,676
未払解約金	6,042,236
未払信託報酬	6,597,272
その他未払費用	183,168
(C) 純資産総額(A-B)	7,007,025,740
元本	4,481,287,642
次期繰越損益金	2,525,738,098
(D) 受益権総口数	4,481,287,642口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,636円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,575,728,933円、期中追加設定元本額は1,670,168,692円、期中一部解約元本額は764,609,983円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2021年4月16日～2022年4月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	135,007,778
売買益	172,727,153
売買損	△ 37,719,375
(B) 信託報酬等	△ 12,816,908
(C) 当期損益金(A+B)	122,190,870
(D) 前期繰越損益金	264,719,562
(E) 追加信託差損益金	2,138,827,666
(配当等相当額)	(2,553,249,480)
(売買損益相当額)	(△ 414,421,814)
(F) 計(C+D+E)	2,525,738,098
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	2,525,738,098
追加信託差損益金	2,138,827,666
(配当等相当額)	(2,556,420,103)
(売買損益相当額)	(△ 417,592,437)
分配準備積立金	386,910,432

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	93,608,753円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	28,582,117円
c. 信託約款に規定する収益調整金	2,556,420,103円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	264,719,562円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,943,330,535円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,568円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2021年11月10日）

（計算期間 2020年11月11日～2021年11月10日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーカー		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
	騰 落	中 率	騰 落	中 率			
	円	%		%	%		百万円
12期(2017年11月10日)	15,662	11.5	269.321	10.8	98.6		46,126
13期(2018年11月12日)	15,274	△ 2.5	262.755	△ 2.4	98.9		4,169
14期(2019年11月11日)	15,809	3.5	272.101	3.6	97.7		4,542
15期(2020年11月10日)	16,671	5.5	287.164	5.5	98.8		6,878
16期(2021年11月10日)	17,599	5.6	303.543	5.7	99.3		9,910

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーカー		債 組 入 比	券 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期 首) 2020年11月10日	円	%		%		
	16,671	—	287.164	—	98.8	
11月末	16,734	0.4	288.333	0.4	98.0	
12月末	16,874	1.2	290.769	1.3	98.9	
2021年1月末	16,851	1.1	290.443	1.1	98.3	
2月末	16,698	0.2	287.771	0.2	98.5	
3月末	17,066	2.4	294.185	2.4	98.7	
4月末	17,060	2.3	294.142	2.4	98.4	
5月末	17,288	3.7	297.961	3.8	98.8	
6月末	17,261	3.5	297.603	3.6	98.4	
7月末	17,378	4.2	299.643	4.3	99.0	
8月末	17,371	4.2	299.594	4.3	98.9	
9月末	17,257	3.5	297.537	3.6	98.7	
10月末	17,620	5.7	303.904	5.8	99.0	
(期 末) 2021年11月10日	17,599	5.6	303.543	5.7	99.3	

(注) 騰落率は期首比です。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合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。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

○運用経過

(2020年11月11日～2021年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：16,671円

期末：17,599円

騰落率： 5.6%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・先進国を中心とした景気回復期待の高まりなどによる円安の進行
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・米国債をはじめとして世界的に国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

■投資環境

【外国債券市場】

米国債利回りは上昇しました。期前半、バイデン米政権による大規模な財政支援策などを背景に、米国債利回りは上昇基調で推移しました。期半ば以降、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などを受けて米国債利回りは低下基調となりましたが、期末にかけては今後予定されるFRB（米連邦準備制度理事会）によるテーパリング（量的緩和の縮小）の開始などを受けて再度上昇に転じ、前期末対比で上昇して期を終えました。

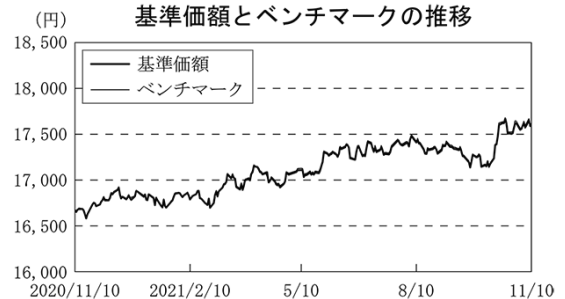
ドイツ国債利回りは上昇しました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展やインフレ懸念などを背景に、ECB（欧州中央銀行）による早期利上げ観測を織り込むかたちでドイツ国債利回りは上昇基調となりました。

【為替市場】

当期、米ドル円相場は円安米ドル高、ユーロ円相場は円安ユーロ高となりました。

期初、米ドル円相場は、大規模な財政支援策の成立などを背景に円安米ドル高基調で推移しました。期半ば以降、米ドル円相場はレンジ内で推移しましたが、期末にかけて米国債利回りの上昇を受けて円安米ドル高が一段と進行しました。

ユーロ円相場は、新型コロナウイルスワクチン接種が進展するなか、欧州域内における景気回復期待の高まりなどから、円安ユーロ高が進行しました。



(注) ベンチマークは、期首(2020年11月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

■ポートフォリオについて

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は5.6%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+5.6%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%にほぼ連動する値動きとなりました。

(主な差異要因)

プラス要因

・特にありません

マイナス要因

・取引や保管などに係るコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、10月末現在、推定値で0.09%となっています。

※2021年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2020年11月11日～2021年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.016	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.016)	*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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、17,121円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		期 末		残存期間別組入比率			
	額面金額	評 価 額		組入比率	うち80格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千米ドル 39,050	千米ドル 40,568	千円 4,578,570	46.2	—	21.6	16.3	8.4
カナダ	千カナダドル 2,100	千カナダドル 2,140	194,168	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 11,700	千メキシコペソ 12,133	67,377	0.7	—	0.4	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	4,700	5,506	720,474	7.3	—	4.7	1.8	0.8
イタリア	6,000	6,892	901,777	9.1	—	5.5	2.4	1.2
フランス	6,500	7,603	994,806	10.0	—	6.7	2.4	1.0
オランダ	1,100	1,400	183,167	1.8	—	1.3	0.4	0.1
スペイン	3,800	4,459	583,461	5.9	—	3.9	1.4	0.5
ベルギー	1,400	1,743	228,163	2.3	—	1.8	0.4	0.1
オーストリア	900	1,069	139,881	1.4	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	400	443	58,036	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	600	672	87,942	0.9	—	0.6	0.3	—
イギリス	千英ポンド 3,140	千英ポンド 4,070	622,684	6.3	—	4.9	0.9	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 2,000	千スウェーデンクローナ 2,203	28,999	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,800	千ノルウェークローネ 1,814	24,084	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 2,300	千デンマーククローネ 2,765	48,639	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,800	千ポーランドズロチ 1,747	49,776	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 2,000	千豪ドル 2,085	173,511	1.8	—	1.1	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 500	千シンガポールドル 544	45,582	0.5	—	0.4	0.1	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 1,700	千マレーシアリンギット 1,734	47,154	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 1,100	千イスラエルシェケル 1,269	46,133	0.5	—	0.3	0.2	0.0
中国	千オフショア元 1,000	千オフショア元 1,015	17,945	0.2	—	0.1	0.1	0.0
合 計	—	—	9,842,338	99.3	—	56.7	29.0	13.6

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日	銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額			利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円		
(アメリカ) 国債証券					(アメリカ) 国債証券						
T 0 1/2 02/28/26	0.5	100	97	11,049	2026/2/28	T 0 3/8 09/15/24	0.375	100	99	11,192	2024/9/15
T 0 1/2 03/15/23	0.5	100	100	11,321	2023/3/15	T 0 3/8 09/30/27	0.375	400	381	43,036	2027/9/30
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	96	10,902	2027/4/30	T 0 3/8 12/31/25	0.375	300	292	33,043	2025/12/31
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	192	21,774	2027/5/31	T 0 5/8 05/15/30	0.625	400	375	42,410	2030/5/15
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	96	10,879	2027/6/30	T 0 5/8 07/31/26	0.625	300	294	33,183	2026/7/31
T 0 1/2 08/31/27	0.5	200	192	21,697	2027/8/31	T 0 5/8 08/15/30	0.625	300	281	31,731	2030/8/15
T 0 1/2 10/31/27	0.5	100	95	10,824	2027/10/31	T 0 5/8 10/15/24	0.625	200	199	22,533	2024/10/15
T 0 1/4 03/15/24	0.25	200	198	22,414	2024/3/15	T 0 5/8 11/30/27	0.625	400	386	43,565	2027/11/30
T 0 1/4 04/15/23	0.25	100	99	11,285	2023/4/15	T 0 5/8 12/31/27	0.625	100	96	10,882	2027/12/31
T 0 1/4 05/15/24	0.25	100	99	11,187	2024/5/15	T 0 7/8 06/30/26	0.875	200	198	22,397	2026/6/30
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	195	22,094	2025/5/31	T 0 7/8 11/15/30	0.875	200	191	21,594	2030/11/15
T 0 1/4 06/15/23	0.25	300	299	33,818	2023/6/15	T 1 07/31/28	1.0	300	294	33,215	2028/7/31
T 0 1/4 06/15/24	0.25	200	198	22,357	2024/6/15	T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	204	23,048	2027/1/31
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	293	33,109	2025/6/30	T 1 1/2 02/15/30	1.5	500	505	57,091	2030/2/15
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	97	11,021	2025/7/31	T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	101	11,476	2023/2/28
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	292	33,015	2025/8/31	T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	101	11,478	2023/3/31
T 0 1/4 09/30/23	0.25	200	199	22,512	2023/9/30	T 1 1/2 09/15/22	1.5	400	404	45,662	2022/9/15
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	194	21,999	2025/9/30	T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	102	11,552	2024/9/30
T 0 1/4 10/31/25	0.25	400	389	43,923	2025/10/31	T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	307	34,662	2024/10/31
T 0 1/8 02/15/24	0.125	300	297	33,569	2024/2/15	T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	204	23,109	2024/11/30
T 0 1/8 04/30/23	0.125	200	199	22,517	2023/4/30	T 1 1/4 04/30/28	1.25	300	299	33,823	2028/4/30
T 0 1/8 05/15/23	0.125	200	199	22,510	2023/5/15	T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	173	19,621	2050/5/15
T 0 1/8 05/31/23	0.125	100	99	11,252	2023/5/31	T 1 1/4 05/31/28	1.25	300	299	33,802	2028/5/31
T 0 1/8 06/30/23	0.125	200	199	22,499	2023/6/30	T 1 1/4 06/30/28	1.25	200	199	22,520	2028/6/30
T 0 1/8 07/15/23	0.125	200	199	22,487	2023/7/15	T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	101	11,457	2023/7/31
T 0 1/8 07/31/23	0.125	200	199	22,481	2023/7/31	T 1 1/4 08/15/31	1.25	400	393	44,385	2031/8/15
T 0 1/8 08/15/23	0.125	100	99	11,237	2023/8/15	T 1 1/4 08/31/24	1.25	300	304	34,416	2024/8/31
T 0 1/8 08/31/23	0.125	300	298	33,706	2023/8/31	T 1 1/4 09/30/28	1.25	200	199	22,475	2028/9/30
T 0 1/8 09/15/23	0.125	500	497	56,152	2023/9/15	T 1 1/8 02/15/31	1.125	400	390	44,055	2031/2/15
T 0 1/8 09/30/22	0.125	400	399	45,135	2022/9/30	T 1 1/8 02/28/25	1.125	300	303	34,242	2025/2/28
T 0 1/8 10/15/23	0.125	700	696	78,563	2023/10/15	T 1 1/8 02/29/28	1.125	300	298	33,643	2028/2/29
T 0 1/8 12/15/23	0.125	700	694	78,421	2023/12/15	T 1 1/8 05/15/40	1.125	200	177	20,037	2040/5/15
T 0 1/8 12/31/22	0.125	100	99	11,275	2022/12/31	T 1 1/8 08/15/40	1.125	100	88	9,992	2040/8/15
T 0 3/4 03/31/26	0.75	300	296	33,479	2026/3/31	T 1 1/8 08/31/28	1.125	300	296	33,471	2028/8/31
T 0 3/4 04/30/26	0.75	200	197	22,304	2026/4/30	T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	305	34,486	2023/1/31
T 0 3/4 05/31/26	0.75	100	98	11,145	2026/5/31	T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	510	57,653	2023/5/15
T 0 3/4 08/31/26	0.75	300	295	33,364	2026/8/31	T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	309	34,894	2024/7/31
T 0 3/8 01/31/26	0.375	500	487	55,006	2026/1/31	T 1 3/4 08/15/41	1.75	200	196	22,195	2041/8/15
T 0 3/8 04/15/24	0.375	100	99	11,230	2024/4/15	T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	202	22,891	2022/9/30
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	98	11,110	2025/4/30	T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	309	34,957	2029/11/15
T 0 3/8 07/15/24	0.375	300	297	33,626	2024/7/15	T 1 3/4 12/31/24	1.75	600	619	69,866	2024/12/31
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	191	21,592	2027/7/31	T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	310	35,008	2026/12/31
T 0 3/8 08/15/24	0.375	400	397	44,805	2024/8/15	T 1 3/8 01/31/25	1.375	200	203	23,019	2025/1/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	202	22,898	2023/2/15
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	179	20,239	2050/8/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	101	11,412	2022/10/15
T 1 3/8 11/15/40	1.375	100	92	10,420	2040/11/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	615	69,501	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	205	23,177	2026/5/15
T 1 5/8 05/15/31	1.625	400	407	46,016	2031/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	100	101	11,416	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	300	306	34,621	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	205	23,195	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/22	1.625	100	101	11,452	2022/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	300	308	34,789	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	101	11,463	2022/12/15
T 1 7/8 02/15/41	1.875	300	301	33,991	2041/2/15
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	103	11,722	2026/7/31
T 2 02/15/23	2.0	300	306	34,621	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	207	23,457	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	500	519	58,588	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	103	11,695	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	832	94,008	2025/8/15
T 2 08/15/51	2.0	200	208	23,495	2051/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	208	23,566	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	112	12,743	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	523	59,119	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	113	12,754	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	311	35,105	2023/8/15
T 2 1/4 05/15/41	2.25	300	320	36,115	2041/5/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	105	11,956	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	216	24,396	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	200	218	24,666	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	836	94,456	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	424	47,875	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	313	35,365	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	104	11,794	2026/11/15
T 2 11/30/22	2.0	400	407	46,013	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	654	73,910	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	104	11,748	2023/7/31
T 2 3/4 08/15/42	2.75	100	115	13,044	2042/8/15
T 2 3/4 08/15/47	2.75	100	118	13,420	2047/8/15
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	627	70,837	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	231	26,109	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	106	12,023	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	107	12,123	2029/5/15
T 2 3/8 05/15/51	2.375	300	338	38,174	2051/5/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	209	23,641	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	100	112	12,667	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	106	12,059	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	109	12,303	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	106	11,971	2025/3/31
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	110	12,421	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	118	13,323	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	214	24,174	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	107	12,116	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	110	12,438	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	119	13,526	2045/8/15
T 3 02/15/47	3.0	300	371	41,956	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	300	374	42,233	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	502	56,682	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	124	14,018	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	125	14,110	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	122	13,815	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	127	14,413	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	370	41,835	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	224	25,322	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	121	13,742	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	367	41,483	2045/11/15
T 3 3/4 11/15/43	3.75	100	134	15,175	2043/11/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	200	267	30,188	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	132	14,941	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	131	14,887	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	267	30,186	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	139	15,797	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	148	16,780	2041/2/15
T 4 3/8 02/15/38	4.375	100	140	15,818	2038/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	141	16,019	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	200	282	31,902	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	74	8,358	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	135	15,244	2031/2/15
US TREASURY N/B	0.75	300	291	32,854	2028/1/31
US TREASURY N/B	1.875	300	302	34,195	2051/2/15
小 計				4,578,570	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0 1/2 09/01/25	0.5	100	97	8,824	2025/9/1
CAN 0 1/2 11/01/23	0.5	100	99	8,995	2023/11/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	100	90	8,242	2030/12/1
CAN 0 1/4 03/01/26	0.25	100	95	8,668	2026/3/1
CAN 0 1/4 04/01/24	0.25	100	98	8,905	2024/4/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(カナダ) 国債証券	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CAN 0 1/4 05/01/23	0.25	100	99	9,001	2023/5/1
CAN 0 1/4 08/01/23	0.25	100	98	8,975	2023/8/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	97	8,876	2027/6/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	101	9,168	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	100	9,143	2026/6/1
CAN 1 1/2 06/01/31	1.5	100	99	8,993	2031/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	100	9,099	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	97	8,880	2030/6/1
CAN 2 06/01/28	2.0	100	103	9,394	2028/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	102	9,253	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	103	9,407	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	105	9,582	2029/6/1
CAN 2 12/01/51	2.0	200	202	18,345	2051/12/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	116	10,606	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	130	11,803	2045/12/1
小 計				194,168	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10 11/20/36	10.0	300	370	2,055	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	649	3,604	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	800	760	4,220	2026/3/5
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	100	556	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,723	9,573	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	1,000	1,031	5,729	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	700	706	3,921	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	300	309	1,718	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,331	7,393	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,610	8,945	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	900	975	5,418	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	800	825	4,586	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,700	1,738	9,653	2023/12/7
小 計				67,377	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0 03/10/23	—	300	303	39,660	2023/3/10
BKO 0 06/16/23	—	200	202	26,495	2023/6/16
DBR 0 02/15/30	—	100	103	13,539	2030/2/15
DBR 0 02/15/31	—	100	103	13,487	2031/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	102	13,399	2035/5/15
DBR 0 05/15/36	—	100	101	13,338	2036/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	102	13,469	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	103	13,533	2029/8/15
DBR 0 08/15/30	—	200	206	27,042	2030/8/15
DBR 0 08/15/31	—	100	102	13,459	2031/8/15
DBR 0 08/15/50	—	100	100	13,103	2050/8/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	104	13,606	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	104	13,725	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	104	13,664	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	105	13,785	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	315	41,298	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	200	206	27,027	2027/11/15
DBR 0 11/15/28	—	100	103	13,522	2028/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	106	13,917	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	102	13,464	2023/2/15
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	134	17,635	2048/8/15
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	160	21,033	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	165	21,605	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	171	22,500	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	200	330	43,298	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	165	21,635	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	100	194	25,420	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	180	23,614	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	155	20,337	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	140	18,446	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	300	305	39,977	2024/4/5
OBL 0 04/10/26	—	100	102	13,448	2026/4/10
OBL 0 04/11/25	—	200	204	26,787	2025/4/11
OBL 0 10/09/26	—	100	102	13,461	2026/10/9
OBL 0 10/18/24	—	200	204	26,729	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0 01/15/24	—	100	100	13,186	2024/1/15
BTPS 0 01/30/24	—	100	99	13,059	2024/1/30
BTPS 0 04/01/26	—	100	99	13,069	2026/4/1
BTPS 0 04/15/24	—	100	100	13,182	2024/4/15
BTPS 0 1/2 02/01/26	0.5	100	102	13,369	2026/2/1
BTPS 0 1/2 07/15/28	0.5	100	100	13,161	2028/7/15
BTPS 0 1/4 03/15/28	0.25	100	99	12,999	2028/3/15
BTPS 0.3 08/15/23	0.3	400	405	53,090	2023/8/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	200	203	26,634	2025/2/1
BTPS 0.6 08/01/31	0.6	100	98	12,842	2031/8/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	300	310	40,673	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	101	13,339	2023/3/1
BTPS 0.95 03/01/37	0.95	100	96	12,612	2037/3/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	100	102	13,385	2030/8/1
BTPS 0.95 12/01/31	0.95	100	100	13,204	2031/12/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	105	13,853	2025/6/1
BTPS 1 3/4 07/01/24	1.75	100	105	13,788	2024/7/1
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	105	13,741	2024/11/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	214	28,036	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	107	14,113	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	200	215	28,248	2030/12/1
BTPS 1.8 03/01/41	1.8	100	106	13,907	2041/3/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	100	107	14,030	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	110	14,456	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	114	15,004	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	108	14,185	2025/12/1
BTPS 2.45 09/01/33	2.45	100	116	15,214	2033/9/1
BTPS 2.45 09/01/50	2.45	100	118	15,468	2050/9/1
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	123	16,144	2047/3/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	125	16,417	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	237	31,098	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	123	16,169	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	134	17,609	2046/9/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	111	14,562	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	127	16,721	2035/3/1
BTPS 3.45 03/01/48	3.45	100	139	18,300	2048/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	138	18,155	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	111	14,550	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	107	14,061	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	109	14,274	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	129	16,894	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	162	21,310	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	147	19,258	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	158	20,735	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	160	21,008	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	211	27,702	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	151	19,863	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	148	19,434	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	136	17,896	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	135	17,745	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	300	302	39,629	2023/2/25
FRTR 0 02/25/24	—	200	203	26,579	2024/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	300	306	40,104	2026/2/25
FRTR 0 02/25/27	—	100	102	13,356	2027/2/25
FRTR 0 03/25/23	—	100	101	13,218	2023/3/25
FRTR 0 03/25/24	—	200	203	26,597	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	300	305	40,026	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	104	13,664	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/29	0.5	100	105	13,765	2029/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	200	201	26,336	2040/5/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR 0 1/2 06/25/44	0.5	100	98	12,890	2044/6/25
FRTR 0 1/4 11/25/26	0.25	100	103	13,544	2026/11/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	202	26,466	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	200	200	26,286	2030/11/25
FRTR 0 11/25/31	—	100	99	13,016	2031/11/25
FRTR 0 3/4 05/25/28	0.75	100	106	13,930	2028/5/25
FRTR 0 3/4 05/25/52	0.75	100	101	13,224	2052/5/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	321	42,039	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	323	42,328	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	229	29,973	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	121	15,929	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	225	29,549	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	200	226	29,648	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	106	13,900	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	103	13,584	2023/5/25
FRTR 1 3/4 05/25/66	1.75	100	131	17,243	2066/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	122	16,067	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	214	28,069	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	132	17,350	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	245	32,100	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	100	102	13,454	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	235	30,853	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	160	20,947	2045/5/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	197	25,888	2055/4/25
FRTR 4 04/25/60	4.0	100	208	27,219	2060/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	160	20,973	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	160	21,016	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	109	14,372	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	286	37,495	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	200	325	42,545	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	126	16,531	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	176	23,082	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/27	—	100	102	13,420	2027/1/15
NETHER 0 07/15/30	—	100	102	13,355	2030/7/15
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	105	13,741	2026/7/15
NETHER 0 1/4 07/15/25	0.25	100	103	13,508	2025/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	107	14,051	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	129	16,935	2033/1/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	167	21,908	2047/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	174	22,820	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	161	21,079	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	137	17,973	2028/1/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	109	14,371	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	300	304	39,794	2025/1/31
SPGB 0 01/31/28	—	100	99	13,075	2028/1/31
SPGB 0 04/30/23	—	100	100	13,208	2023/4/30
SPGB 0 05/31/24	—	200	201	26,401	2024/5/31
SPGB 0.1 04/30/31	0.1	100	97	12,769	2031/4/30
SPGB 0.35 07/30/23	0.35	100	101	13,307	2023/7/30
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	100	13,200	2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	103	13,521	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	210	27,483	2027/7/30
SPGB 1 1/4 10/31/30	1.25	100	108	14,210	2030/10/31
SPGB 1 10/31/50	1.0	100	96	12,577	2050/10/31
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	104	13,610	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	107	14,064	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	109	14,340	2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	109	14,290	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	115	15,104	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	110	14,402	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	229	30,059	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	109	14,355	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	110	14,433	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	200	241	31,582	2033/7/30
SPGB 2.7 10/31/48	2.7	100	137	17,948	2048/10/31
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	141	18,447	2046/10/31
SPGB 3.45 07/30/66	3.45	100	159	20,864	2066/7/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	151	19,769	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	110	14,392	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	170	22,241	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	111	14,633	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	171	22,385	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	156	20,473	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	135	17,749	2028/10/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	143	18,762	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	103	13,554	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	101	13,325	2023/10/22
BGB 0.8 06/22/25	0.8	100	105	13,751	2025/6/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	106	13,990	2027/6/22
BGB 0.9 06/22/29	0.9	100	108	14,202	2029/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	107	14,007	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	110	14,403	2031/6/22
BGB 1 1/4 04/22/33	1.25	100	113	14,842	2033/4/22

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…ベルギー) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	121	15,839	2047/6/22
BGB 1.9 06/22/38	1.9	100	123	16,205	2038/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	170	22,288	2045/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	169	22,239	2041/3/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	163	21,409	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	138	18,102	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 07/15/24	—	100	101	13,311	2024/7/15
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	105	13,801	2029/2/20
RAGB 0 1/2 04/20/27	0.5	100	105	13,764	2027/4/20
RAGB 0 10/20/40	—	100	94	12,325	2040/10/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	106	13,902	2026/10/20
RAGB 1 1/2 02/20/47	1.5	100	127	16,696	2047/2/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	104	13,717	2023/10/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	162	21,292	2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	161	21,068	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFGB 0 1/2 09/15/28	0.5	100	105	13,791	2028/9/15
RFGB 0 3/4 04/15/31	0.75	100	107	14,121	2031/4/15
RFGB 1 1/8 04/15/34	1.125	100	112	14,779	2034/4/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	100	117	15,343	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	101	13,287	2030/10/18
IRISH 1 05/15/26	1.0	100	106	13,946	2026/5/15
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	112	14,662	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	112	14,701	2031/3/18
IRISH 1.7 05/15/37	1.7	100	119	15,619	2037/5/15
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	120	15,725	2025/3/13
ユーロ計					3,897,710
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/4 07/31/31	0.25	100	94	14,477	2031/7/31
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	200	196	30,112	2026/1/30
UKT 0 1/8 01/31/23	0.125	200	199	30,523	2023/1/31
UKT 0 1/8 01/31/24	0.125	100	99	15,190	2024/1/31
UKT 0 5/8 06/07/25	0.625	100	100	15,398	2025/6/7
UKT 0 5/8 07/31/35	0.625	100	95	14,634	2035/7/31
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	92	14,119	2050/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	101	15,527	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	112	17,162	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	103	15,891	2027/7/22
UKT 1 1/4 10/22/41	1.25	100	104	15,954	2041/10/22

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
(イギリス) 国債証券					
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	111	17,016	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	106	16,346	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	105	16,194	2025/9/7
UKT 2 1/2 07/22/65	2.5	100	162	24,914	2065/7/22
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	103	15,816	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	152	23,275	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	206	31,589	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	144	22,154	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	175	26,853	2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	166	25,523	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	144	22,125	2036/3/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	36	5,587	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	156	23,997	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	172	26,384	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	181	27,813	2049/12/7
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	100	198	30,315	2055/12/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	134	20,646	2030/12/7
UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	100	160	24,479	2038/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	134	20,559	2032/6/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	13	2,098	2028/12/7
小 計				622,684	
(スウェーデン) 国債証券					
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	200	198	2,608	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	200	208	2,743	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	300	314	4,133	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	300	310	4,083	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	300	314	4,144	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	400	436	5,743	2025/5/12
SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	2.25	100	120	1,584	2032/6/1
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	200	300	3,957	2039/3/30
小 計				28,999	
(ノルウェー) 国債証券					
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	200	200	2,654	2026/2/19
NGB 1 1/4 09/17/31	1.25	200	194	2,586	2031/9/17
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	200	202	2,686	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	200	201	2,679	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	100	101	1,343	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	200	196	2,607	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	100	102	1,362	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	300	304	4,036	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	300	311	4,128	2024/3/14
小 計				24,084	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千円	千円	千円	
(デンマーク) 国債証券					
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	300	314	5,538	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	400	422	7,428	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/22	0.25	200	201	3,549	2022/11/15
DGB 0 1/4 11/15/52	0.25	200	201	3,538	2052/11/15
DGB 0 11/15/24	—	100	101	1,785	2024/11/15
DGB 0 11/15/31	—	200	200	3,531	2031/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	200	208	3,671	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	218	3,835	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	500	896	15,760	2039/11/15
小 計				48,639	
(ポーランド) 国債証券					
POLGB 0 04/25/23	—	100	96	2,735	2023/4/25
POLGB 0 1/4 10/25/26	0.25	100	88	2,510	2026/10/25
POLGB 0 3/4 04/25/25	0.75	200	186	5,312	2025/4/25
POLGB 1 1/4 10/25/30	1.25	100	87	2,493	2030/10/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	200	199	5,691	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	99	2,819	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	200	197	5,618	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	98	2,799	2027/7/25
POLGB 2 1/4 10/25/24	2.25	200	197	5,610	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	200	197	5,627	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	200	199	5,667	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	101	2,889	2025/7/25
小 計				49,776	
(オーストラリア) 国債証券					
ACGB 0 1/2 09/21/26	0.5	100	96	8,005	2026/9/21
ACGB 0 1/4 11/21/25	0.25	100	96	8,025	2025/11/21
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	195	16,294	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	94	7,875	2032/5/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	100	93	7,808	2030/12/21
ACGB 1 3/4 06/21/51	1.75	100	84	7,061	2051/6/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	106	8,877	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	104	8,722	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	200	210	17,515	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	215	17,911	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	108	9,030	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	110	9,167	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	107	8,943	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	111	9,298	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	100	127	10,630	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	113	9,417	2026/4/21

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千豪ドル	千豪ドル	千円	
(オーストラリア) 国債証券	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	107	8,924	2023/4/21
小 計				173,511	
(シンガポール) 国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	103	8,704	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	103	8,702	2026/6/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	220	18,485	2027/3/1
SIGB 3 3/8 09/01/33	3.375	100	115	9,689	2033/9/1
小 計				45,582	
(マレーシア) 国債証券		千リンギット	千リンギット		
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	92	2,517	2031/4/15
MGS 3.48 03/15/23	3.48	200	203	5,531	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	101	2,751	2027/5/31
MGS 3.733 06/15/28	3.733	100	102	2,779	2028/6/15
MGS 3.757 05/22/40	3.757	100	94	2,570	2040/5/22
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	97	2,638	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	98	2,679	2033/4/15
MGS 3.885 08/15/29	3.885	100	102	2,779	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25	3.955	100	103	2,811	2025/9/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	103	2,819	2024/7/15
MGS 4.254 05/31/35	4.254	100	102	2,783	2035/5/31
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	105	2,862	2026/4/15
MGS 4.498 04/15/30	4.498	100	106	2,885	2030/4/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	104	2,841	2046/3/15
MGS 4.762 04/07/37	4.762	100	106	2,882	2037/4/7
MGS 5.248 09/28	5.248	100	111	3,021	2028/9/15
小 計				47,154	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千豪ドル	千豪ドル	千円	
(イスラエル) 国債証券	%	千イスラエリシヤク	千イスラエリシヤク	千円	
ILGOV 1 03/31/30	—	100	99	3,601	2030/3/31
ILGOV 1 1/2 11/30/23	—	100	103	3,777	2023/11/30
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	104	3,803	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	200	215	7,812	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	108	3,949	2028/9/28
ILGOV 3 3/4 03/31/24	—	100	110	4,012	2024/3/31
ILGOV 3 3/4 03/31/47	—	100	130	4,731	2047/3/31
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	108	3,935	2023/3/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	162	5,894	2042/1/31
ILGOV 6 1/4 10/30/26	—	100	127	4,616	2026/10/30
小 計				46,133	
(中国) 国債証券		千オフジョア元	千オフジョア元		
CGB 2.57 05/20/23	2.57	200	200	3,538	2023/5/20
CGB 2.84 04/08/24	2.84	100	100	1,778	2024/4/8
CGB 2.85 06/04/27	2.85	100	100	1,770	2027/6/4
CGB 3.01 05/13/28	3.01	100	100	1,778	2028/5/13
CGB 3.02 10/22/25	3.02	100	101	1,787	2025/10/22
CGB 3.03 03/11/26	3.03	100	101	1,789	2026/3/11
CGB 3.27 11/19/30	3.27	100	102	1,813	2030/11/19
CGB 3.29 05/23/29	3.29	100	102	1,813	2029/5/23
CGB 3.81 09/14/50	3.81	100	106	1,876	2050/9/14
小 計				17,945	
合 計				9,842,338	

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

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,842,339	99.0
コール・ローン等、その他	99,801	1.0
投資信託財産総額	9,942,140	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(9,910,916千円)の投資信託財産総額(9,942,140千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=112.86円、1カナダドル=90.70円、1メキシコペソ=5.5529円、1ユーロ=130.83円、1英ポンド=152.97円、1スウェーデンクローナ=13.16円、1ノルウェークローネ=13.27円、1デンマーククローネ=17.59円、1ポーランドズロチ=28.4806円、1豪ドル=83.21円、1シンガポールドル=83.79円、1マレーシアリングギット=27.1906円、1イスラエルシェケル=36.33円、1オプショア元=17.6645円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,942,140,297
コール・ローン等	45,920,409
公社債(評価額)	9,842,339,064
未収利息	50,666,401
前払費用	3,214,423
(B) 負債	32,027,353
未払解約金	32,027,296
未払利息	57
(C) 純資産総額(A-B)	9,910,112,944
元本	5,630,915,772
次期繰越損益金	4,279,197,172
(D) 受益権総口数	5,630,915,772口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,599円

(注) 当親ファンドの期首元本額は4,126,162,688円、期中追加設定元本額は2,414,085,443円、期中一部解約元本額は909,332,359円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国債券インデックス	3,715,868,836円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	1,224,444,582円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	366,201,762円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	170,789,065円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	67,201,860円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	35,248,521円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	23,423,269円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	16,654,942円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	11,082,935円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2020年11月11日～2021年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	144,916,947
受取利息	144,930,091
支払利息	△ 13,144
(B) 有価証券売買損益	312,305,543
売買益	566,330,250
売買損	△ 254,024,707
(C) 保管費用等	△ 1,398,760
(D) 当期損益金(A+B+C)	455,823,730
(E) 前期繰越損益金	2,752,566,430
(F) 追加信託差損益金	1,716,635,470
(G) 解約差損益金	△ 645,828,458
(H) 計(D+E+F+G)	4,279,197,172
次期繰越損益金(H)	4,279,197,172

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、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です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。