

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"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
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13期 運用報告書（全体版）

（決算日 2023年4月17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13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)	標準価額		ベンチマーク		債 組 入 比 率	純 資 産 額		
		税 分 配	達 配 金	期 騰 落	中 率			期 騰 落	中 率
	円		円		%		百万円		
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
13期(2023年4月17日)	15,572		0		△0.4	300.267	△0.1	98.6	8,823

(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	基準価額		ベンチ マ ー ク	債 組 入 比 率	
	騰 落	率			騰 落
(期首)	円	%		%	
2022年4月15日	15,636	—	300.586	—	99.1
4月末	15,718	0.5	302.301	0.6	98.8
5月末	15,616	△0.1	300.371	△0.1	98.5
6月末	15,977	2.2	307.616	2.3	98.7
7月末	16,079	2.8	309.955	3.1	98.8
8月末	15,897	1.7	305.903	1.8	98.9
9月末	15,750	0.7	303.253	0.9	98.7
10月末	16,205	3.6	312.317	3.9	98.5
11月末	15,715	0.5	302.924	0.8	98.6
12月末	14,947	△4.4	287.981	△4.2	98.6
2023年1月末	15,125	△3.3	291.515	△3.0	98.6
2月末	15,303	△2.1	295.041	△1.8	98.9
3月末	15,496	△0.9	298.754	△0.6	99.1
(期末)					
2023年4月17日	15,572	△0.4	300.267	△0.1	98.6

(注) 騰落率は期首比です。

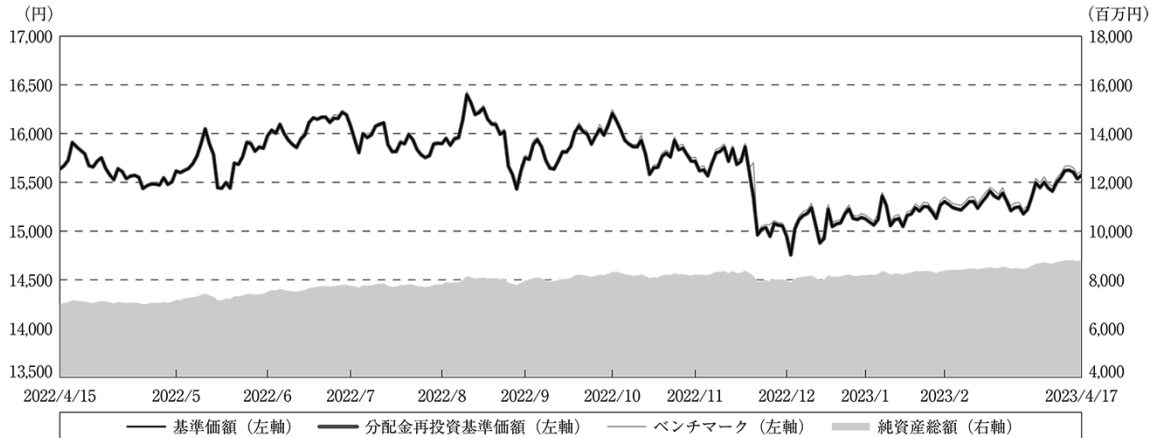
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2022年4月16日～2023年4月17日)

## ■期中の基準価額等の推移



期 首：15,636円

期 末：15,572円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.4% (分配金再投資ベース)

(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(2022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、世界的にインフレの高止まりが懸念されるなか、FRB（米連邦準備制度理事会）が2022年3月の会合で政策金利の引き上げに踏み切り、その後も大幅な利上げを継続したことで、米国債利回りは上昇基調で推移しました。期後半に入ると、米国で雇用統計やCPI（消費者物価指数）に落ち着きが見られ、FRBによる金融引き締め長期化への懸念が後退したことから、米国債利回りは低下基調に転じました。期末にかけては、雇用・物価指標が堅調に推移した一方で、米国の地銀破綻を受けた金融システム不安の高まりから米国債利回りは一時大きく低下しましたが、前期末対比では上昇しました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。

資源価格の高騰などを背景としてインフレが高進するなか、ECB（欧州中央銀行）による金融政策正常化に向けた動きを背景に、ドイツ国債利回りは上昇基調で推移しました。欧州経済の減速懸念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、7月のECB会合で0.5%の利上げに踏み切り、その後も利上げを継続する姿勢を示したことから、上昇基調で期を終えました。

### 【為替市場】

米ドル円為替レートは、期前半、米国のインフレ率の高まりや金融政策正常化を急ぐ姿勢を受けて米国債利回りが上昇し、日本と米国の金利差が拡大したことにより円安米ドル高となりました。期後半は、FRBによる利上げ継続への懸念が後退したことや、日銀が金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロール政策のレンジを拡大したことから、円高米ドル安となりましたが、前期末対比では円安米ドル高の水準となりました。

ユーロ円為替レートは、インフレ率の高止まりやECBによる金融政策正常化に向けた動きを背景に円安ユーロ高の水準で推移しました。米国でCPIが事前予想を下回ったことを背景に世界的に利上げ継続への懸念が後退し、円高ユーロ安となる局面もありましたが、ユーロ圏の景気の底堅さを受けたECB高官による金融引き締めに関する積極的な発言を背景に円安ユーロ高が進行し、前期末対比円安ユーロ高の水準で期を終えました。

## ■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、0.4%下落しました。

### <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。

以上のような運用の結果、基準価額は0.2%の下落となり、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△0.4%となり、ベンチマークの騰落率△0.1%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

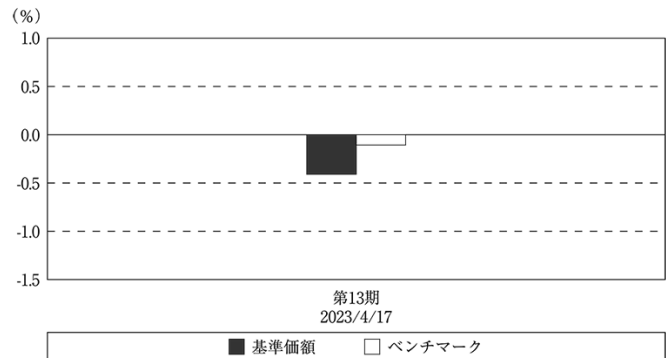
プラス要因

- ・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13期
	2022年4月16日～ 2023年4月17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	6,825

(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

(2022年 4 月16日～2023年 4 月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.199	(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)	(0.075)	*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	5	0.031	(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 ）	( 4)	(0.025)	*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)	(0.006)	*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	36	0.230	
期中の平均基準価額は、15,652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。

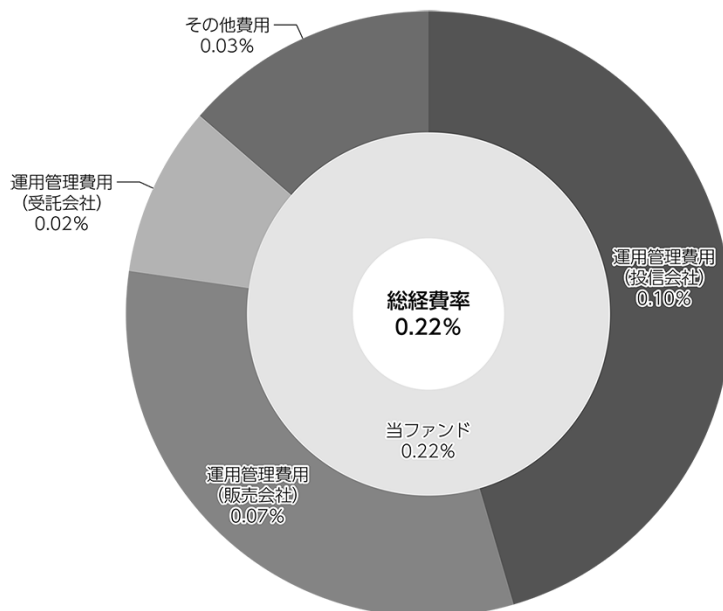
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.22%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

(2022年4月16日～2023年4月17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		1,731,	194	3,023,	005	678,	723	1,183,	014

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年4月16日～2023年4月17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

(2023年4月17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
			千口		千口	千円
TMA外国債券インデックスマザーファンド		4,020,	095	5,072,	566	8,823,221

## ○投資信託財産の構成

(2023年4月17日現在)

項	目	当		期	末
		評	価	額	比
			千円		%
TMA外国債券インデックスマザーファンド		8,823,	221		99.8
コール・ローン等、その他		18,	459		0.2
投資信託財産総額		8,841,	680		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(14,198,064千円)の投資信託財産総額(14,291,495千円)に対する比率は99.3%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=133.89円、1カナダドル=100.15円、1メキシコペソ=7.4399円、1ユーロ=147.00円、1英ポンド=166.04円、1スウェーデンクローナ=12.96円、1ノルウェークローネ=12.89円、1デンマーククローネ=19.73円、1ポーランドズロチ=31.6534円、1豪ドル=89.75円、1ニュージーランドドル=83.04円、1シンガポールドル=100.51円、1マレーシアリンギット=30.3032円、1イスラエルシェケル=36.4415円、1オフショア元=19.4606円です。



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年4月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,841,680,763
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	8,823,221,830
未収入金	18,458,933
(B) 負債	18,458,933
未払解約金	9,957,293
未払信託報酬	8,271,954
その他未払費用	229,686
(C) 純資産総額(A-B)	8,823,221,830
元本	5,666,040,557
次期繰越損益金	3,157,181,273
(D) 受益権総口数	5,666,040,557口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,572円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,481,287,642円、期中追加設定元本額は1,931,772,214円、期中一部解約元本額は747,019,299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 (2022年4月16日～2023年4月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 20,930,877
売買益	40,946,974
売買損	△ 61,877,851
(B) 信託報酬等	△ 16,212,132
(C) 当期損益金(A+B)	△ 37,143,009
(D) 前期繰越損益金	333,657,867
(E) 追加信託差損益金	2,860,666,415
(配当等相当額)	( 3,387,823,685)
(売買損益相当額)	(△ 527,157,270)
(F) 計(C+D+E)	3,157,181,273
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	3,157,181,273
追加信託差損益金	2,860,666,415
(配当等相当額)	( 3,392,273,942)
(売買損益相当額)	(△ 531,607,527)
分配準備積立金	475,224,098
繰越損益金	△ 178,709,240

(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)	141,566,231円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	3,392,273,942円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	333,657,867円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	3,867,498,040円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,825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17期 (決算日 2022年11月10日)

(計算期間 2021年11月11日~2022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		ベンチマーク		債組入比率	純資産総額
	円	騰落率	期騰落	中率		
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
17期(2022年11月10日)	17,776	1.0	307.252	1.2	98.6	12,958

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	券率
	円	騰落率	期騰落	中率		
(期首) 2021年11月10日	17,599	—	303.543	—	99.3	%
11月末	17,426	△1.0	300.520	△1.0	99.2	%
12月末	17,540	△0.3	302.422	△0.4	99.0	%
2022年1月末	17,235	△2.1	297.286	△2.1	98.9	%
2月末	16,924	△3.8	291.915	△3.8	98.7	%
3月末	17,483	△0.7	301.548	△0.7	98.8	%
4月末	17,522	△0.4	302.301	△0.4	98.8	%
5月末	17,412	△1.1	300.371	△1.0	98.5	%
6月末	17,817	1.2	307.616	1.3	98.7	%
7月末	17,934	1.9	309.955	2.1	98.7	%
8月末	17,734	0.8	305.903	0.8	98.8	%
9月末	17,573	△0.1	303.253	△0.1	98.6	%
10月末	18,084	2.8	312.317	2.9	98.5	%
(期末) 2022年11月10日	17,776	1.0	307.252	1.2	98.6	%

(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

(2021年11月11日～2022年11月10日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：17,599円

期末：17,776円

騰落率： 1.0%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・内外金利差の拡大による円安の進行
- ・保有する債券の利息収入

## マイナス要因

- ・欧米中央銀行による金融引き締めを背景とした世界的な国債利回りの上昇（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。世界的にインフレ懸念が高まるなか、FRB（米連邦準備制度理事会）は2022年3月の会合で利上げに踏み切ると、その後も大幅な利上げを継続し、米国債利回りは上昇基調で推移しました。期半ばには、急速な利上げに伴う景気減速懸念から米国債利回りは低下（債券価格は上昇）に転じる局面もありましたが、FRBがインフレ対応を重視して金融引き締めを継続する姿勢を示したことから、期末にかけて米国債利回りは再度上昇基調となり、前期末対比で大きく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。資源価格の高騰などを背景に欧州域内でのインフレが高進するなか、ECB（欧州中央銀行）は大幅な利上げに踏み切り、その後も金融引き締め姿勢を維持したことから、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。

米ドル円相場は、日銀が金融緩和姿勢を維持する一方で、FRBはインフレ対応を目的として大幅な利上げを継続したことから日米金利差が拡大し、期を通じて円安米ドル高基調で推移しました。

ユーロ円相場は、インフレの高進を受けてECBが金融引き締め姿勢を強め、大幅な利上げに踏み切ったことなどから、円安ユーロ高が進行しました。



(注) ベンチマークは、期首(2021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1.0%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+1.0%となり、ベンチマークの騰落率+1.2%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<sup>(※)</sup>は、10月末現在、推定値で0.07%となっています。

※2022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

(2021年11月11日～2022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 4	% 0.022	(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 ）	(4)	(0.022)	*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	4	0.022	
期中の平均基準価額は、17,557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。

## ○売買及び取引の状況

(2021年11月11日～2022年11月10日)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千米ドル 18,463	千米ドル 6,427
	カナダ	千カナダドル 948	千カナダドル 293
	メキシコ	千メキシコペソ 4,056	千メキシコペソ 98
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 2,097	705
	イタリア	国債証券 2,089	910
	フランス	国債証券 2,187	706
	オランダ	国債証券 567	208
	スペイン	国債証券 1,204	300
	ベルギー	国債証券 392	98
	オーストリア	国債証券 344	99
	フィンランド	国債証券 96	—
	イギリス	千英ポンド 1,070	千英ポンド 394
	スウェーデン	国債証券 513	—
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 572	千ノルウェークローネ 300
	デンマーク	千デンマーククローネ 354	千デンマーククローネ 201
	ポーランド	千ポーランドズロチ 667	千ポーランドズロチ 388
	オーストラリア	千豪ドル 363	千豪ドル 103
	シンガポール	千シンガポールドル 100	千シンガポールドル —
	マレーシア	千マレーシアリングgit 710	千マレーシアリングgit 201
イスラエル	千イスラエルシェケル 178	千イスラエルシェケル 103	
中国	千オフショア元 21,796	千オフショア元 1,208	

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年11月11日～2022年11月10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 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	うち80格以下 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	
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%	
アメリカ	51,650	44,711	6,546,160	50.5	—	21.8	19.0	9.7	
カナダ	千カナダドル 2,800	千カナダドル 2,497	270,260	2.1	—	1.1	0.5	0.5	
メキシコ	千メキシコペソ 16,000	千メキシコペソ 14,557	108,993	0.8	—	0.4	0.3	0.2	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	6,200	5,796	850,169	6.6	—	3.8	1.7	1.0	
イタリア	7,300	6,613	969,984	7.5	—	4.2	2.4	0.9	
フランス	8,000	7,429	1,089,677	8.4	—	5.1	2.8	0.5	
オランダ	1,500	1,415	207,589	1.6	—	1.1	0.4	0.1	
スペイン	4,700	4,430	649,838	5.0	—	3.0	1.4	0.7	
ベルギー	1,700	1,597	234,341	1.8	—	1.4	0.3	0.1	
オーストリア	1,200	1,040	152,611	1.2	—	0.9	0.2	0.1	
フィンランド	500	441	64,678	0.5	—	0.4	0.1	—	
アイルランド	600	547	80,287	0.6	—	0.4	0.2	—	
イギリス	千英ポンド 3,940	千英ポンド 3,506	583,750	4.5	—	3.5	0.6	0.4	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 2,500	千スウェーデンクローナ 2,430	32,743	0.3	—	0.1	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 2,100	千ノルウェークローネ 1,926	27,170	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 2,500	千デンマーククローネ 2,343	46,223	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランドズロチ 2,200	千ポーランドズロチ 1,745	54,301	0.4	—	0.1	0.2	0.1	
オーストラリア	千豪ドル 2,300	千豪ドル 2,070	194,888	1.5	—	1.1	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 600	千シンガポールドル 578	60,438	0.5	—	0.2	0.2	—	
マレーシア	千マレーシアリンギット 2,200	千マレーシアリンギット 2,132	66,342	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
イスラエル	千イスラエルシェケル 1,200	千イスラエルシェケル 1,191	49,090	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
中国	千オフショア元 21,300	千オフショア元 21,732	437,597	3.4	—	1.6	1.2	0.6	
合 計	—	—	12,777,140	98.6	—	51.0	32.4	15.2	

(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	評 価 額	外貨換算金額			利率	額面金額	評 価 額	外貨換算金額	
	%	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	87	12,858	2026/2/28	T 1 1/2 02/15/25	1.5	300	279	40,982	2025/2/15
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	84	12,377	2027/4/30	T 1 1/2 02/15/30	1.5	500	417	61,114	2030/2/15
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	168	24,688	2027/5/31	T 1 1/2 02/29/24	1.5	300	287	42,090	2024/2/29
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	84	12,314	2027/6/30	T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	94	13,803	2024/9/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	300	250	36,720	2027/8/31	T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	282	41,342	2024/10/31
T 0 1/2 10/31/27	0.5	200	166	24,333	2027/10/31	T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	187	27,483	2024/11/30
T 0 1/2 11/30/23	0.5	300	286	42,001	2023/11/30	T 1 1/2 11/30/28	1.5	400	340	49,889	2028/11/30
T 0 1/4 03/15/24	0.25	200	188	27,541	2024/3/15	T 1 1/4 04/30/28	1.25	300	255	37,437	2028/4/30
T 0 1/4 05/15/24	0.25	100	93	13,675	2024/5/15	T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	100	14,718	2050/5/15
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	179	26,253	2025/5/31	T 1 1/4 05/31/28	1.25	300	255	37,351	2028/5/31
T 0 1/4 06/15/24	0.25	200	186	27,252	2024/6/15	T 1 1/4 06/30/28	1.25	200	169	24,850	2028/6/30
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	268	39,331	2025/6/30	T 1 1/4 08/15/31	1.25	500	394	57,814	2031/8/15
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	89	13,051	2025/7/31	T 1 1/4 08/31/24	1.25	300	282	41,291	2024/8/31
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	266	39,022	2025/8/31	T 1 1/4 09/30/28	1.25	300	252	36,987	2028/9/30
T 0 1/4 09/30/23	0.25	100	96	14,069	2023/9/30	T 1 1/4 11/30/26	1.25	400	353	51,765	2026/11/30
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	177	25,962	2025/9/30	T 1 1/4 12/31/26	1.25	400	352	51,673	2026/12/31
T 0 1/4 10/31/25	0.25	400	353	51,696	2025/10/31	T 1 1/8 01/15/25	1.125	300	278	40,540	2025/1/15
T 0 1/8 02/15/24	0.125	300	282	41,414	2024/2/15	T 1 1/8 02/15/31	1.125	500	397	58,192	2031/2/15
T 0 1/8 10/15/23	0.125	700	670	98,179	2023/10/15	T 1 1/8 02/28/25	1.125	300	277	40,584	2025/2/28
T 0 1/8 12/15/23	0.125	700	665	97,442	2023/12/15	T 1 1/8 02/29/28	1.125	300	255	37,362	2028/2/29
T 0 3/4 03/31/26	0.75	300	265	38,799	2026/3/31	T 1 1/8 05/15/40	1.125	200	117	17,251	2040/5/15
T 0 3/4 04/30/26	0.75	200	176	25,800	2026/4/30	T 1 1/8 08/15/40	1.125	100	58	8,556	2040/8/15
T 0 3/4 05/31/26	0.75	100	87	12,866	2026/5/31	T 1 1/8 08/31/28	1.125	300	251	36,792	2028/8/31
T 0 3/4 08/31/26	0.75	300	267	38,285	2026/8/31	T 1 1/8 10/31/26	1.125	400	352	51,604	2026/10/31
T 0 3/4 11/15/24	0.75	300	271	40,632	2024/11/15	T 1 12/15/24	1.0	300	278	40,748	2024/12/15
T 0 3/8 01/31/26	0.375	500	438	64,220	2026/1/31	T 1 3/4 01/31/29	1.75	200	172	25,235	2029/1/31
T 0 3/8 04/15/24	0.375	100	93	13,752	2024/4/15	T 1 3/4 03/15/25	1.75	200	187	27,438	2025/3/15
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	90	13,219	2025/4/30	T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	285	41,750	2024/7/31
T 0 3/8 07/15/24	0.375	300	278	40,838	2024/7/15	T 1 3/4 08/15/41	1.75	300	192	28,254	2041/8/15
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	166	24,427	2027/7/31	T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	256	37,622	2029/11/15
T 0 3/8 08/15/24	0.375	400	370	54,258	2024/8/15	T 1 3/4 12/31/24	1.75	600	565	82,781	2024/12/31
T 0 3/8 09/15/24	0.375	100	92	13,532	2024/9/15	T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	270	39,595	2026/12/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	400	331	48,521	2027/9/30	T 1 3/8 01/31/25	1.375	200	186	27,278	2025/1/31
T 0 3/8 10/31/23	0.375	200	191	28,058	2023/10/31	T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	103	15,217	2050/8/15
T 0 3/8 11/30/25	0.375	100	88	12,925	2025/11/30	T 1 3/8 10/31/28	1.375	400	338	49,555	2028/10/31
T 0 3/8 12/31/25	0.375	300	264	38,686	2025/12/31	T 1 3/8 11/15/31	1.375	500	396	58,077	2031/11/15
T 0 5/8 05/15/30	0.625	400	309	45,345	2030/5/15	T 1 3/8 11/15/40	1.375	200	122	17,889	2040/11/15
T 0 5/8 07/31/26	0.625	300	260	38,202	2026/7/31	T 1 3/8 12/31/28	1.375	400	338	49,514	2028/12/31
T 0 5/8 08/15/30	0.625	400	307	45,021	2030/8/15	T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	547	80,166	2026/2/15
T 0 5/8 10/15/24	0.625	300	277	40,680	2024/10/15	T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	181	26,591	2026/5/15
T 0 5/8 11/30/27	0.625	400	333	48,832	2027/11/30	T 1 5/8 05/15/31	1.625	500	410	60,142	2031/5/15
T 0 5/8 12/31/27	0.625	300	249	36,552	2027/12/31	T 1 5/8 08/15/29	1.625	300	255	37,334	2029/8/15
T 0 7/8 01/31/24	0.875	300	286	41,879	2024/1/31	T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	180	26,427	2026/9/30
T 0 7/8 06/30/26	0.875	200	176	25,786	2026/6/30	T 1 5/8 11/15/50	1.625	200	111	16,347	2050/11/15
T 0 7/8 09/30/26	0.875	400	349	51,188	2026/9/30	T 1 5/8 11/30/26	1.625	300	269	39,451	2026/11/30
T 0 7/8 11/15/30	0.875	400	312	45,794	2030/11/15	T 1 7/8 02/15/32	1.875	500	413	60,485	2032/2/15
T 1 07/31/28	1.0	300	250	36,624	2028/7/31	T 1 7/8 02/15/41	1.875	300	200	29,349	2041/2/15
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	177	26,054	2027/1/31	T 1 7/8 02/28/27	1.875	300	271	39,678	2027/2/28

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
国債証券					
T 1 7/8 02/28/29	1.875	200	173	25,411	2029/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	91	13,363	2026/7/31
T 1 7/8 11/15/51	1.875	400	237	34,836	2051/11/15
T 2 02/15/25	2.0	200	188	27,666	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	500	311	45,581	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	95	14,002	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	747	109,386	2025/8/15
T 2 08/15/51	2.0	400	246	36,030	2051/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	194	28,483	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	70	10,294	2046/2/15
T 2 1/2 03/31/27	2.5	200	185	27,115	2027/3/31
T 2 1/2 04/30/24	2.5	100	96	14,163	2024/4/30
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	483	70,728	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	70	10,270	2046/5/15
T 2 1/2 05/31/24	2.5	600	579	84,826	2024/5/31
T 2 1/4 02/15/52	2.25	300	196	28,767	2052/2/15
T 2 1/4 05/15/41	2.25	300	213	31,257	2041/5/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	91	13,333	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	132	19,465	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	200	133	19,488	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	763	111,747	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	363	53,155	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	282	41,376	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	91	13,347	2026/11/15
T 2 11/15/41	2.0	300	201	29,514	2041/11/15
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	555	81,367	2028/2/15
T 2 3/4 04/30/27	2.75	200	187	27,393	2027/4/30
T 2 3/4 05/15/25	2.75	300	286	42,011	2025/5/15
T 2 3/4 05/31/29	2.75	200	182	26,746	2029/5/31
T 2 3/4 07/31/27	2.75	300	280	41,002	2027/7/31
T 2 3/4 08/15/32	2.75	300	266	39,012	2032/8/15
T 2 3/4 08/15/42	2.75	100	76	11,178	2042/8/15
T 2 3/4 08/15/47	2.75	100	73	10,779	2047/8/15
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	587	86,082	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	152	22,281	2042/11/15
T 2 3/8 02/15/42	2.375	300	216	31,631	2042/2/15
T 2 3/8 03/31/29	2.375	300	268	39,271	2029/3/31
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	91	13,459	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	89	13,069	2029/5/15
T 2 3/8 05/15/51	2.375	300	203	29,726	2051/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	191	28,103	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	200	136	20,039	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	94	13,815	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	90	13,303	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	95	14,013	2025/3/31
T 2 5/8 04/15/25	2.625	200	190	27,960	2025/4/15
T 2 5/8 05/31/27	2.625	200	186	27,247	2027/5/31
T 2 5/8 07/31/29	2.625	200	181	26,507	2029/7/31
T 2 7/8 04/30/29	2.875	200	184	26,966	2029/4/30

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
国債証券					
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	92	13,600	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/32	2.875	600	540	79,068	2032/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	77	11,335	2043/5/15
T 2 7/8 05/15/52	2.875	300	227	33,264	2052/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	191	28,087	2025/5/31
T 2 7/8 06/15/25	2.875	300	287	42,126	2025/6/15
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	95	14,019	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	92	13,561	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	75	11,098	2045/8/15
T 2 7/8 11/15/46	2.875	100	75	11,066	2046/11/15
T 3 02/15/47	3.0	300	231	33,947	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	300	232	34,030	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	312	45,766	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	77	11,319	2047/5/15
T 3 06/30/24	3.0	500	485	71,151	2024/6/30
T 3 07/15/25	3.0	300	288	42,202	2025/7/15
T 3 07/31/24	3.0	100	97	14,219	2047/7/31
T 3 08/15/48	3.0	200	155	22,764	2048/8/15
T 3 08/15/52	3.0	200	156	22,842	2052/8/15
T 3 1/2 09/15/25	3.5	100	97	14,238	2025/9/15
T 3 1/4 05/15/42	3.25	100	83	12,216	2042/5/15
T 3 1/4 06/30/27	3.25	300	286	41,955	2027/6/30
T 3 1/4 06/30/29	3.25	200	188	27,567	2029/6/30
T 3 1/4 08/31/24	3.25	300	292	42,806	2024/8/31
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	80	11,844	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	79	11,644	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/25	3.125	300	289	42,317	2025/8/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	239	35,028	2044/8/15
T 3 1/8 08/31/27	3.125	300	285	41,737	2027/8/31
T 3 1/8 08/31/29	3.125	100	93	13,677	2029/8/31
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	187	27,438	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	81	12,001	2041/11/15
T 3 11/15/44	3.0	100	77	11,405	2044/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	232	34,407	2045/11/15
T 3 3/4 11/15/43	3.75	100	89	13,041	2043/11/15
T 3 3/8 08/15/42	3.375	200	170	24,914	2042/8/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	200	167	24,516	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	87	12,747	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	87	12,824	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	185	27,175	2040/8/15
T 3 7/8 09/30/29	3.875	300	293	42,987	2029/9/30
T 4 1/4 09/30/24	4.25	200	198	29,052	2024/9/30
T 4 1/4 10/15/25	4.25	300	297	43,579	2025/10/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	97	14,273	2040/11/15
T 4 1/8 09/30/27	4.125	200	198	29,065	2027/9/30
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	103	15,225	2041/2/15
T 4 3/8 02/15/38	4.375	100	100	14,742	2038/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	99	14,559	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	200	199	29,192	2039/11/15



銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	額	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 5 05/15/37	5.0	50	53	7,882	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	108	15,834	2031/2/15
US TREASURY N/B	0.75	300	250	36,696	2028/1/31
US TREASURY N/B	1.875	300	179	26,264	2051/2/15
小 計				6,546,160	
(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	90	9,834	2025/9/1
CAN 0 1/2 11/01/23	0.5	100	96	10,413	2023/11/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	200	159	17,227	2030/12/1
CAN 0 1/4 03/01/26	0.25	100	88	9,618	2026/3/1
CAN 0 1/4 04/01/24	0.25	100	94	10,255	2024/4/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	89	9,632	2027/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	92	10,009	2026/6/1
CAN 1 1/2 06/01/31	1.5	200	171	18,541	2031/6/1
CAN 1 1/2 12/01/31	1.5	100	85	9,217	2031/12/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	93	10,161	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	85	9,272	2030/6/1
CAN 1 3/4 12/01/53	1.75	100	67	7,291	2053/12/1
CAN 2 06/01/28	2.0	100	92	10,026	2028/6/1
CAN 2 06/01/32	2.0	100	88	9,572	2032/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	98	10,616	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	97	10,559	2024/6/1
CAN 2 1/2 12/01/32	2.5	100	92	9,976	2032/12/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	93	10,083	2029/6/1
CAN 2 12/01/51	2.0	200	145	15,764	2051/12/1
CAN 2 3/4 08/01/24	2.75	200	195	21,134	2024/8/1
CAN 2 3/4 09/01/27	2.75	100	96	10,402	2027/9/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	87	9,415	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	99	10,715	2045/12/1
CAN 3 10/01/25	3.0	100	97	10,517	2025/10/1
小 計				270,260	
(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	307	2,300	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	601	4,500	2024/12/5
MBONO 5 03/06/25	5.0	400	357	2,677	2025/3/6
MBONO 5 1/2 03/04/27	5.5	600	513	3,842	2027/3/4
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	1,900	1,692	12,669	2026/3/5
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,578	11,816	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	1,900	1,696	12,699	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	1,200	984	7,371	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	400	346	2,593	2034/11/23
MBONO 8 07/31/53	8.0	200	162	1,217	2053/7/31
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,250	9,364	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,424	10,662	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	1,100	987	7,391	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	1,200	987	7,396	2047/11/7

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	額	
(メキシコ) 国債証券	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,700	1,668	12,488	2023/12/7
小 計				108,993	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0 03/15/24	—	200	194	28,519	2024/3/15
BKO 0 12/15/23	—	100	97	14,334	2023/12/15
BKO 0 2 06/14/24	0.2	100	97	14,232	2024/6/14
DBR 0 02/15/30	—	100	86	12,613	2030/2/15
DBR 0 02/15/31	—	100	84	12,343	2031/2/15
DBR 0 02/15/32	—	200	164	24,079	2032/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	75	11,060	2035/5/15
DBR 0 05/15/36	—	100	73	10,820	2036/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	92	13,593	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	200	173	25,500	2029/8/15
DBR 0 08/15/30	—	300	255	37,447	2030/8/15
DBR 0 08/15/31	—	200	166	24,424	2031/8/15
DBR 0 08/15/50	—	200	112	16,476	2050/8/15
DBR 0 08/15/52	—	100	54	7,925	2052/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	96	14,157	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	95	13,957	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	92	13,604	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	89	13,111	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	270	39,684	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	200	180	26,472	2027/11/15
DBR 0 11/15/28	—	300	265	38,909	2028/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	97	14,249	2025/8/15
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	200	165	24,205	2048/8/15
DBR 1 7 08/15/32	1.7	100	95	14,059	2032/8/15
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	104	15,396	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	105	15,517	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	115	16,947	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	200	241	35,376	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	125	18,457	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	100	134	19,787	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	126	18,519	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	124	18,315	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	118	17,433	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	300	291	42,718	2024/4/5
OBL 0 04/10/26	—	200	186	27,379	2026/4/10
OBL 0 04/11/25	—	200	190	27,906	2025/4/11
OBL 0 04/16/27	—	100	91	13,369	2027/4/16
OBL 0 10/09/26	—	200	184	27,037	2026/10/9
OBL 0 10/10/25	—	100	94	13,820	2025/10/10
OBL 0 10/18/24	—	200	192	28,173	2024/10/18
OBL 1.3 10/15/27	1.3	200	192	28,229	2027/10/15
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0 01/15/24	—	100	96	14,210	2024/1/15
BTPS 0 01/30/24	—	200	193	28,390	2024/1/30

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 0 04/01/26	—	200	178	26,225	2026/4/1
BTPS 0 04/15/24	—	100	96	14,116	2024/4/15
BTPS 0 08/01/26	—	200	177	25,958	2026/8/1
BTPS 0 1/2 02/01/26	0.5	100	91	13,429	2026/2/1
BTPS 0 1/2 07/15/28	0.5	100	83	12,294	2028/7/15
BTPS 0 1/4 03/15/28	0.25	100	83	12,249	2028/3/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	200	188	27,715	2025/2/1
BTPS 0.45 02/15/29	0.45	100	81	11,954	2029/2/15
BTPS 0.6 08/01/31	0.6	100	74	10,976	2031/8/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	300	270	39,703	2027/1/15
BTPS 0.9 04/01/31	0.9	100	78	11,439	2031/4/1
BTPS 0.95 03/01/37	0.95	100	65	9,532	2037/3/1
BTPS 0.95 06/01/32	0.95	100	75	11,033	2032/6/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	200	159	23,453	2030/8/1
BTPS 0.95 12/01/31	0.95	200	152	22,424	2031/12/1
BTPS 1 1/2 04/30/45	1.5	100	59	8,784	2045/4/30
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	56	14,114	2025/6/1
BTPS 1 3/4 05/30/24	1.75	100	98	14,418	2024/5/30
BTPS 1 3/4 07/01/24	1.75	100	98	14,431	2024/7/1
BTPS 1.1 04/01/27	1.1	100	90	13,280	2027/4/1
BTPS 1.2 08/15/25	1.2	200	189	27,812	2025/8/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	97	14,300	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	188	27,689	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	81	11,930	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	200	168	24,638	2030/12/1
BTPS 1.7 09/01/51	1.7	100	59	8,674	2051/9/1
BTPS 1.8 03/01/41	1.8	100	67	9,939	2041/3/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	200	193	28,399	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	92	13,571	2028/2/1
BTPS 2 1/2 12/01/32	2.5	100	85	12,609	2032/12/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	78	11,548	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	96	14,179	2025/12/1
BTPS 2.45 09/01/33	2.45	100	84	12,338	2033/9/1
BTPS 2.45 09/01/50	2.45	100	70	10,270	2050/9/1
BTPS 2.65 12/01/27	2.65	200	191	28,012	2027/12/1
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	76	11,160	2047/3/1
BTPS 2.8 06/15/29	2.8	100	93	13,766	2029/6/15
BTPS 2.8 12/01/28	2.8	100	95	13,989	2028/12/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	83	12,235	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	190	28,003	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	97	14,365	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	84	12,325	2046/9/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	101	14,912	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	90	13,212	2035/3/1
BTPS 3.45 03/01/48	3.45	100	86	12,727	2048/3/1
BTPS 3.85 09/01/49	3.85	100	91	13,485	2049/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	96	14,165	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	102	14,994	2024/3/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	105	15,501	2028/9/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	104	15,330	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	106	15,565	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	106	15,636	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	106	15,657	2040/9/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	112	16,493	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	114	16,830	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	113	16,698	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	115	16,871	2026/11/1
<b>(ユーロ…フランス)</b>					
<b>国債証券</b>					
FRTR 0 02/25/24	—	200	194	28,493	2024/2/25
FRTR 0 02/25/25	—	200	189	27,809	2025/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	300	278	40,794	2026/2/25
FRTR 0 02/25/27	—	400	361	53,085	2027/2/25
FRTR 0 03/25/24	—	300	290	42,654	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	300	284	41,666	2025/3/25
FRTR 0 05/25/32	—	100	77	11,328	2032/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/25	0.5	100	95	14,025	2025/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	93	13,754	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/29	0.5	200	177	25,980	2029/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	200	132	19,414	2040/5/25
FRTR 0 1/2 06/25/44	0.5	100	61	8,965	2044/6/25
FRTR 0 1/4 11/25/26	0.25	200	184	26,992	2026/11/25
FRTR 0 11/25/29	—	300	253	37,151	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	300	246	36,095	2030/11/25
FRTR 0 11/25/31	—	300	238	35,013	2031/11/25
FRTR 0 3/4 02/25/28	0.75	200	183	26,929	2028/2/25
FRTR 0 3/4 05/25/28	0.75	100	90	13,293	2028/5/25
FRTR 0 3/4 05/25/52	0.75	100	57	8,456	2052/5/25
FRTR 0 3/4 05/25/53	0.75	100	56	8,249	2053/5/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	272	39,928	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	282	41,457	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	185	27,184	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	200	145	21,377	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	168	24,759	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	200	162	23,843	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	200	192	28,232	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/66	1.75	100	71	10,516	2066/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	83	12,306	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	197	29,024	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	81	12,012	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	201	29,496	2030/5/25
FRTR 2 11/25/32	2.0	100	93	13,648	2032/11/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	207	30,477	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	102	15,061	2045/5/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	120	17,638	2055/4/25
FRTR 4 04/25/60	4.0	100	121	17,871	2060/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	112	16,471	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	200	237	34,866	2035/4/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…フランス)</b>					
国債証券					
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	235	34,558	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	200	253	37,157	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	110	16,211	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	200	241	35,417	2041/4/25
<b>(ユーロ…オランダ)</b>					
国債証券					
NETHER 0 01/15/27	—	100	91	13,384	2027/1/15
NETHER 0 01/15/29	—	100	86	12,705	2029/1/15
NETHER 0 01/15/52	—	100	51	7,481	2052/1/15
NETHER 0 07/15/30	—	100	83	12,291	2030/7/15
NETHER 0 07/15/31	—	100	81	12,007	2031/7/15
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	94	13,803	2026/7/15
NETHER 0 1/2 07/15/32	0.5	100	82	12,099	2032/7/15
NETHER 0 1/4 07/15/25	0.25	100	95	13,940	2025/7/15
NETHER 0 3/4 07/15/27	0.75	100	93	13,716	2027/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	99	14,638	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	100	14,695	2033/1/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	105	15,468	2047/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	117	17,263	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	116	17,137	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	115	16,958	2028/1/15
<b>(ユーロ…スペイン)</b>					
国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	300	284	41,754	2025/1/31
SPGB 0 01/31/26	—	200	184	27,023	2026/1/31
SPGB 0 01/31/27	—	100	89	13,118	2027/1/31
SPGB 0 01/31/28	—	200	172	25,281	2028/1/31
SPGB 0 05/31/24	—	200	192	28,246	2024/5/31
SPGB 0 05/31/25	—	100	93	13,771	2025/5/31
SPGB 0 1/2 10/31/31	0.5	100	79	11,624	2031/10/31
SPGB 0.1 04/30/31	0.1	100	78	11,476	2031/4/30
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	85	12,576	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	182	26,733	2027/7/30
SPGB 0.8 07/30/29	0.8	100	86	12,700	2029/7/30
SPGB 0.85 07/30/37	0.85	100	87	10,106	2037/7/30
SPGB 1 1/4 10/31/30	1.25	100	87	12,796	2030/10/31
SPGB 1 10/31/50	1.0	100	55	8,110	2050/10/31
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	68	10,075	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	95	13,969	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	92	13,610	2028/7/30
SPGB 1.45 04/30/29	1.45	100	91	13,487	2029/4/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	94	13,818	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	84	12,392	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	98	14,391	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	186	27,316	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	100	14,666	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	98	14,507	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	200	184	27,029	2033/7/30
SPGB 2.55 10/31/32	2.55	100	94	13,830	2032/10/31

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>					
国債証券					
SPGB 2.7 10/31/48	2.7	100	85	12,536	2048/10/31
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	90	13,255	2046/10/31
SPGB 3.45 07/30/66	3.45	100	94	13,893	2066/7/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	109	16,015	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	200	203	29,901	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	117	17,167	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	102	15,076	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	118	17,445	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	122	17,989	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	112	16,426	2028/10/31
SPGB 5.15 10/31/44	5.15	100	124	18,317	2044/10/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	118	17,401	2029/1/31
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>					
国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	96	14,206	2024/10/22
BGB 0.1 06/22/30	0.1	100	83	12,221	2030/6/22
BGB 0.35 06/22/32	0.35	100	79	11,699	2032/6/22
BGB 0.8 06/22/25	0.8	100	96	14,146	2025/6/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	93	13,682	2027/6/22
BGB 0.8 06/22/28	0.8	100	91	13,432	2028/6/22
BGB 0.9 06/22/29	0.9	100	90	13,240	2029/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	95	14,028	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	87	12,901	2031/6/22
BGB 1 1/4 04/22/33	1.25	100	86	12,715	2033/4/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	74	10,930	2047/6/22
BGB 1.7 06/22/50	1.7	100	73	10,826	2050/6/22
BGB 1.9 06/22/38	1.9	100	85	12,510	2038/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	109	16,093	2045/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	115	16,975	2041/3/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	120	17,725	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	115	17,005	2028/3/28
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>					
国債証券					
RAGB 0 02/20/30	—	100	82	12,097	2030/2/20
RAGB 0 02/20/31	—	100	79	11,706	2031/2/20
RAGB 0 07/15/24	—	100	96	14,138	2024/7/15
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	87	12,877	2029/2/20
RAGB 0 1/2 04/20/27	0.5	100	91	13,451	2027/4/20
RAGB 0 1/4 10/20/36	0.25	100	69	10,236	2036/10/20
RAGB 0 10/20/28	—	100	85	12,584	2028/10/20
RAGB 0 10/20/40	—	100	59	8,676	2040/10/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	93	13,774	2026/10/20
RAGB 1 1/2 02/20/47	1.5	100	76	11,165	2047/2/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	103	15,214	2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	113	16,686	2037/3/15
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>					
国債証券					
RFBG 0 09/15/30	—	100	81	11,916	2030/9/15
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	88	12,933	2028/9/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	債 額	
(ユーロ…フィンランド) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
RFGB 0 3/4 04/15/31	0.75	100	84	12,457	2031/4/15
RFGB 1 1/8 04/15/34	1.125	100	82	12,030	2034/4/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	100	104	15,341	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	82	12,153	2030/10/18
IRISH 1 05/15/26	1.0	100	95	13,982	2026/5/15
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	86	12,633	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	91	13,414	2031/3/18
IRISH 1.7 05/15/37	1.7	100	84	12,398	2037/5/15
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	107	15,704	2025/3/13
ユ ー ロ 計				4,299,178	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/2 01/31/29	0.5	100	83	13,860	2029/1/31
UKT 0 1/2 10/22/61	0.5	100	40	6,695	2061/10/22
UKT 0 1/4 07/31/31	0.25	100	75	12,639	2031/7/31
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	90	15,068	2026/1/30
UKT 0 1/8 01/31/24	0.125	100	96	16,031	2024/1/31
UKT 0 1/8 01/31/28	0.125	100	84	14,020	2028/1/31
UKT 0 3/8 10/22/30	0.375	100	78	13,131	2030/10/22
UKT 0 5/8 06/07/25	0.625	100	93	15,564	2025/6/7
UKT 0 5/8 07/31/35	0.625	100	69	11,509	2035/7/31
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	48	8,070	2050/10/22
UKT 0 7/8 07/31/33	0.875	100	75	12,640	2033/7/31
UKT 1 01/31/32	1.0	100	80	13,355	2032/1/31
UKT 1 04/22/24	1.0	100	96	16,145	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/26	1.5	100	93	15,599	2026/7/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	64	10,819	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	90	15,088	2027/7/22
UKT 1 1/4 10/22/41	1.25	100	66	11,051	2041/10/22
UKT 1 1/8 01/31/39	1.125	100	68	11,341	2039/1/31
UKT 1 3/4 07/22/57	1.75	100	67	11,184	2057/7/22
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	77	12,906	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	90	15,048	2028/10/22
UKT 1 5/8 10/22/54	1.625	100	64	10,708	2054/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	96	16,104	2025/9/7
UKT 2 1/2 07/22/65	2.5	100	82	13,683	2065/7/22
UKT 2 3/4 09/07/24	2.75	100	99	16,490	2024/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	96	16,083	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	105	17,481	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	92	15,465	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	103	17,179	2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	110	18,397	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	105	17,637	2036/3/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	30	5,158	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	105	17,634	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	108	18,021	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	110	18,314	2049/12/7

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	債 額	
(イギリス) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	100	114	19,082	2055/12/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	109	18,243	2030/12/7
UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	100	111	18,608	2038/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	106	17,716	2032/6/7
UKT 4.5 09/07/34	4.5	100	108	18,083	2034/9/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	11	1,883	2028/12/7
小 計				583,750	
(スウェーデン) 国債証券		千 SEK	千 SEK		
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	200	168	2,268	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	300	276	3,724	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	300	271	3,653	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	300	297	4,007	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	500	474	6,393	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	500	500	6,745	2025/5/12
SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	2.25	200	201	2,716	2032/6/1
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	200	240	3,232	2039/3/30
小 計				32,743	
(ノルウェー) 国債証券		千 NOK	千 NOK		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	200	187	2,644	2026/2/19
NGB 1 1/4 09/17/31	1.25	200	165	2,329	2031/9/17
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	200	186	2,626	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	300	288	4,060	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	200	179	2,525	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	300	256	3,622	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	200	187	2,640	2028/4/26
NGB 2 1/8 05/18/32	2.125	200	179	2,523	2032/5/18
NGB 3 03/14/24	3.0	300	297	4,197	2024/3/14
小 計				27,170	
(デンマーク) 国債証券		千 DKK	千 DKK		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	300	274	5,410	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	400	351	6,925	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/52	0.25	300	167	3,309	2052/11/15
DGB 0 11/15/24	—	300	286	5,642	2024/11/15
DGB 0 11/15/31	—	300	240	4,750	2031/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	200	198	3,920	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	196	3,882	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	500	627	12,382	2039/11/15
小 計				46,223	
(ポージランド) 国債証券		千 PLN	千 PLN		
POLGB 0 07/25/24	—	100	87	2,730	2024/7/25
POLGB 0 1/4 10/25/26	0.25	200	149	4,644	2026/10/25
POLGB 0 3/4 04/25/25	0.75	200	168	5,250	2025/4/25
POLGB 1 1/4 10/25/30	1.25	200	125	3,899	2030/10/25
POLGB 1 3/4 04/25/32	1.75	100	61	1,901	2032/4/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	93	2,893	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	200	165	5,154	2026/7/25

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	債 額	
(ポーランド) 国債証券	%	ポーランド円	ポーランド円	千円	
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	79	2,467	2027/7/25
POLGB 2 1/4 10/25/24	2.25	200	180	5,621	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	200	155	4,840	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	300	224	6,971	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	87	2,728	2025/7/25
POLGB 3 3/4 05/25/27	3.75	200	167	5,196	2027/5/25
小 計				54,301	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 0 1/2 09/21/26	0.5	100	89	8,403	2026/9/21
ACGB 0 1/4 11/21/25	0.25	100	90	8,565	2025/11/21
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	166	15,678	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	79	7,477	2032/5/21
ACGB 1 11/21/31	1.0	100	78	7,387	2031/11/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	100	80	7,586	2030/12/21
ACGB 1 3/4 06/21/51	1.75	100	59	5,564	2051/6/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	92	8,660	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	93	8,792	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	200	198	18,697	2024/4/21
ACGB 2 3/4 05/21/41	2.75	100	80	7,586	2041/5/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	192	18,141	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	94	8,869	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	81	7,632	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	99	9,397	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	97	9,186	2029/4/21
ACGB 3 11/21/33	3.0	100	91	8,653	2033/11/21
ACGB 3 3/4 04/21/37	3.75	100	95	8,992	2037/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	100	105	9,945	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	102	9,669	2026/4/21
小 計				194,888	
(シンガポール) 国債証券		シンガポール円	シンガポール円		
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	86	9,004	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	96	10,065	2026/6/1
SIGB 2 7/8 09/01/30	2.875	100	95	10,001	2030/9/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	201	21,052	2027/3/1
SIGB 3 3/8 09/01/33	3.375	100	98	10,314	2033/9/1
小 計				60,438	
(マレーシア) 国債証券		マレーシア円	マレーシア円		
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	86	2,699	2031/4/15
MGS 3.478 06/14/24	3.478	100	99	3,105	2024/6/14
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	96	3,014	2027/5/31
MGS 3.733 06/15/28	3.733	100	96	3,005	2028/6/15
MGS 3.757 05/22/40	3.757	100	86	2,689	2040/5/22
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	92	2,872	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	93	2,904	2033/4/15
MGS 3.885 08/15/29	3.885	100	96	3,001	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25	3.955	200	199	6,218	2025/9/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	債 額	
(マレーシア) 国債証券	%	マレーシア円	マレーシア円	千円	
MGS 4.065 06/15/50	4.065	100	85	2,673	2050/6/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	100	3,139	2024/7/15
MGS 4.232 06/30/31	4.232	100	98	3,049	2031/6/30
MGS 4.254 05/31/35	4.254	100	95	2,959	2035/5/31
MGS 4.392 04/15/26	4.392	200	201	6,279	2026/4/15
MGS 4.498 04/15/30	4.498	100	100	3,111	2030/4/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	96	3,014	2046/3/15
MGS 4.762 04/07/37	4.762	100	100	3,141	2037/4/7
MGS 4.893 06/08/38	4.893	100	101	3,145	2038/6/8
MGS 4.921 07/06/48	4.921	100	98	3,075	2048/7/6
MGS 5.248 09/28	5.248	100	104	3,242	2028/9/15
小 計				66,342	
(イスラエル) 国債証券		イスラエル円	イスラエル円		
ILGOV 0.4 10/31/24	—	100	94	3,896	2024/10/31
ILGOV 1 03/31/30	—	100	85	3,518	2030/3/31
ILGOV 1 1/2 05/31/37	—	100	78	3,240	2037/5/31
ILGOV 1 1/2 11/30/23	—	100	99	4,112	2023/11/30
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	96	3,960	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	200	191	7,890	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	94	3,889	2028/9/28
ILGOV 3 3/4 03/31/24	—	100	102	4,241	2024/3/31
ILGOV 3 3/4 03/31/47	—	100	105	4,334	2047/3/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	132	5,440	2042/1/31
ILGOV 6 1/4 10/30/26	—	100	110	4,563	2026/10/30
小 計				49,090	
(中国) 国債証券		千円	千円		
CGB 1.99 04/09/25	1.99	500	496	10,005	2025/4/9
CGB 1.99 09/15/24	1.99	500	498	10,046	2024/9/15
CGB 2 1/2 07/25/27	2.5	500	500	10,073	2027/7/25
CGB 2 3/4 02/17/32	2.75	300	299	6,035	2032/2/17
CGB 2 3/4 06/15/29	2.75	500	502	10,109	2029/6/15
CGB 2.18 06/25/24	2.18	600	601	12,109	2024/6/25
CGB 2.18 08/25/25	2.18	600	598	12,048	2025/8/25
CGB 2.24 05/25/25	2.24	600	599	12,073	2025/5/25
CGB 2.26 02/24/25	2.26	700	700	14,111	2025/2/24
CGB 2.28 03/17/24	2.28	400	401	8,083	2024/3/17
CGB 2.37 01/20/27	2.37	600	597	12,038	2027/1/20
CGB 2.44 10/15/27	2.44	200	199	4,019	2027/10/15
CGB 2.47 09/02/24	2.47	400	402	8,112	2024/9/2
CGB 2.48 04/15/27	2.48	500	500	10,069	2027/4/15
CGB 2.6 09/01/32	2.6	400	396	7,989	2032/9/1
CGB 2.62 09/25/29	2.62	300	298	6,007	2029/9/25
CGB 2.68 05/21/30	2.68	600	597	12,036	2030/5/21
CGB 2.69 08/12/26	2.69	600	605	12,198	2026/8/12
CGB 2.69 08/15/32	2.69	300	299	6,026	2032/8/15
CGB 2.76 05/15/32	2.76	300	300	6,050	2032/5/15
CGB 2.8 03/24/29	2.8	400	403	8,116	2029/3/24

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額		
(中国) 国債証券	%	千円	千円	千円	
CGB 2.84 04/08/24	2.84	400	404	8,151	2024/4/8
CGB 2.85 06/04/27	2.85	500	507	10,223	2027/6/4
CGB 2.88 11/05/23	2.88	400	404	8,137	2023/11/5
CGB 2.89 11/18/31	2.89	500	505	10,179	2031/11/18
CGB 2.91 10/14/28	2.91	600	610	12,289	2028/10/14
CGB 2.94 10/17/24	2.94	500	508	10,236	2024/10/17
CGB 3 1/4 06/06/26	3.25	500	516	10,393	2026/6/6
CGB 3 1/4 11/22/28	3.25	500	519	10,459	2028/11/22
CGB 3.01 05/13/28	3.01	500	511	10,302	2028/5/13
CGB 3.02 05/27/31	3.02	400	409	8,239	2031/5/27
CGB 3.02 10/22/25	3.02	500	510	10,289	2025/10/22
CGB 3.03 03/11/26	3.03	600	613	12,362	2026/3/11
CGB 3.12 12/05/26	3.12	600	616	12,419	2026/12/5
CGB 3.13 11/21/29	3.13	400	412	8,308	2029/11/21
CGB 3.19 04/11/24	3.19	400	407	8,207	2024/4/11
CGB 3.22 12/06/25	3.22	400	411	8,285	2025/12/6
CGB 3.27 11/19/30	3.27	600	627	12,636	2030/11/19

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額		
(中国) 国債証券	%	千円	千円	千円	
CGB 3.28 12/03/27	3.28	400	415	8,367	2027/12/3
CGB 3.29 05/23/29	3.29	300	313	6,304	2029/5/23
CGB 3.32 04/15/52	3.32	400	413	8,336	2052/4/15
CGB 3.39 03/16/50	3.39	400	414	8,354	2050/3/16
CGB 3.53 10/18/51	3.53	300	320	6,456	2051/10/18
CGB 3.54 08/16/28	3.54	100	106	2,136	2028/8/16
CGB 3.72 04/12/51	3.72	300	329	6,642	2051/4/12
CGB 3.81 09/14/50	3.81	600	669	13,480	2050/9/14
CGB 3.86 07/22/49	3.86	400	448	9,034	2049/7/22
小 計				437,597	
合 計				12,777,140	

(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

(2022年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	12,777,140	98.5
コール・ローン等、その他	188,715	1.5
投資信託財産総額	12,965,855	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(12,944,605千円)の投資信託財産総額(12,965,855千円)に対する比率は99.8%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=146.41円、1カナダドル=108.20円、1メキシコペソ=7.4869円、1ユーロ=146.66円、1英ポンド=166.47円、1スウェーデンクローナ=13.47円、1ノルウェークローネ=14.10円、1デンマーククローネ=19.72円、1ポーランドズロチ=31.1102円、1豪ドル=94.13円、1シンガポールドル=104.46円、1マレーシアリングギット=31.1086円、1イスラエルシェケル=41.1882円、1オプショア元=20.1361円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,965,855,701
コール・ローン等	100,395,438
公社債(評価額)	12,777,140,583
未収利息	80,844,584
前払費用	7,475,096
(B) 負債	7,776,786
未払解約金	7,776,739
未払利息	47
(C) 純資産総額(A-B)	12,958,078,915
元本	7,289,619,248
次期繰越損益金	5,668,459,667
(D) 受益権総口数	7,289,619,248口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,776円

(注) 当親ファンドの期首元本額は5,630,915,772円、期中追加設定元本額は2,677,758,398円、期中一部解約元本額は1,019,054,922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	4,623,594,880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>	1,673,127,570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>	512,437,538円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	230,414,574円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	91,868,355円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	47,080,924円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	45,719,940円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	37,186,893円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	28,188,574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 (2021年11月11日～2022年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	216,544,073
受取利息	216,561,252
その他収益金	63
支払利息	△ 17,242
(B) 有価証券売買損益	△ 84,179,247
売買益	2,336,266,430
売買損	△2,420,445,677
(C) 保管費用等	△ 2,757,449
(D) 当期損益金(A+B+C)	129,607,377
(E) 前期繰越損益金	4,279,197,172
(F) 追加信託差損益金	2,022,266,372
(G) 解約差損益金	△ 762,611,254
(H) 計(D+E+F+G)	5,668,459,667
次期繰越損益金(H)	5,668,459,667

(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。