

★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                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                 |
| 運用方針         | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。                                                                                                                                                                                                            |                                 |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                        | 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券および外国の公社債 |
|              | 外国債券インデックスマザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                              | 外国の公社債                          |
| ベビーファンドの運用方法 | ①投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |                                 |
| マザーファンドの運用方法 | ①投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受け取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。                                                                                                  |                                 |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                          | 無制限                             |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                               | 純資産総額の30%以下                     |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、利息等収益等を中心に分配します。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。                                                                                                                                                                                   |                                 |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないません。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

運用報告書(全体版)  
第18期

(決算日 2017年11月30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、「ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス」は、このたび、第18期の決算を行ないました。

ここに、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立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

最近5期の運用実績

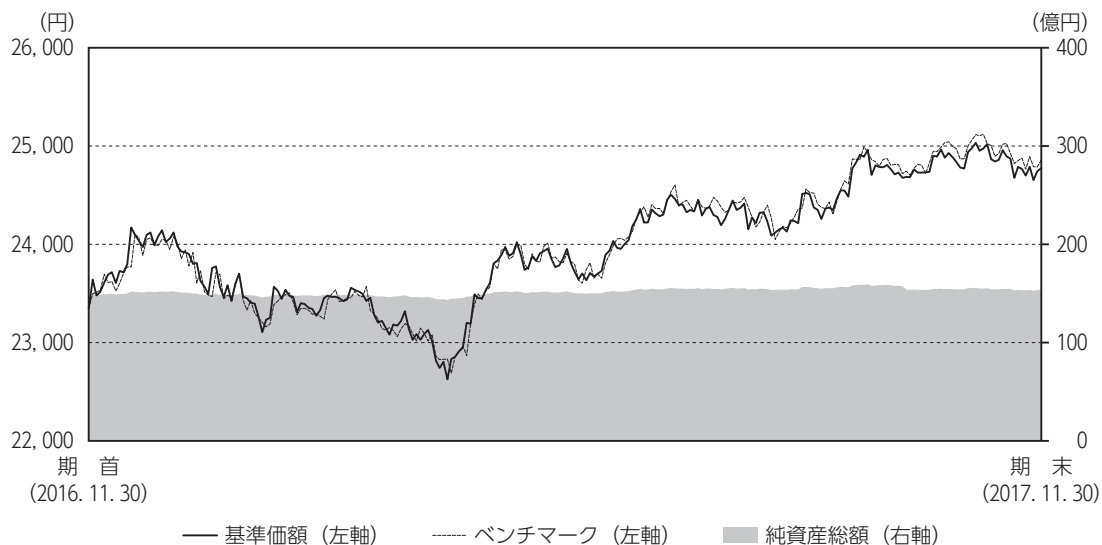
| 決 算 期               | 基 準 価 額 |            |            | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |            | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 | 純資産<br>総 額 |
|---------------------|---------|------------|------------|------------------------------------|------------|---------------|-------------|------------|
|                     |         | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                           | 期 中<br>騰落率 |               |             |            |
|                     | 円       | 円          | %          |                                    | %          | %             | %           | 百万円        |
| 14期末 (2013年12月 2 日) | 22,305  | 0          | 26.3       | 24,794                             | 27.2       | 97.7          | —           | 12,217     |
| 15期末 (2014年12月 1 日) | 26,433  | 0          | 18.5       | 29,578                             | 19.3       | 97.9          | —           | 15,587     |
| 16期末 (2015年11月30日)  | 25,554  | 0          | △ 3.3      | 28,825                             | △ 2.5      | 98.3          | —           | 15,486     |
| 17期末 (2016年11月30日)  | 23,344  | 0          | △ 8.6      | 26,597                             | △ 7.7      | 98.4          | —           | 14,747     |
| 18期末 (2017年11月30日)  | 24,776  | 0          | 6.1        | 28,323                             | 6.5        | 98.2          | —           | 15,384     |

- (注 1) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLC が開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。
- (注 2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。
- (注 6) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\*ベンチマークはシティ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・騰落率

期首：23,344円

期末：24,776円

騰落率：6.1%

### 基準価額の主な変動要因

主に日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、ユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

| 年 月 日            | 基 準 価 額  |       | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |       | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|------------------|----------|-------|------------------------------------|-------|---------------|-------------|
|                  |          | 騰 落 率 | (ベンチマーク)                           | 騰 落 率 |               |             |
| (期首) 2016年11月30日 | 円 23,344 | % —   | 26,597                             | % —   | % 98.4        | % —         |
| 12月末             | 24,059   | 3.1   | 27,285                             | 2.6   | 98.6          | —           |
| 2017年 1 月末       | 23,467   | 0.5   | 26,695                             | 0.4   | 98.3          | —           |
| 2 月末             | 23,331   | △ 0.1 | 26,510                             | △ 0.3 | 98.4          | —           |
| 3 月末             | 23,320   | △ 0.1 | 26,423                             | △ 0.7 | 98.4          | —           |
| 4 月末             | 23,450   | 0.5   | 26,704                             | 0.4   | 98.8          | —           |
| 5 月末             | 23,786   | 1.9   | 27,142                             | 2.0   | 98.2          | —           |
| 6 月末             | 24,221   | 3.8   | 27,778                             | 4.4   | 98.6          | —           |
| 7 月末             | 24,194   | 3.6   | 27,775                             | 4.4   | 98.6          | —           |
| 8 月末             | 24,524   | 5.1   | 27,985                             | 5.2   | 98.4          | —           |
| 9 月末             | 24,784   | 6.2   | 28,327                             | 6.5   | 98.7          | —           |
| 10月末             | 24,770   | 6.1   | 28,338                             | 6.5   | 98.6          | —           |
| (期末) 2017年11月30日 | 24,776   | 6.1   | 28,323                             | 6.5   | 98.2          | —           |

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2016. 12. 1 ~ 2017. 11. 30)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、期を通じて多くの国で上昇しました。期首より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB（欧州中央銀行）やBOC（カナダ銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きました。

### ■為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。期首より、米国の利上げ観測などを受けて円安となりましたが、2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果などを受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進んだ後、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

## 前期における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ポートフォリオについて

(2016. 12. 1 ~ 2017. 11. 30)

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

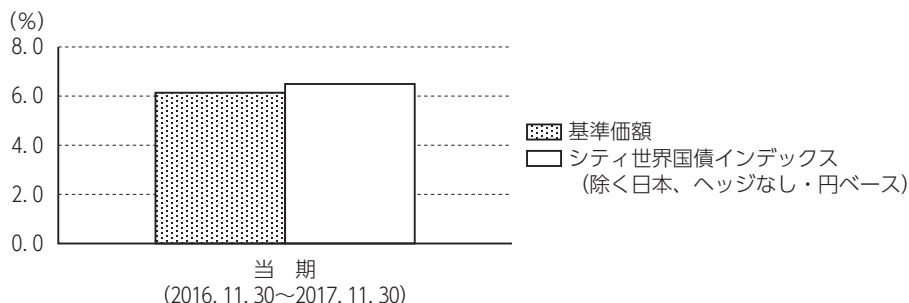
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の騰落率は6.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.1%となりました。

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.05%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったことから、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2016年12月1日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 16,404                     |

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

1万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当 期<br>(2016. 12. 1～2017. 11. 30) |          | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|-----------------------------------|----------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                               | 比 率      |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 168円                              | 0. 702%  | 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23, 999円です。                      |
| (投 信 会 社) | (62)                              | (0. 259) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価             |
| (販 売 会 社) | (86)                              | (0. 356) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                    |
| (受 託 銀 行) | (21)                              | (0. 086) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                     |
| 売買委託手数料   | —                                 | —        | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<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 |
| 有価証券取引税   | —                                 | —        | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<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   |
| そ の 他 費 用 | 8                                 | 0. 034   | 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) | (6)                               | (0. 026) | 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および資金の送金・資産の移転等に要する費用                 |
| (監 査 費 用) | (2)                               | (0. 008) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| 合 計       | 177                               | 0. 736   |                                                                    |

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、この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、このファンドに対応するものを含みます。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

|                           | 設 定     |           | 解 約     |           |
|---------------------------|---------|-----------|---------|-----------|
|                           | □ 数     | 金 額       | □ 数     | 金 額       |
|                           | 千口      | 千円        | 千口      | 千円        |
| 外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド | 380,547 | 1,030,283 | 528,878 | 1,447,333 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                   | 期 首       | 当 期 末     |            |
|-----------------------|-----------|-----------|------------|
|                       | □ 数       | □ 数       | 評 価 額      |
|                       | 千口        | 千口        | 千円         |
| 外国債券インデックス<br>マザーファンド | 5,614,367 | 5,466,036 | 15,345,896 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                   | 当 期 末      |       |
|-----------------------|------------|-------|
|                       | 評 価 額      | 比 率   |
|                       | 千円         | %     |
| 外国債券インデックス<br>マザーファンド | 15,345,896 | 99.2  |
| コール・ローン等、その他          | 117,437    | 0.8   |
| 投資信託財産総額              | 15,463,334 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1メキシコ・ペソ＝6.03円、1マレーシア・リンギット＝27.42円、1南アフリカ・ランド＝8.20円、1ポーランド・ズロチ＝31.60円、1ユーロ＝132.81円です。

(注3) 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（165,668,822千円）の投資信託財産総額（166,838,087千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                        | 当 期 末           |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資産                     | 15,463,334,683円 |
| コール・ローン等                   | 117,437,794     |
| 外国債券インデックス<br>マザーファンド（評価額） | 15,345,896,889  |
| (B) 負債                     | 78,990,328      |
| 未払解約金                      | 23,980,096      |
| 未払信託報酬                     | 54,382,829      |
| その他未払費用                    | 627,403         |
| (C) 純資産総額（A－B）             | 15,384,344,355  |
| 元本                         | 6,209,358,058   |
| 次期繰越損益金                    | 9,174,986,297   |
| (D) 受益権総口数                 | 6,209,358,058口  |
| 1万口当り基準価額（C／D）             | 24,776円         |

\* 期首における元本額は6,317,303,722円、当期中における追加設定元本額は937,789,835円、同解約元本額は1,045,735,499円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,776円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | △ 19,051円        |
| 受取利息             | 1,622            |
| 支払利息             | △ 20,673         |
| (B) 有価証券売買損益     | 937,587,906      |
| 売買益              | 1,020,134,302    |
| 売買損              | △ 82,546,396     |
| (C) 信託報酬等        | △ 107,739,999    |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C） | 829,828,856      |
| (E) 前期繰越損益金      | 1,505,008,828    |
| (F) 追加信託差損益金     | 6,840,148,613    |
| （配当等相当額）         | ( 7,280,645,588) |
| （売買損益相当額）        | (△ 440,496,975)  |
| (G) 合計（D＋E＋F）    | 9,174,986,297    |
| 次期繰越損益金（G）       | 9,174,986,297    |
| 追加信託差損益金         | 6,840,148,613    |
| （配当等相当額）         | ( 7,280,645,588) |
| （売買損益相当額）        | (△ 440,496,975)  |
| 分配準備積立金          | 2,905,447,449    |
| 繰越損益金            | △ 570,609,765    |

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は9ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期            |
|----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 0円             |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 0              |
| (c) 収益調整金                  | 7,280,645,588  |
| (d) 分配準備積立金                | 2,905,447,449  |
| (e) 当期分配対象額（a + b + c + d） | 10,186,093,037 |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e − f）       | 10,186,093,037 |
| (h) 受益権総口数                 | 6,209,358,058口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第18期（決算日 2017年11月30日）

（計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日）

外国債券インデックスマザーファンドの第18期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。                                                                                                                          |
| 主要投資対象 | 外国の公社債                                                                                                                                                                                       |
| 運用方法   | ①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受け取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下                                                                                                                                                                                  |

## 大和投資信託

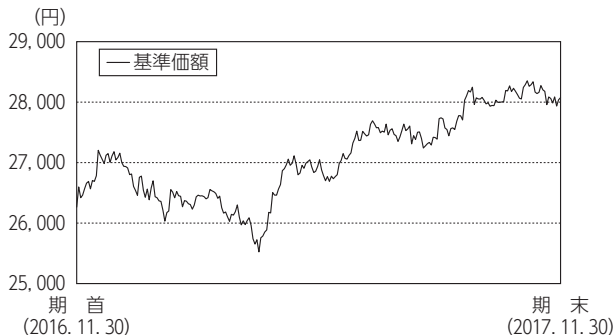
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日            | 基 準 価 額 |     | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |       | 公 社 債 債 券<br>組入比率 |   |
|------------------|---------|-----|------------------------------------|-------|-------------------|---|
|                  | 円       | 騰落率 | ベンチマーク                             | 騰落率   | %                 | % |
| (期首) 2016年11月30日 | 26,265  | —   | 26,597                             | —     | 98.4              | — |
| 12月末             | 27,085  | 3.1 | 27,285                             | 2.6   | 98.6              | — |
| 2017年 1 月末       | 26,435  | 0.6 | 26,695                             | 0.4   | 98.3              | — |
| 2 月末             | 26,296  | 0.1 | 26,510                             | △ 0.3 | 98.4              | — |
| 3 月末             | 26,300  | 0.1 | 26,423                             | △ 0.7 | 98.4              | — |
| 4 月末             | 26,461  | 0.7 | 26,704                             | 0.4   | 98.8              | — |
| 5 月末             | 26,857  | 2.3 | 27,142                             | 2.0   | 98.5              | — |
| 6 月末             | 27,364  | 4.2 | 27,778                             | 4.4   | 98.6              | — |
| 7 月末             | 27,350  | 4.1 | 27,775                             | 4.4   | 98.6              | — |
| 8 月末             | 27,740  | 5.6 | 27,985                             | 5.2   | 98.4              | — |
| 9 月末             | 28,050  | 6.8 | 28,327                             | 6.5   | 98.7              | — |
| 10 月末            | 28,052  | 6.8 | 28,338                             | 6.5   | 98.6              | — |
| (期末) 2017年11月30日 | 28,075  | 6.9 | 28,323                             | 6.5   | 98.4              | — |

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLC が開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

(注 3) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注 4) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注 6) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：26,265円 期末：28,075円 騰落率：6.9%

#### 【基準価額の主な変動要因】

主に日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、ユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

### ◆投資環境について

#### ○海外債券市況

主要国の国債金利は、期を通じて多くの国で上昇しました。期首より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB (欧州中央銀行) やBOC (カナダ銀行) などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きました。

#### ○為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。期首より、米国の利上げ観測などを受けて円安となりましたが、2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果を受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進んだ後、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

### ◆前期における「今後の運用方針」

今後もファンドの通貨の比率をベンチマーク (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ◆ポートフォリオについて

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

### ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) の騰落率は6.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.9%となりました。

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.05%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

## 《今後の運用方針》

今後もファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目             | 当 期       |
|-----------------|-----------|
| 売買委託手数料         | —円        |
| 有価証券取引税         | —         |
| その他費用<br>(保管費用) | 7<br>( 7) |
| 合 計             | 7         |

(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。費用の項  
目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概  
要をご参照ください。

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況  
公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|   |         |      | 買 付 額                           | 売 付 額                           |
|---|---------|------|---------------------------------|---------------------------------|
| 外 | アメリカ    | 国債証券 | 千アメリカ・ドル<br>142, 447<br>( — )   | 千アメリカ・ドル<br>108, 195<br>( — )   |
|   | カナダ     | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>11, 707<br>( — )     | 千カナダ・ドル<br>9, 089<br>( — )      |
|   | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>6, 963<br>( — )  | 千オーストラリア・ドル<br>3, 410<br>( — )  |
|   | シンガポール  | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>1, 239<br>( — )   | 千シンガポール・ドル<br>1, 107<br>( — )   |
|   | イギリス    | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>5, 106<br>( — )    | 千イギリス・ポンド<br>7, 409<br>( — )    |
|   | スイス     | 国債証券 | 千スイス・フラン<br>—<br>( — )          | 千スイス・フラン<br>627<br>( — )        |
|   | デンマーク   | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ<br>5, 847<br>( — )  | 千デンマーク・クローネ<br>10, 152<br>( — ) |
|   | ノルウェー   | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>4, 526<br>( — )  | 千ノルウェー・クローネ<br>—<br>( — )       |
|   | スウェーデン  | 国債証券 | 千スウェーデン・クローネ<br>5, 410<br>( — ) | 千スウェーデン・クローネ<br>1, 760<br>( — ) |

|   |                 |      | 買 付 額                           | 売 付 額                           |
|---|-----------------|------|---------------------------------|---------------------------------|
| 外 | メキシコ            | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>38, 113<br>( — )    | 千メキシコ・ペソ<br>32, 351<br>( — )    |
|   | マレーシア           | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>3, 609<br>( — ) | 千マレーシア・リンギット<br>3, 954<br>( — ) |
|   | 南アフリカ           | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド<br>15, 299<br>( — )  | 千南アフリカ・ランド<br>3, 976<br>( — )   |
|   | ポーランド           | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>7, 467<br>( — )   | 千ポーランド・ズロチ<br>6, 970<br>( — )   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>1, 150<br>( — )         | 千ユーロ<br>797<br>( — )            |
|   | ユーロ<br>(オランダ)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>2, 437<br>( — )         | 千ユーロ<br>4, 447<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>3, 292<br>( — )         | 千ユーロ<br>2, 793<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(フランス)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>15, 244<br>( — )        | 千ユーロ<br>10, 831<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)    | 国債証券 | 千ユーロ<br>11, 220<br>( — )        | 千ユーロ<br>13, 064<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(スペイン)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>10, 791<br>( — )        | 千ユーロ<br>8, 418<br>( — )         |
| 国 | ユーロ<br>(イタリア)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>14, 662<br>( — )        | 千ユーロ<br>13, 153<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>570<br>( — )            | 千ユーロ<br>432<br>( — )            |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 国債証券 | 千ユーロ<br>2, 661<br>( — )         | 千ユーロ<br>1, 802<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 国債証券 | 千ユーロ<br>62, 031<br>( — )        | 千ユーロ<br>55, 742<br>( — )        |

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 当                                                         |         | 期                                                        |         |
|-----------------------------------------------------------|---------|----------------------------------------------------------|---------|
| 買                                                         | 付       | 売                                                        | 付       |
| 銘 柄                                                       | 金 額     | 銘 柄                                                      | 金 額     |
|                                                           | 千円      |                                                          | 千円      |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15   | 663,832 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30  | 479,606 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2027/5/15  | 638,990 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2018/4/30 | 469,931 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2026/11/15     | 607,595 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.5% 2018/2/15   | 441,094 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2024/3/31  | 556,076 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2018/5/31 | 439,788 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2047/2/15      | 467,890 | United Kingdom Gilt (イギリス) 1.25% 2018/7/22               | 410,942 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15    | 448,954 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/8/31   | 390,206 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/5/31   | 447,802 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/2/28  | 382,530 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/2/15   | 446,563 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4% 2018/4/25               | 379,171 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/6/30   | 440,296 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2018/5/31     | 375,037 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2046/11/15 | 405,454 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4% 2018/8/15     | 366,817 |

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

| 作 成 期   | 当                      |                        | 期          |      | 未                  | 残存期間別組入比率 |       |       |
|---------|------------------------|------------------------|------------|------|--------------------|-----------|-------|-------|
| 区 分     | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |            | 組入比率 | うちＢＢ格<br>以下組入<br>比 |           |       |       |
|         |                        | 外 貨 建 金 額              | 邦貨換算金額     |      |                    | 5 年以上     | 2 年以上 | 2 年未満 |
|         |                        |                        | 千円         | %    | %                  | %         | %     | %     |
| アメリカ    | 千アメリカ・ドル<br>626,026    | 千アメリカ・ドル<br>632,164    | 70,834,003 | 42.5 | —                  | 17.7      | 16.6  | 8.2   |
| カナダ     | 千カナダ・ドル<br>37,381      | 千カナダ・ドル<br>40,103      | 3,492,978  | 2.1  | —                  | 0.9       | 0.7   | 0.5   |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>38,134  | 千オーストラリア・ドル<br>41,065  | 3,485,224  | 2.1  | —                  | 1.3       | 0.5   | 0.2   |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>7,117    | 千シンガポール・ドル<br>7,446    | 619,502    | 0.4  | —                  | 0.2       | 0.1   | 0.1   |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>60,444    | 千イギリス・ポンド<br>75,999    | 11,425,072 | 6.9  | —                  | 5.0       | 1.5   | 0.4   |
| スイス     | 千スイス・フラン<br>2,187      | 千スイス・フラン<br>2,587      | 294,510    | 0.2  | —                  | 0.1       | 0.1   | 0.0   |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>48,636  | 千デンマーク・クローネ<br>60,118  | 1,072,508  | 0.6  | —                  | 0.4       | 0.1   | 0.1   |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>32,577  | 千ノルウェー・クローネ<br>34,557  | 469,287    | 0.3  | —                  | 0.2       | 0.1   | 0.1   |
| スウェーデン  | 千スウェーデン・クローネ<br>50,850 | 千スウェーデン・クローネ<br>57,615 | 770,894    | 0.5  | —                  | 0.2       | 0.2   | 0.1   |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>225,127    | 千メキシコ・ペソ<br>231,806    | 1,397,790  | 0.8  | —                  | 0.5       | 0.3   | 0.1   |
| マレーシア   | 千マレーシア・リンギット<br>26,889 | 千マレーシア・リンギット<br>26,874 | 736,885    | 0.4  | —                  | 0.2       | 0.1   | 0.1   |
| 南アフリカ   | 千南アフリカ・ランド<br>116,723  | 千南アフリカ・ランド<br>102,959  | 844,266    | 0.5  | —                  | 0.4       | 0.0   | 0.0   |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>31,917   | 千ポーランド・ズロチ<br>32,731   | 1,034,302  | 0.6  | —                  | 0.2       | 0.3   | 0.1   |

| 作 成 期       |        | 当 期             |                 |                 |          | 未                  |           |          |          |
|-------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|----------|--------------------|-----------|----------|----------|
| 区 分         |        | 額 面 金 額         | 評 価 額           |                 | 組入比率     | うちＢＢ格<br>以下組入<br>比 | 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    |
| ユ<br>ー<br>ロ | アイルランド | 千ユーロ<br>8,727   | 千ユーロ<br>9,950   | 千円<br>1,321,550 | %<br>0.8 | %<br>—             | %<br>0.5  | %<br>0.2 | %<br>0.1 |
|             | オランダ   | 千ユーロ<br>23,054  | 千ユーロ<br>27,284  | 3,623,622       | 2.2      | —                  | 1.4       | 0.6      | 0.2      |
|             | ベルギー   | 千ユーロ<br>26,235  | 千ユーロ<br>32,088  | 4,261,666       | 2.6      | —                  | 1.8       | 0.5      | 0.2      |
|             | フランス   | 千ユーロ<br>108,392 | 千ユーロ<br>128,181 | 17,023,784      | 10.2     | —                  | 6.4       | 2.6      | 1.3      |
|             | ドイツ    | 千ユーロ<br>76,126  | 千ユーロ<br>89,437  | 11,878,234      | 7.1      | —                  | 4.1       | 2.1      | 0.9      |
|             | スペイン   | 千ユーロ<br>61,672  | 千ユーロ<br>71,965  | 9,557,727       | 5.7      | —                  | 3.7       | 1.3      | 0.7      |
|             | イタリア   | 千ユーロ<br>107,051 | 千ユーロ<br>123,182 | 16,359,857      | 9.8      | —                  | 5.7       | 3.0      | 1.1      |
|             | フィンランド | 千ユーロ<br>6,863   | 千ユーロ<br>7,614   | 1,011,296       | 0.6      | —                  | 0.4       | 0.2      | 0.0      |
|             | オーストリア | 千ユーロ<br>16,667  | 千ユーロ<br>19,652  | 2,610,004       | 1.6      | —                  | 1.0       | 0.4      | 0.2      |
|             | 小計     | 434,787         | 509,357         | 67,647,744      | 40.6     | —                  | 24.9      | 10.9     | 4.8      |
| 合 計         |        | —               | —               | 164,124,972     | 98.4     | —                  | 52.3      | 31.4     | 14.8     |

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで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割合。  
(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。  
(注 4) 評価額および格付情報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。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

|                                  |                                  | 当 期    |        | 未        |           |            |            |
|----------------------------------|----------------------------------|--------|--------|----------|-----------|------------|------------|
| 区 分                              | 銘 柄                              | 種 類    | 年利率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |            | 償還年月日      |
|                                  |                                  |        |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額     |            |
| アメリカ                             |                                  |        | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円         |            |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.7500 | 2,488    | 2,537     | 284,300    | 2018/11/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.7500 | 3,161    | 3,200     | 358,642    | 2019/02/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.1250 | 3,096    | 3,159     | 353,990    | 2019/05/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.6250 | 2,621    | 2,704     | 303,007    | 2019/08/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.3750 | 4,020    | 4,144     | 464,391    | 2019/11/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.6250 | 4,280    | 4,451     | 498,737    | 2020/02/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.5000 | 3,073    | 3,197     | 358,275    | 2020/05/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.6250 | 2,854    | 2,913     | 326,410    | 2020/08/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.6250 | 4,509    | 4,607     | 516,303    | 2020/11/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.6250 | 4,076    | 4,294     | 481,154    | 2021/02/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 3.1250 | 2,551    | 2,652     | 297,250    | 2021/05/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.1250 | 2,534    | 2,548     | 285,519    | 2021/08/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.7500 | 1,320    | 1,321     | 148,061    | 2018/10/31 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.0000 | 2,153    | 2,154     | 241,448    | 2021/11/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.3750 | 2,165    | 2,159     | 241,933    | 2018/11/30 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.3750 | 1,861    | 1,855     | 207,872    | 2018/12/31 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.2500 | 1,426    | 1,418     | 158,989    | 2019/01/31 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 2.0000 | 3,224    | 3,223     | 361,191    | 2022/02/15 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.3750 | 1,843    | 1,835     | 205,675    | 2019/02/28 |
|                                  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券   | 1.5000 | 300      | 299       | 33,521     | 2019/03/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国債証券                             | 1.2500 | 559    | 555      | 62,231    | 2019/04/30 |            |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 当   |                                  |      | 期      |          | 未         |         |            | 償還年月日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|-------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |         |            |       |
|     |                                  |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |       |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,459    | 2,429     | 272,194 | 2022/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,385    | 2,364     | 264,908 | 2019/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,368    | 1,352     | 151,570 | 2019/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,784    | 1,759     | 197,108 | 2019/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,543    | 2,494     | 279,509 | 2022/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,872    | 1,848     | 207,085 | 2019/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,215    | 2,185     | 244,845 | 2019/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 884      | 875       | 98,115  | 2019/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,168    | 3,099     | 347,331 | 2022/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,353    | 1,332     | 149,358 | 2019/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,894    | 1,868     | 209,419 | 2019/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,366    | 1,354     | 151,762 | 2020/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 4,350    | 4,323     | 484,444 | 2023/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,968    | 1,944     | 217,894 | 2020/02/29 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,160    | 1,142     | 127,997 | 2020/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 4,685    | 4,589     | 514,245 | 2023/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,451    | 1,427     | 159,992 | 2020/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,461    | 2,434     | 272,790 | 2020/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,131    | 2,133     | 239,103 | 2020/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,827    | 2,839     | 318,124 | 2020/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 2,768    | 2,817     | 315,653 | 2023/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,993    | 2,008     | 225,006 | 2020/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,885    | 1,892     | 212,103 | 2020/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,611    | 3,598     | 403,188 | 2018/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,345    | 2,337     | 261,934 | 2020/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,021    | 5,179     | 580,403 | 2023/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,638    | 2,627     | 294,420 | 2018/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,501    | 2,510     | 281,307 | 2020/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,026    | 2,022     | 226,604 | 2018/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 2,006    | 2,035     | 228,107 | 2020/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,229    | 5,388     | 603,803 | 2024/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,185    | 2,180     | 244,273 | 2019/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,647    | 1,658     | 185,843 | 2021/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,373    | 2,367     | 265,291 | 2019/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,734    | 1,738     | 194,840 | 2021/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,383    | 2,380     | 266,700 | 2019/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,821    | 2,850     | 319,377 | 2021/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 5,412    | 5,495     | 615,789 | 2024/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,975    | 2,970     | 332,825 | 2019/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,407    | 2,430     | 272,379 | 2021/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,241    | 2,233     | 250,210 | 2019/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,732    | 2,736     | 306,668 | 2021/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,885    | 2,880     | 322,708 | 2019/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,485    | 3,504     | 392,688 | 2021/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.8750 | 904      | 982       | 110,144 | 2019/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.1250 | 724      | 801       | 89,815  | 2019/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.7500 | 642      | 759       | 85,151  | 2020/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.0000 | 2,106    | 2,588     | 290,049 | 2021/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.2500 | 654      | 798       | 89,442  | 2023/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.0000 | 855      | 1,091     | 122,274 | 2026/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.5000 | 630      | 842       | 94,371  | 2026/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.1250 | 709      | 944       | 105,829 | 2027/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.5000 | 700      | 904       | 101,379 | 2028/08/15 |       |

| 当   |                                  |      | 期       |          | 未         |          |            | 償還年月日 |
|-----|----------------------------------|------|---------|----------|-----------|----------|------------|-------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額  | 評 価 額     |          |            |       |
|     |                                  |      |         |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額   |            |       |
|     |                                  |      | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円       |            |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 738      | 939       | 105, 291 | 2028/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 473      | 604       | 67, 717  | 2029/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 2500 | 964      | 1, 358    | 152, 192 | 2030/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 3750 | 991      | 1, 318    | 147, 758 | 2031/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 1, 626   | 2, 088    | 234, 032 | 2036/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 0000 | 547      | 747       | 83, 772  | 2037/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 548      | 696       | 78, 083  | 2038/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 519      | 670       | 75, 118  | 2038/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 5000 | 849      | 961       | 107, 720 | 2039/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 2500 | 1, 121   | 1, 405    | 157, 509 | 2039/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 760      | 985       | 110, 412 | 2039/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 210   | 1, 543    | 172, 970 | 2039/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 6250 | 1, 710   | 2, 254    | 252, 649 | 2040/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 478   | 1, 888    | 211, 566 | 2040/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 8750 | 1, 591   | 1, 898    | 212, 727 | 2040/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 2500 | 1, 469   | 1, 848    | 207, 101 | 2040/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 7500 | 1, 754   | 2, 360    | 264, 539 | 2041/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 365   | 1, 750    | 196, 131 | 2041/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 7500 | 1, 367   | 1, 603    | 179, 701 | 2041/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 1, 450   | 1, 541    | 172, 677 | 2041/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 1, 623   | 1, 723    | 193, 150 | 2042/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 0000 | 1, 353   | 1, 406    | 157, 596 | 2042/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 1, 731   | 1, 719    | 192, 668 | 2042/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 2, 630   | 2, 609    | 292, 434 | 2042/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 2, 026   | 2, 148    | 240, 686 | 2043/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 8750 | 3, 998   | 4, 054    | 454, 274 | 2043/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 6250 | 3, 064   | 3, 531    | 395, 701 | 2043/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 7500 | 3, 581   | 4, 214    | 472, 252 | 2043/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 6250 | 3, 617   | 4, 175    | 467, 816 | 2044/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 3750 | 3, 657   | 4, 050    | 453, 845 | 2044/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 3, 326   | 3, 318    | 371, 862 | 2019/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 2500 | 2, 834   | 2, 861    | 320, 674 | 2021/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 3750 | 5, 162   | 5, 199    | 582, 647 | 2024/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 3, 729   | 3, 955    | 443, 259 | 2044/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 2, 989   | 2, 982    | 334, 143 | 2019/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 1, 301   | 1, 301    | 145, 844 | 2021/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 3, 404   | 3, 403    | 381, 357 | 2019/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 1250 | 3, 625   | 3, 642    | 408, 179 | 2021/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 3, 190   | 3, 174    | 355, 663 | 2019/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 2, 163   | 2, 163    | 242, 475 | 2021/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 2500 | 3, 921   | 3, 917    | 438, 970 | 2024/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 0000 | 3, 696   | 3, 832    | 429, 472 | 2044/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 8750 | 2, 886   | 2, 873    | 321, 998 | 2021/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 4, 325   | 4, 302    | 482, 096 | 2019/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 1250 | 3, 169   | 3, 183    | 356, 719 | 2021/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 2, 204   | 2, 196    | 246, 165 | 2019/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 2500 | 3, 963   | 3, 918    | 439, 058 | 2020/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 2, 427   | 2, 376    | 266, 291 | 2022/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 5, 743   | 5, 636    | 631, 533 | 2025/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 3, 763   | 3, 535    | 396, 176 | 2045/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 3750 | 2, 788   | 2, 762    | 309, 502 | 2020/02/29 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 1, 809   | 1, 788    | 200, 432 | 2022/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 3750 | 2, 792   | 2, 764    | 309, 787 | 2020/03/31 |       |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 当   |                                  |      | 期      |          | 未         |         |            | 償還年月日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|-------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |         |            |       |
|     |                                  |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |       |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,891    | 2,856     | 320,062 | 2022/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 5,788    | 5,722     | 641,249 | 2025/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,835    | 3,974     | 445,288 | 2045/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,607    | 2,579     | 289,055 | 2020/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,612    | 2,578     | 288,969 | 2022/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,826    | 2,806     | 314,424 | 2022/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,013    | 2,988     | 334,915 | 2020/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,001    | 2,985     | 334,553 | 2020/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,821    | 2,828     | 316,883 | 2022/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,135    | 3,118     | 349,379 | 2020/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,179    | 2,172     | 243,412 | 2022/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,743    | 5,617     | 629,423 | 2025/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,573    | 3,615     | 405,074 | 2045/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,445    | 2,422     | 271,455 | 2022/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,868    | 2,832     | 317,364 | 2020/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,472    | 2,433     | 272,702 | 2022/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,876    | 2,838     | 318,050 | 2020/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,840    | 5,809     | 650,943 | 2025/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,116    | 3,072     | 344,291 | 2020/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,709    | 3,842     | 430,525 | 2045/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,558    | 2,532     | 283,711 | 2022/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,138    | 2,130     | 238,690 | 2018/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,096    | 3,073     | 344,357 | 2020/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,687    | 2,675     | 299,783 | 2022/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,151    | 2,142     | 240,012 | 2018/12/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,043    | 3,030     | 339,529 | 2020/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,492    | 2,494     | 279,465 | 2022/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,146    | 2,132     | 238,982 | 2019/01/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,126    | 3,075     | 344,576 | 2021/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 5,366    | 5,080     | 569,315 | 2026/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,065    | 2,041     | 228,733 | 2019/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,561    | 2,515     | 281,823 | 2023/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,428    | 3,213     | 360,039 | 2046/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,100    | 2,080     | 233,161 | 2019/03/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,309    | 3,226     | 361,559 | 2021/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,262    | 2,192     | 245,615 | 2023/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,002    | 2,936     | 329,041 | 2021/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,123    | 2,055     | 230,279 | 2023/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,905    | 1,883     | 210,994 | 2019/04/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 6,029    | 5,695     | 638,232 | 2026/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,450    | 2,404     | 269,394 | 2021/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,070    | 2,015     | 225,817 | 2023/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,423    | 3,206     | 359,333 | 2046/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,507    | 2,476     | 277,496 | 2019/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,700    | 2,647     | 296,647 | 2021/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,431     | 272,485 | 2023/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,100    | 2,072     | 232,262 | 2019/06/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,500    | 2,428     | 272,071 | 2021/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,000    | 2,876     | 322,307 | 2023/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,500    | 2,460     | 275,690 | 2019/07/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 5,600    | 5,223     | 585,319 | 2026/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,480    | 3,087     | 346,004 | 2046/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,500    | 2,458     | 275,472 | 2019/08/15 |       |

| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年 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  |            |
|     |                                  |      |        |         | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,700   | 3,585     | 401,757 | 2021/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,700   | 3,589     | 402,209 | 2021/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,780   | 2,644     | 296,288 | 2023/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,400   | 2,295     | 257,259 | 2023/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,600   | 2,559     | 286,764 | 2019/09/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,505   | 2,395     | 268,382 | 2023/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,042   | 2,944     | 329,935 | 2021/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,147   | 2,117     | 237,215 | 2019/10/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,326   | 2,307     | 258,551 | 2018/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,500   | 5,337     | 598,027 | 2026/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,000   | 2,915     | 326,720 | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500   | 2,423     | 271,544 | 2023/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,650   | 3,689     | 413,391 | 2046/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,400   | 1,379     | 154,582 | 2019/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,000   | 993       | 111,336 | 2018/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,490   | 2,481     | 278,067 | 2023/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,400   | 2,376     | 266,230 | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,440   | 1,428     | 160,072 | 2019/12/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,000   | 1,998     | 223,907 | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,400   | 1,393     | 156,164 | 2018/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,500   | 2,506     | 280,867 | 2023/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,500   | 1,487     | 166,663 | 2020/01/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,700   | 1,689     | 189,256 | 2019/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 4,040   | 3,996     | 447,833 | 2027/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010   | 2,991     | 335,162 | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,480   | 2,484     | 278,381 | 2024/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,875   | 4,014     | 449,794 | 2047/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,130   | 2,110     | 236,501 | 2020/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,300   | 2,283     | 255,872 | 2019/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010   | 2,989     | 335,004 | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,300   | 2,287     | 256,284 | 2024/02/29 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 1,900   | 1,892     | 212,054 | 2020/03/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,850   | 1,838     | 206,003 | 2019/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 4,250   | 4,224     | 473,307 | 2024/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 900     | 893       | 100,095 | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 850     | 843       | 94,557  | 2020/04/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 5,700   | 5,695     | 638,231 | 2027/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,700   | 2,796     | 313,380 | 2047/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,000   | 2,977     | 333,575 | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,000   | 2,958     | 331,447 | 2024/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 4,000   | 3,970     | 444,851 | 2020/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000   | 2,960     | 331,709 | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 4,000   | 3,972     | 445,134 | 2019/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,000   | 1,971     | 220,913 | 2024/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,700   | 2,678     | 300,135 | 2020/06/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 4,000   | 3,969     | 444,784 | 2019/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000   | 2,958     | 331,447 | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,400   | 2,363     | 264,864 | 2024/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,000   | 1,982     | 222,172 | 2020/07/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,000   | 994       | 111,388 | 2019/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,900   | 5,829     | 653,188 | 2027/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 1,300   | 1,288     | 144,384 | 2020/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,900   | 2,873     | 322,023 | 2022/07/31 |

# 外国債券インデックスマザーファンド

|         |                                      | 当 期   |        |                      | 末                    |            |            |
|---------|--------------------------------------|-------|--------|----------------------|----------------------|------------|------------|
| 区 分     | 銘 柄                                  | 種 類   | 年利率    | 額 面 金 額              | 評 価 額                |            | 償還年月日      |
|         |                                      |       |        |                      | 外 貨 建 金 額            | 邦貨換算金額     |            |
|         |                                      |       | %      | 千アメリカ・ドル             | 千アメリカ・ドル             | 千円         |            |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2.1250 | 3,000                | 2,977                | 333,575    | 2024/07/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2.7500 | 2,800                | 2,760                | 309,300    | 2047/08/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.6250 | 2,100                | 2,057                | 230,523    | 2022/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.2500 | 600                  | 594                  | 66,654     | 2019/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.8750 | 2,000                | 1,953                | 218,880    | 2024/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.3750 | 1,000                | 987                  | 110,661    | 2020/09/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.8750 | 2,500                | 2,475                | 277,410    | 2022/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.3750 | 1,000                | 993                  | 111,292    | 2019/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2.1250 | 3,400                | 3,371                | 377,724    | 2024/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1.6250 | 1,000                | 993                  | 111,318    | 2020/10/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2.0000 | 2,500                | 2,490                | 279,029    | 2022/10/31 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額                           | 244銘柄 |        | 626,026              | 632,164              | 70,834,003 |            |
| カナダ     | Canada Government International Bond | 国債証券  | 2.7500 | 千カナダ・ドル<br>325       | 千カナダ・ドル<br>377       | 32,851     | 2064/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 8.0000 | 386                  | 590                  | 51,468     | 2027/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5.7500 | 983                  | 1,363                | 118,775    | 2029/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5.7500 | 1,127                | 1,671                | 145,614    | 2033/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5.0000 | 1,112                | 1,608                | 140,066    | 2037/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3.7500 | 1,524                | 1,577                | 137,398    | 2019/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 4.0000 | 1,363                | 1,799                | 156,773    | 2041/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3.5000 | 1,876                | 1,969                | 171,541    | 2020/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3.2500 | 956                  | 1,011                | 88,105     | 2021/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2.7500 | 1,751                | 1,838                | 160,152    | 2022/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3.5000 | 1,561                | 1,965                | 171,169    | 2045/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.5000 | 1,253                | 1,241                | 108,156    | 2023/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2.5000 | 1,405                | 1,471                | 128,173    | 2024/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.7500 | 853                  | 857                  | 74,693     | 2019/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.7500 | 1,627                | 1,636                | 142,546    | 2019/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2.7500 | 1,197                | 1,335                | 116,279    | 2048/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2.2500 | 1,156                | 1,194                | 104,020    | 2025/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.5000 | 1,719                | 1,720                | 149,874    | 2020/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.7500 | 1,831                | 1,795                | 156,371    | 2020/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.5000 | 1,129                | 1,099                | 95,807     | 2026/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.7500 | 1,237                | 1,206                | 105,111    | 2021/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.7500 | 1,480                | 1,437                | 125,176    | 2021/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.0000 | 1,240                | 1,145                | 99,768     | 2027/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.5000 | 1,470                | 1,459                | 127,129    | 2018/11/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.5000 | 840                  | 802                  | 69,899     | 2022/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.5000 | 1,620                | 1,604                | 139,769    | 2019/02/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.7500 | 900                  | 892                  | 77,715     | 2019/05/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.0000 | 700                  | 680                  | 59,235     | 2022/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0.7500 | 1,360                | 1,345                | 117,171    | 2019/08/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.2500 | 500                  | 498                  | 43,401     | 2019/11/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2.0000 | 300                  | 301                  | 26,285     | 2028/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1.7500 | 600                  | 602                  | 52,473     | 2023/03/01 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額                           | 32銘柄  |        | 37,381               | 40,103               | 3,492,978  |            |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券  | 5.2500 | 千オーストラリア・ドル<br>2,455 | 千オーストラリア・ドル<br>2,566 | 217,823    | 2019/03/15 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券  | 5.7500 | 2,420                | 2,728                | 231,592    | 2021/05/15 |

## 外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分    |            | 銘 柄                        | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額              | 未                    |               | 償還年月日      |
|--------|------------|----------------------------|------|--------|----------------------|----------------------|---------------|------------|
|        |            |                            |      |        |                      | 評 価                  | 額             |            |
|        |            |                            |      |        |                      | 外 貨 建 金 額            | 邦貨換算金額        |            |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 千オーストラリア・ドル<br>2,409 | 千オーストラリア・ドル<br>2,560 | 千円<br>217,289 | 2020/04/15 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 2,162                | 2,513                | 213,293       | 2022/07/15 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,068                | 2,420                | 205,411       | 2023/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 2,589                | 3,091                | 262,366       | 2027/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,473                | 2,547                | 216,236       | 2024/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,314                | 1,403                | 119,109       | 2029/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,398                | 2,548                | 216,254       | 2025/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 1,358                | 1,655                | 140,512       | 2033/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,848                | 3,249                | 275,769       | 2026/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,011                | 2,049                | 173,919       | 2019/10/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 863                  | 964                  | 81,821        | 2037/04/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 557                  | 546                  | 46,366        | 2035/06/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,195                | 2,187                | 185,645       | 2020/11/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 712                  | 734                  | 62,330        | 2039/06/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,142                | 2,195                | 186,305       | 2027/11/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,978                | 1,931                | 163,937       | 2028/05/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 932                  | 891                  | 75,647        | 2047/03/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 700                  | 700                  | 59,413        | 2021/12/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,450                | 1,480                | 125,634       | 2028/11/21 |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 100                  | 100                  | 8,543         | 2022/11/21 |
| 通貨小計   | 銘柄数<br>金 額 | 22銘柄                       |      |        | 38,134               | 41,065               | 3,485,224     |            |
| シンガポール |            |                            |      |        | 千シンガポール・ドル           | 千シンガポール・ドル           |               |            |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.2500 | 696                  | 727                  | 60,552        | 2020/09/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.5000 | 772                  | 862                  | 71,716        | 2027/03/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.1250 | 438                  | 465                  | 38,732        | 2022/09/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.5000 | 599                  | 608                  | 50,613        | 2019/06/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.0000 | 503                  | 536                  | 44,627        | 2024/09/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 359                  | 380                  | 31,657        | 2030/09/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 495                  | 505                  | 42,031        | 2021/06/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 400                  | 413                  | 34,357        | 2042/04/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 491                  | 514                  | 42,815        | 2023/07/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.3750 | 368                  | 413                  | 34,391        | 2033/09/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 125                  | 133                  | 11,064        | 2029/07/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.6250 | 415                  | 416                  | 34,617        | 2019/10/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.3750 | 124                  | 127                  | 10,573        | 2025/06/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.0000 | 224                  | 226                  | 18,865        | 2020/07/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 318                  | 331                  | 27,569        | 2046/03/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.1250 | 250                  | 251                  | 20,932        | 2026/06/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.2500 | 190                  | 187                  | 15,572        | 2021/10/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.7500 | 200                  | 200                  | 16,670        | 2022/04/01 |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 150                  | 145                  | 12,142        | 2036/08/01 |
| 通貨小計   | 銘柄数<br>金 額 | 19銘柄                       |      |        | 7,117                | 7,446                | 619,502       |            |
| イギリス   |            |                            |      |        | 千イギリス・ポンド            | 千イギリス・ポンド            |               |            |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.0000 | 2,280                | 2,365                | 355,567       | 2020/07/22 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.0000 | 2,121                | 2,254                | 338,940       | 2025/09/07 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.5000 | 2,477                | 2,543                | 382,305       | 2021/01/22 |

# 外国債券インデックスマザーファンド

|       |                        | 当 期  |        |                       | 末                     |            |            |
|-------|------------------------|------|--------|-----------------------|-----------------------|------------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                    | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額               | 評 価 額                 |            | 償還年月日      |
|       |                        |      |        |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦貨換算金額     |            |
|       |                        |      | %      | 千イギリス・ポンド             | 千イギリス・ポンド             | 千円         |            |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.5000 | 460                   | 419                   | 63,031     | 2047/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 200                   | 195                   | 29,431     | 2037/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 600                   | 599                   | 90,107     | 2057/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.2500 | 510                   | 503                   | 75,728     | 2027/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 0.7500 | 500                   | 493                   | 74,211     | 2023/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 8.0000 | 1,102                 | 1,383                 | 208,037    | 2021/06/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 6.0000 | 949                   | 1,394                 | 209,657    | 2028/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,340                 | 1,786                 | 268,542    | 2032/06/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 5.0000 | 1,472                 | 1,873                 | 281,676    | 2025/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 2,032                 | 2,803                 | 421,457    | 2036/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,457                 | 2,188                 | 328,940    | 2038/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,724                 | 1,889                 | 283,994    | 2020/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,708                 | 2,878                 | 432,698    | 2055/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 2,086                 | 3,169                 | 476,434    | 2046/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,232                 | 1,565                 | 235,397    | 2027/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 1,596                 | 2,418                 | 363,584    | 2042/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,480                 | 2,033                 | 305,654    | 2030/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,523                 | 2,400                 | 360,875    | 2049/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 873                   | 917                   | 137,890    | 2019/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,246                 | 1,770                 | 266,225    | 2039/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.0000 | 1,382                 | 1,572                 | 236,384    | 2022/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 1,870                 | 2,612                 | 392,776    | 2034/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,428                 | 1,510                 | 227,012    | 2019/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.0000 | 1,244                 | 2,086                 | 313,672    | 2060/01/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,795                 | 1,952                 | 293,512    | 2020/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,577                 | 2,268                 | 341,073    | 2040/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,633                 | 1,820                 | 273,624    | 2021/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,352                 | 2,023                 | 304,157    | 2052/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 2,242                 | 2,338                 | 351,613    | 2022/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.2500 | 2,066                 | 2,626                 | 394,780    | 2044/01/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 2.2500 | 1,942                 | 2,083                 | 313,185    | 2023/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.5000 | 1,621                 | 2,610                 | 392,381    | 2068/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 2,251                 | 2,296                 | 345,204    | 2019/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 2.7500 | 1,842                 | 2,045                 | 307,500    | 2024/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.5000 | 2,124                 | 2,828                 | 425,149    | 2045/01/22 |
| 通貨小計  | 銘柄数                    | 41銘柄 |        |                       |                       |            |            |
|       | 金 額                    |      |        | 60,444                | 75,999                | 11,425,072 |            |
| スイス   | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 千スイス・フラン<br>404       | 千スイス・フラン<br>499       | 56,847     | 2023/02/11 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 497                   | 707                   | 80,495     | 2028/04/08 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0000 | 517                   | 546                   | 62,192     | 2019/05/12 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2500 | 407                   | 439                   | 49,990     | 2020/07/06 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.0000 | 362                   | 395                   | 44,985     | 2021/04/28 |
| 通貨小計  | 銘柄数                    | 5銘柄  |        |                       |                       |            |            |
|       | 金 額                    |      |        | 2,187                 | 2,587                 | 294,510    |            |
| デンマーク | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 千デンマーク・クローネ<br>11,512 | 千デンマーク・クローネ<br>19,533 | 348,480    | 2039/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 8,601                 | 9,387                 | 167,471    | 2019/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 8,050                 | 9,132                 | 162,929    | 2021/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 4,846                 | 5,302                 | 94,599     | 2023/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 8,363                 | 9,421                 | 168,079    | 2025/11/15 |

| 当 期           |      |                           |       | 未 期     |                       |                        |              |            |
|---------------|------|---------------------------|-------|---------|-----------------------|------------------------|--------------|------------|
| 区 分           |      | 銘 柄                       | 種 類   | 年利率     | 額 面 金 額               | 評 価 額                  |              | 償還年月日      |
|               |      |                           |       |         |                       | 外 貨 建 金 額              | 邦貨換算金額       |            |
|               |      | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券  | 0.2500  | 千デンマーク・クローネ<br>3,164  | 千デンマーク・クローネ<br>3,192   | 千円<br>56,956 | 2018/11/15 |
|               |      | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券  | 0.5000  | 2,600                 | 2,613                  | 46,620       | 2027/11/15 |
|               |      | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券  | 0.2500  | 1,500                 | 1,534                  | 27,371       | 2020/11/15 |
| 通貨小計          | 銘柄数  | 8銘柄                       |       |         |                       |                        |              |            |
|               | 金 額  |                           |       |         | 48,636                | 60,118                 | 1,072,508    |            |
| ノルウェー         |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 4.5000  | 千ノルウェー・クローネ<br>7,075  | 千ノルウェー・クローネ<br>7,491   | 101,727      | 2019/05/22 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 3.7500  | 6,998                 | 7,691                  | 104,457      | 2021/05/25 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 2.0000  | 5,224                 | 5,471                  | 74,296       | 2023/05/24 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 3.0000  | 4,095                 | 4,539                  | 61,651       | 2024/03/14 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 1.7500  | 3,395                 | 3,495                  | 47,475       | 2025/03/13 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 1.5000  | 3,340                 | 3,365                  | 45,709       | 2026/02/19 |
|               |      | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券  | 1.7500  | 2,450                 | 2,501                  | 33,970       | 2027/02/17 |
| 通貨小計          | 銘柄数  | 7銘柄                       |       |         |                       |                        |              |            |
|               | 金 額  |                           |       |         | 32,577                | 34,557                 | 469,287      |            |
| スウェーデン        |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 5.0000  | 千スウェーデン・クローネ<br>9,095 | 千スウェーデン・クローネ<br>10,614 | 142,025      | 2020/12/01 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 4.2500  | 8,385                 | 8,942                  | 119,649      | 2019/03/12 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 3.5000  | 4,155                 | 5,723                  | 76,575       | 2039/03/30 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 3.5000  | 8,465                 | 9,892                  | 132,365      | 2022/06/01 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 1.5000  | 7,025                 | 7,624                  | 102,009      | 2023/11/13 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 2.5000  | 5,095                 | 5,930                  | 79,353       | 2025/05/12 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 1.0000  | 5,680                 | 5,932                  | 79,371       | 2026/11/12 |
|               |      | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券  | 0.7500  | 2,950                 | 2,955                  | 39,543       | 2028/05/12 |
| 通貨小計          | 銘柄数  | 8銘柄                       |       |         |                       |                        |              |            |
|               | 金 額  |                           |       |         | 50,850                | 57,615                 | 770,894      |            |
| メキシコ          |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ<br>21,447    | 千メキシコ・ペソ<br>20,619     | 124,333      | 2019/12/11 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 5.7500  | 13,290                | 12,099                 | 72,959       | 2026/03/05 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.0000  | 4,000                 | 4,204                  | 25,352       | 2047/11/07 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.0000  | 10,633                | 11,084                 | 66,838       | 2023/12/07 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 10.0000 | 22,119                | 25,601                 | 154,377      | 2024/12/05 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 7.5000  | 10,668                | 10,846                 | 65,406       | 2027/06/03 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 10.0000 | 6,874                 | 8,599                  | 51,857       | 2036/11/20 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.5000  | 8,844                 | 9,655                  | 58,221       | 2029/05/31 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.5000  | 22,092                | 22,379                 | 134,947      | 2018/12/13 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.5000  | 9,694                 | 10,683                 | 64,423       | 2038/11/18 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 8.0000  | 18,928                | 19,343                 | 116,639      | 2020/06/11 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 6.5000  | 27,826                | 27,312                 | 164,691      | 2021/06/10 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 7.7500  | 13,015                | 13,437                 | 81,028       | 2031/05/29 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 6.5000  | 13,099                | 12,791                 | 77,131       | 2022/06/09 |
|               |      | Mexican Bonos             | 国債証券  | 7.7500  | 15,654                | 16,005                 | 96,510       | 2042/11/13 |
| Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500                    | 6,944 | 7,142   | 43,068                | 2034/11/23             |              |            |
| 通貨小計          | 銘柄数  | 16銘柄                      |       |         |                       |                        |              |            |
|               | 金 額  |                           |       |         | 225,127               | 231,806                | 1,397,790    |            |
| マレーシア         |      | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券  | 5.7340  | 千マレーシア・リンギット<br>647   | 千マレーシア・リンギット<br>673    | 18,467       | 2019/07/30 |
|               |      | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券  | 3.5020  | 573                   | 537                    | 14,738       | 2027/05/31 |
|               |      | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券  | 5.2480  | 738                   | 787                    | 21,605       | 2028/09/15 |
|               |      | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券  | 4.3780  | 1,603                 | 1,640                  | 44,985       | 2019/11/29 |
|               |      | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券  | 4.4980  | 1,178                 | 1,174                  | 32,196       | 2030/04/15 |

# 外国債券インデックスマザーファンド

|       |                          | 当 期  |          |              | 未 期          |          |            |
|-------|--------------------------|------|----------|--------------|--------------|----------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                      | 種 類  | 年利率      | 額 面 金 額      | 評 価 額        |          | 償還年月日      |
|       |                          |      |          |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額   |            |
|       |                          |      | %        | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円       |            |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1600  | 1, 916       | 1, 958       | 53, 702  | 2021/07/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 3920  | 1, 514       | 1, 533       | 42, 047  | 2026/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 2320  | 650          | 632          | 17, 339  | 2031/06/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4180  | 875          | 861          | 23, 610  | 2022/08/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8920  | 731          | 711          | 19, 513  | 2027/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1270  | 618          | 595          | 16, 315  | 2032/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4920  | 1, 044       | 1, 050       | 28, 805  | 2020/03/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4800  | 1, 001       | 982          | 26, 928  | 2023/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8440  | 477          | 444          | 12, 175  | 2033/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7330  | 586          | 558          | 15, 308  | 2028/06/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8890  | 656          | 664          | 18, 224  | 2020/07/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 9350  | 600          | 601          | 16, 494  | 2043/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1810  | 1, 057       | 1, 068       | 29, 300  | 2024/07/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 0480  | 857          | 869          | 23, 836  | 2021/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6540  | 648          | 654          | 17, 942  | 2019/10/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 9550  | 737          | 729          | 20, 002  | 2025/09/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6590  | 700          | 704          | 19, 328  | 2020/10/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7950  | 1, 161       | 1, 160       | 31, 826  | 2022/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 2540  | 820          | 789          | 21, 638  | 2035/05/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7590  | 768          | 776          | 21, 289  | 2019/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8000  | 702          | 697          | 19, 127  | 2023/08/17 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 7360  | 930          | 910          | 24, 957  | 2046/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 9000  | 650          | 637          | 17, 491  | 2026/11/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6200  | 352          | 352          | 9, 662   | 2021/11/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8820  | 500          | 504          | 13, 828  | 2022/03/10 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 0590  | 750          | 755          | 20, 721  | 2024/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8990  | 350          | 348          | 9, 549   | 2027/11/16 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 7620  | 500          | 507          | 13, 921  | 2037/04/07 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 33銘柄 |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 26, 889      | 26, 874      | 736, 885 |            |
| 南アフリカ |                          |      |          | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   |          |            |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 2, 978       | 2, 993       | 24, 543  | 2018/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 2500  | 5, 768       | 5, 682       | 46, 600  | 2020/01/15 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10. 5000 | 16, 434      | 17, 622      | 144, 501 | 2026/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 2500  | 7, 612       | 5, 229       | 42, 882  | 2036/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 7500  | 4, 622       | 4, 417       | 36, 225  | 2021/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 5000  | 8, 904       | 6, 007       | 49, 261  | 2041/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 0000  | 8, 999       | 7, 172       | 58, 817  | 2031/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 7500  | 5, 539       | 5, 340       | 43, 789  | 2023/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 13, 452      | 11, 553      | 94, 736  | 2048/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 5000  | 11, 021      | 9, 479       | 77, 733  | 2037/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 8, 862       | 7, 763       | 63, 664  | 2030/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 7, 944       | 6, 818       | 55, 909  | 2044/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 2500  | 8, 243       | 7, 191       | 58, 969  | 2032/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 8750  | 4, 166       | 3, 752       | 30, 774  | 2035/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 9. 0000  | 2, 179       | 1, 933       | 15, 856  | 2040/01/31 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 15銘柄 |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 116, 723     | 102, 959     | 844, 266 |            |
| ポーランド |                          |      |          | 千ポーランド・ズロチ   | 千ポーランド・ズロチ   |          |            |
|       | Poland Government Bond   | 国債証券 | 5. 7500  | 2, 309       | 2, 638       | 83, 369  | 2022/09/23 |
|       | Poland Government Bond   | 国債証券 | 5. 5000  | 1, 912       | 2, 053       | 64, 884  | 2019/10/25 |
|       | Poland Government Bond   | 国債証券 | 1. 5000  | 2, 478       | 2, 462       | 77, 803  | 2020/04/25 |
|       | Poland Government Bond   | 国債証券 | 2. 5000  | 3, 377       | 3, 192       | 100, 870 | 2026/07/25 |

|              |                             | 当 期  |        |             | 未 期         |           |            |
|--------------|-----------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
| 区 分          | 銘 柄                         | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額     | 評 価 額       |           | 償還年月日      |
|              |                             |      |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額    |            |
|              |                             |      | %      | 千ポーランド・ズロチ  | 千ポーランド・ズロチ  | 千円        |            |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.0000 | 2,127       | 2,115       | 66,843    | 2021/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 1.7500 | 3,051       | 2,999       | 94,782    | 2021/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 1,820       | 1,696       | 53,624    | 2027/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.2500 | 2,320       | 2,296       | 72,556    | 2022/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | —      | 400         | 392         | 12,392    | 2019/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 1,300       | 1,290       | 40,786    | 2023/01/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 827         | 1,033       | 32,674    | 2029/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.2500 | 2,256       | 2,466       | 77,948    | 2020/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 1,084       | 1,224       | 38,683    | 2021/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 4.0000 | 2,225       | 2,367       | 74,813    | 2023/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 1,840       | 1,893       | 59,841    | 2019/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 2,591       | 2,608       | 82,428    | 2025/07/25 |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額                  | 16銘柄 |        | 31,917      | 32,731      | 1,034,302 |            |
| ユーロ (アイルランド) | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.4000 | 千ユーロ<br>684 | 千ユーロ<br>737 | 97,905    | 2019/06/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.9000 | 570         | 640         | 85,009    | 2019/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.4000 | 1,131       | 1,535       | 203,928   | 2025/03/13 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.0000 | 765         | 888         | 117,952   | 2020/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.9000 | 504         | 607         | 80,719    | 2023/03/20 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.4000 | 607         | 728         | 96,725    | 2024/03/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.4000 | 761         | 879         | 116,747   | 2030/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.8000 | 516         | 538         | 71,507    | 2022/03/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.0000 | 681         | 717         | 95,225    | 2045/02/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.0000 | 1,073       | 1,107       | 147,127   | 2026/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.7000 | 350         | 360         | 47,942    | 2037/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | —      | 50          | 50          | 6,659     | 2022/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.5000 | 1,035       | 1,160       | 154,097   | 2020/04/18 |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額                  | 13銘柄 |        | 8,727       | 9,950       | 1,321,550 |            |
| ユーロ (オランダ)   | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.5000 | 千ユーロ<br>548 | 千ユーロ<br>765 | 101,731   | 2023/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,239       | 1,856       | 246,554   | 2028/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,355       | 2,083       | 276,648   | 2037/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 791         | 953         | 126,587   | 2023/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,347       | 1,450       | 192,668   | 2019/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 1,146       | 1,270       | 168,762   | 2020/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,349       | 2,112       | 280,576   | 2042/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,463       | 1,662       | 220,792   | 2021/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,438       | 1,609       | 213,694   | 2022/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,168       | 1,445       | 192,013   | 2033/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,385       | 1,531       | 203,406   | 2023/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 924         | 944         | 125,475   | 2019/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,084       | 1,490       | 197,915   | 2047/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,514       | 1,713       | 227,539   | 2024/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,374       | 1,400       | 185,949   | 2020/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,291       | 1,297       | 172,278   | 2025/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,338       | 1,357       | 180,258   | 2026/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,200       | 1,218       | 161,762   | 2022/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 900         | 921         | 122,425   | 2027/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 200         | 200         | 26,580    | 2024/01/15 |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額                  | 20銘柄 |        | 23,054      | 27,284      | 3,623,622 |            |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分        |            | 当 期                     |      |        | 未 期     |           |           |
|------------|------------|-------------------------|------|--------|---------|-----------|-----------|
|            |            | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |           |
|            |            |                         |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額    |
| ユーロ (ベルギー) |            |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円        |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.8000 | 1,399   | 1,453     | 193,015   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.0000 | 924     | 927       | 123,177   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.9000 | 558     | 614       | 81,666    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,283   | 1,344     | 178,512   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.6000 | 744     | 738       | 98,049    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.1500 | 190     | 204       | 27,220    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.2000 | 150     | 151       | 20,177    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.8000 | 1,000   | 1,018     | 135,278   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 650     | 664       | 88,289    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.2500 | 260     | 291       | 38,734    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.4500 | 300     | 307       | 40,815    |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 1,706   | 2,550     | 338,712   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.0000 | 1,704   | 2,751     | 365,485   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 1,377   | 1,637     | 217,481   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 821     | 871       | 115,748   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500 | 1,736   | 1,948     | 258,741   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,674   | 2,636     | 350,109   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,446   | 1,706     | 226,674   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,001   | 1,346     | 178,762   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,316   | 1,603     | 212,940   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 680     | 958       | 127,351   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 1,123   | 1,197     | 159,002   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.2500 | 1,338   | 1,514     | 201,152   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500 | 753     | 1,130     | 150,080   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.6000 | 1,505   | 1,752     | 232,723   |
|            |            | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 597     | 766       | 101,760   |
| 国 小 計      | 銘柄数<br>金 額 | 26銘柄                    |      |        | 26,235  | 32,088    | 4,261,666 |
| ユーロ (フランス) |            |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |           |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 8.5000 | 653     | 767       | 101,965   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 8.5000 | 985     | 1,446     | 192,112   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 6.0000 | 2,225   | 3,239     | 430,266   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 5.5000 | 2,623   | 3,994     | 530,494   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 5.7500 | 2,807   | 4,658     | 618,732   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.7500 | 2,709   | 4,254     | 565,056   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.2500 | 3,075   | 3,288     | 436,802   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 1,364   | 2,205     | 292,933   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.7500 | 3,230   | 3,694     | 490,624   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 2,824   | 4,216     | 560,014   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.2500 | 3,697   | 4,641     | 616,497   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.5000 | 2,734   | 4,426     | 587,932   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.7500 | 3,263   | 3,539     | 470,060   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.5000 | 3,380   | 3,712     | 493,087   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 1,167   | 1,936     | 257,221   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.5000 | 3,146   | 3,977     | 528,245   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000 | 3,113   | 3,386     | 449,786   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.2500 | 3,550   | 4,054     | 538,491   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0000 | 3,630   | 4,157     | 552,178   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.7500 | 3,499   | 4,227     | 561,443   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2500 | 2,694   | 3,016     | 400,653   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.2500 | 2,238   | 3,075     | 408,436   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.7500 | 3,347   | 3,686     | 489,580   |
|            |            | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 1,920   | 1,951     | 259,228   |

| 区 分       |                        | 当 期  |         |         | 未 評 価 額 |            |            | 償還年月日 |
|-----------|------------------------|------|---------|---------|---------|------------|------------|-------|
|           |                        | 銘 柄  | 種 類     | 年利率     | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額  |            |       |
|           |                        |      |         |         |         | 千ユーロ       | 千円         |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500% | 3,086   | 3,526   | 468,312    | 2024/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000  | 2,264   | 2,320   | 308,213    | 2019/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000  | 2,787   | 3,322   | 441,301    | 2030/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 2,799   | 3,112   | 413,332    | 2024/11/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000  | 2,322   | 2,374   | 315,363    | 2019/11/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000  | 2,792   | 2,848   | 378,262    | 2025/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 3,070   | 3,112   | 413,369    | 2020/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000  | 2,101   | 2,217   | 294,528    | 2025/11/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500  | 2,193   | 2,240   | 297,563    | 2020/11/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 2,720   | 2,902   | 385,442    | 2031/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 1,592   | 1,605   | 213,264    | 2019/02/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000  | 2,737   | 2,763   | 367,059    | 2026/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500  | 1,079   | 1,072   | 142,384    | 2036/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 587     | 572     | 76,097     | 2066/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 2,170   | 2,200   | 292,209    | 2021/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500  | 2,400   | 2,354   | 312,719    | 2026/11/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 2,000   | 2,021   | 268,422    | 2022/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 620     | 661     | 87,882     | 2039/06/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 700     | 709     | 94,167     | 2020/02/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000  | 2,500   | 2,602   | 345,661    | 2027/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000  | 1,000   | 1,077   | 143,045    | 2048/05/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —       | 500     | 502     | 66,683     | 2023/03/25 |       |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500  | 500     | 501     | 66,652     | 2028/05/25 |       |
| 国 小 計     | 銘柄数                    | 47銘柄 |         |         |         |            |            |       |
|           | 金 額                    |      |         | 108,392 | 128,181 | 17,023,784 |            |       |
| ユーロ (ドイツ) | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500  | 974     | 1,353   | 179,776    | 2024/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000  | 1,567   | 2,481   | 329,605    | 2027/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.6250  | 1,362   | 2,067   | 274,648    | 2028/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500  | 950     | 1,371   | 182,159    | 2028/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500  | 951     | 1,586   | 210,674    | 2030/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000  | 1,448   | 2,336   | 310,273    | 2031/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500  | 1,775   | 2,864   | 380,478    | 2034/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000  | 2,071   | 3,191   | 423,903    | 2037/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500  | 1,225   | 2,006   | 266,498    | 2039/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500  | 1,399   | 2,463   | 327,114    | 2040/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500  | 2,682   | 2,816   | 373,995    | 2019/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000  | 2,481   | 2,650   | 352,009    | 2019/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500  | 2,075   | 2,248   | 298,641    | 2020/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000  | 1,928   | 2,112   | 280,534    | 2020/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500  | 1,474   | 2,169   | 288,130    | 2042/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500  | 1,444   | 1,560   | 207,198    | 2020/09/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000  | 2,333   | 2,558   | 339,848    | 2021/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500  | 1,674   | 1,903   | 252,760    | 2021/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500  | 1,415   | 1,562   | 207,502    | 2021/09/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000  | 2,807   | 3,089   | 410,342    | 2022/01/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 2,222   | 2,439   | 324,003    | 2022/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000  | 1,728   | 2,272   | 301,777    | 2044/07/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 1,644   | 1,788   | 237,555    | 2022/09/04 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 1,410   | 1,540   | 204,531    | 2023/02/15 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 1,817   | 1,987   | 264,021    | 2023/05/15 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000  | 1,599   | 1,798   | 238,889    | 2023/08/15 |       |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 1,561   | 1,741   | 231,298    | 2024/02/15 |       |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分        |     | 当 期                     |      |        | 末       |           |            |
|------------|-----|-------------------------|------|--------|---------|-----------|------------|
|            |     | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |            |
|            |     |                         |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額     |
|            |     |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000 | 1,959   | 2,599     | 345,238    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.5000 | 1,594   | 1,756     | 233,250    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 1,542   | 1,649     | 219,046    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,194   | 2,268     | 301,216    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 2,134   | 2,283     | 303,303    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,168   | 2,229     | 296,037    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,850   | 2,793     | 370,964    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,600   | 1,591     | 211,399    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 700     | 707       | 93,949     |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.2500 | 300     | 302       | 40,159     |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 950     | 957       | 127,135    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,000   | 1,009     | 134,111    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 400     | 404       | 53,754     |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 100     | 101       | 13,453     |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 1,438   | 1,469     | 195,161    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 1,113   | 1,132     | 150,370    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,151   | 1,171     | 155,652    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,731   | 1,758     | 233,526    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,448   | 1,484     | 197,128    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,578   | 1,606     | 213,413    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,400   | 1,425     | 189,284    |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 360     | 366       | 48,612     |
|            |     | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 400     | 405       | 53,890     |
| 国 小 計      | 銘柄数 | 50銘柄                    |      |        |         |           |            |
|            | 金 額 |                         |      |        | 76,126  | 89,437    | 11,878,234 |
|            |     |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
| ユーロ (スペイン) |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 1,952   | 2,820     | 374,609    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 1,745   | 1,826     | 242,580    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 1,552   | 1,570     | 208,549    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1500 | 1,792   | 1,935     | 257,008    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.1500 | 1,250   | 1,293     | 171,778    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 1,733   | 1,835     | 243,794    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,672   | 1,683     | 223,643    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,747   | 1,793     | 238,162    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.9000 | 1,052   | 1,083     | 143,900    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.4500 | 550     | 598       | 79,501     |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3000 | 1,730   | 1,734     | 230,317    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4000 | 580     | 584       | 77,636     |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,800   | 1,818     | 241,532    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.3500 | 550     | 564       | 74,974     |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 1,300   | 1,295     | 172,038    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.0500 | 300     | 300       | 39,943     |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4500 | 300     | 301       | 40,007     |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,979   | 2,934     | 389,741    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2000 | 1,654   | 2,143     | 284,630    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.9000 | 1,608   | 2,279     | 302,736    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8000 | 1,682   | 2,102     | 279,174    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6000 | 2,382   | 2,577     | 342,367    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.3000 | 1,775   | 1,932     | 256,659    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7000 | 1,373   | 1,906     | 253,243    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,101   | 2,314     | 307,380    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6500 | 1,789   | 2,271     | 301,636    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8500 | 1,681   | 1,923     | 255,491    |

|            |                                   | 当 期  |        |         | 未 評 価 額   |             |            |
|------------|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| 区 分        | 銘 柄                               | 種 類  | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 償 還 年 月 日  |
|            |                                   |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.5000 | 2,515   | 2,986     | 396,685     | 2021/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.9000 | 1,965   | 2,718     | 361,080     | 2026/07/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.8500 | 1,978   | 2,447     | 325,054     | 2022/01/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.4000 | 2,608   | 3,270     | 434,401     | 2023/01/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 4.4000 | 1,601   | 1,954     | 259,613     | 2023/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.1500 | 1,270   | 1,716     | 228,023     | 2028/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.7500 | 1,254   | 1,301     | 172,887     | 2018/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.1500 | 1,049   | 1,543     | 205,057     | 2044/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7500 | 1,836   | 1,916     | 254,577     | 2019/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.8000 | 1,970   | 2,347     | 311,809     | 2024/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7500 | 2,097   | 2,366     | 314,245     | 2024/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4000 | 1,900   | 1,967     | 261,249     | 2020/01/31 |
| 国 小 計      | 銘柄数<br>金 額                        | 39銘柄 |        | 61,672  | 71,965    | 9,557,727   |            |
| ユーロ (イタリア) |                                   |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 9.0000 | 1,106   | 1,622     | 215,456     | 2023/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 7.2500 | 1,110   | 1,633     | 216,910     | 2026/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 6.5000 | 2,392   | 3,425     | 454,897     | 2027/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.5000 | 1,814   | 1,970     | 261,761     | 2024/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.0500 | 1,445   | 1,482     | 196,955     | 2019/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.2500 | 1,429   | 1,522     | 202,153     | 2046/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.3500 | 1,629   | 1,693     | 224,869     | 2022/04/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.5000 | 1,687   | 1,704     | 226,434     | 2025/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.6500 | 1,765   | 1,644     | 218,394     | 2032/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.7000 | 1,511   | 1,541     | 204,749     | 2020/05/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.0000 | 1,591   | 1,655     | 219,809     | 2025/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 1,504   | 1,568     | 208,365     | 2022/09/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.6500 | 774     | 788       | 104,775     | 2020/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7000 | 1,440   | 1,371     | 182,202     | 2047/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9500 | 2,359   | 2,388     | 317,265     | 2023/03/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.6000 | 1,286   | 1,290     | 171,343     | 2026/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.1000 | 812     | 817       | 108,506     | 2019/04/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.4500 | 1,674   | 1,693     | 224,898     | 2021/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.2500 | 924     | 884       | 117,507     | 2036/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.2500 | 1,568   | 1,520     | 201,919     | 2026/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.6500 | 700     | 690       | 91,730      | 2023/10/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3500 | 1,358   | 1,363     | 181,077     | 2021/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.8000 | 448     | 405       | 53,828      | 2067/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.0500 | 858     | 863       | 114,665     | 2019/10/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.4500 | 700     | 706       | 93,770      | 2033/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.2000 | 1,060   | 1,102     | 146,443     | 2027/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.8500 | 300     | 314       | 41,747      | 2024/05/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.2000 | 350     | 361       | 48,036      | 2022/04/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3500 | 120     | 121       | 16,116      | 2020/06/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.4500 | 600     | 650       | 86,385      | 2048/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.0500 | 1,000   | 1,023     | 135,917     | 2027/08/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9000 | 700     | 711       | 94,560      | 2022/08/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 550     | 558       | 74,130      | 2024/11/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.2000 | 100     | 100       | 13,357      | 2020/10/15 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,454   | 3,294     | 437,522     | 2029/11/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 6.0000 | 2,849   | 4,119     | 547,146     | 2031/05/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.7500 | 1,655   | 2,375     | 315,521     | 2033/02/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,074   | 2,187     | 290,498     | 2019/02/01 |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 当 期          |                         |                                   |        | 未 評 価 額 |         |           |            |            |
|--------------|-------------------------|-----------------------------------|--------|---------|---------|-----------|------------|------------|
| 区 分          |                         | 銘 柄                               | 種 類    | 年利率     | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額     | 償還年月日      |
|              |                         |                                   |        | %       | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |            |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000  | 1,921   | 2,118     | 281,355    | 2020/02/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000  | 2,498   | 3,379     | 448,833    | 2034/08/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.0000  | 2,790   | 3,396     | 451,136    | 2037/02/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500  | 2,734   | 3,088     | 410,175    | 2021/08/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000  | 1,734   | 2,380     | 316,198    | 2039/08/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500  | 2,251   | 2,745     | 364,647    | 2023/08/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000  | 2,708   | 2,873     | 381,613    | 2019/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.2500  | 2,531   | 2,734     | 363,127    | 2019/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000  | 2,118   | 2,665     | 353,994    | 2025/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000  | 2,043   | 2,784     | 369,788    | 2040/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.2500  | 2,560   | 2,817     | 374,179    | 2020/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.0000  | 2,214   | 2,461     | 326,915    | 2020/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000  | 2,070   | 2,552     | 338,975    | 2026/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500  | 2,144   | 2,399     | 318,623    | 2021/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500  | 2,281   | 2,667     | 354,278    | 2021/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000  | 2,012   | 2,404     | 319,339    | 2022/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.5000  | 1,657   | 2,044     | 271,533    | 2022/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.5000  | 1,910   | 2,365     | 314,151    | 2022/11/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500  | 1,810   | 2,308     | 306,528    | 2028/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000  | 1,894   | 2,270     | 301,543    | 2023/05/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500  | 1,363   | 1,821     | 241,882    | 2044/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000  | 2,194   | 2,655     | 352,710    | 2024/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.5000  | 2,111   | 2,194     | 291,399    | 2018/12/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500  | 1,729   | 1,942     | 257,964    | 2021/05/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 2.5000  | 1,100   | 1,144     | 152,019    | 2019/05/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500  | 2,201   | 2,570     | 341,347    | 2024/09/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.5000  | 1,938   | 2,230     | 296,271    | 2030/03/01 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 2.1500  | 1,593   | 1,710     | 227,143    | 2021/12/15 |
|              |                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 1.5000  | 1,246   | 1,284     | 170,544    | 2019/08/01 |
| 国 小 計        | 銘柄数                     | 67銘柄                              |        |         |         |           |            |            |
|              | 金 額                     |                                   |        |         | 107,051 | 123,182   | 16,359,857 |            |
|              |                         |                                   |        |         | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |            |
| ユーロ (フィンランド) | Finland Government Bond | 国債証券                              | 0.3750 | 432     | 443     | 58,854    | 2020/09/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 0.7500 | 414     | 410     | 54,535    | 2031/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 0.8750 | 279     | 292     | 38,812    | 2025/09/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 0.5000 | 411     | 416     | 55,296    | 2026/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | —      | 200     | 200     | 26,576    | 2023/09/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | —      | 270     | 273     | 36,293    | 2022/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 0.5000 | 300     | 298     | 39,664    | 2027/09/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 4.3750 | 416     | 449     | 59,734    | 2019/07/04 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 4.0000 | 667     | 857     | 113,846   | 2025/07/04 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 3.3750 | 632     | 691     | 91,892    | 2020/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 3.5000 | 459     | 520     | 69,149    | 2021/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 2.7500 | 389     | 476     | 63,246    | 2028/07/04 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 1.6250 | 612     | 666     | 88,529    | 2022/09/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 1.5000 | 446     | 484     | 64,327    | 2023/04/15 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 2.6250 | 407     | 539     | 71,660    | 2042/07/04 |            |
|              | Finland Government Bond | 国債証券                              | 2.0000 | 529     | 593     | 78,877    | 2024/04/15 |            |
| 国 小 計        | 銘柄数                     | 16銘柄                              |        |         |         |           |            |            |
|              | 金 額                     |                                   |        |         | 6,863   | 7,614     | 1,011,296  |            |
|              |                         |                                   |        |         | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |            |
| ユーロ (オーストリア) | Austria Government Bond | 国債証券                              | 0.2500 | 527     | 535     | 71,146    | 2019/10/18 |            |
|              | Austria Government Bond | 国債証券                              | 1.2000 | 873     | 936     | 124,418   | 2025/10/20 |            |

| 区 分   |     | 当 期                     |      |         | 未 期     |           |             |
|-------|-----|-------------------------|------|---------|---------|-----------|-------------|
|       |     | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             |
|       |     |                         |      |         |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500% | 千ユーロ926 | 千ユーロ950   | 千円126,301   |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000  | 734     | 737       | 97,998      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000  | 150     | 131       | 17,529      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —       | 300     | 301       | 39,980      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.5000  | 380     | 378       | 50,326      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.1000  | 170     | 180       | 23,991      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —       | 400     | 404       | 53,748      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 6.2500  | 825     | 1,280     | 170,103     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.9000  | 1,248   | 1,394     | 185,142     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.5000  | 1,337   | 1,538     | 204,313     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.1500  | 1,073   | 1,637     | 217,465     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.3500  | 989     | 1,052     | 139,844     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.8500  | 875     | 1,206     | 160,179     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.6500  | 797     | 936       | 124,393     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.4000  | 872     | 1,030     | 136,907     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.8000  | 318     | 536       | 71,245      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.9500  | 738     | 767       | 101,978     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.1500  | 623     | 870       | 115,608     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.7500  | 959     | 1,061     | 141,037     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.4000  | 621     | 748       | 99,427      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.6500  | 932     | 1,030     | 136,914     |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 23銘柄                    |      |         |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |         | 16,667  | 19,652    | 2,610,004   |
| 通貨小計  | 銘柄数 | 301銘柄                   |      |         |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |         | 434,787 | 509,357   | 67,647,744  |
| 合 計   | 銘柄数 | 767銘柄                   |      |         |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |         |         |           | 164,124,972 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末         |       |
|--------------|---------------|-------|
|              | 評 価 額         | 比 率   |
| 公社債          | 千円164,124,972 | %98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 2,713,114     | 1.6   |
| 投資信託財産総額     | 166,838,087   | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。  
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1メキシコ・ペソ＝6.03円、1マレーシア・リンギット＝27.42円、1南アフリカ・ランド＝8.20円、1ポーランド・ズロチ＝31.60円、1ユーロ＝132.81円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産（165,668,822千円）の投資信託財産総額（166,838,087千円）に対する比率は、99.3%です。

外国債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A)資産          | 167,865,673,143円 |
| コール・ローン等       | 1,410,795,637    |
| 公社債（評価額）       | 164,124,972,994  |
| 未収入金           | 1,033,909,250    |
| 未収利息           | 1,273,446,527    |
| 前払費用           | 22,548,735       |
| (B)負債          | 1,144,611,298    |
| 未払金            | 1,037,447,242    |
| 未払解約金          | 107,164,056      |
| (C)純資産総額（A－B）  | 166,721,061,845  |
| 元本             | 59,383,778,765   |
| 次期繰越損益金        | 107,337,283,080  |
| (D)受益権総口数      | 59,383,778,765口  |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 28,075円          |

\*期首における元本額は59,006,131,580円、当期中における追加設定元本額は6,421,510,499円、同解約元本額は6,043,863,314円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 938,947,637円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）31,434,341円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）236,831,181円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）64,229,316円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）766,547,584円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）248,867,657円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）525,569,264円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）400,023,699円、D－I's 外国債券インデックス880,097円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 22,820円、iFree 外国債券インデックス575,119,716円、iFree 8資産バランス245,604,315円、D Cダイワ外国債券インデックス40,005,557,043円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 631,956,912円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 299,143,351円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 190,473,853円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）268,358,922円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）217,548,839円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）67,378,321円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 11,337,304円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 17,901,368円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 1,288,876円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 497,823,550円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 166,073,932円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 6,394,036,947円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 359,421,809円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 142,269,988円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）353,656,108円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券126,558,233円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド21,849,007円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）374,472円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,466,036,292円、ダイワライフスタイル2 5 34,455,585円、ダイワライフスタイル5 0 59,697,716円、ダイワライフスタイル7 5 16,502,710円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は28,075円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | 3,993,795,740円   |
| 受取利息             | 3,995,331,764    |
| その他収益金           | 78,462           |
| 支払利息             | △ 1,614,486      |
| (B) 有価証券売買損益     | 6,841,179,885    |
| 売買益              | 9,157,968,240    |
| 売買損              | △ 2,316,788,355  |
| (C) その他費用        | △ 41,127,747     |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C） | 10,793,847,878   |
| (E) 前期繰越損益金      | 95,970,997,679   |
| (F) 解約差損益金       | △ 10,392,944,222 |
| (G) 追加信託差損益金     | 10,965,381,745   |
| (H) 合計（D＋E＋F＋G）  | 107,337,283,080  |
| 次期繰越損益金（H）       | 107,337,283,080  |

（注1）解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

（注2）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。