

# iFree 外国債券インデックス

## 運用報告書(全体版) 第 5 期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月 3 日～2020年11月30日)

### ★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FTSE 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います。                                                                   |                        |  |
| 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 |  |
|        | 外国債券インデックスマザーファンド                                                                                                                | 外国の公社債                 |  |
| 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、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 |                        |  |

### 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。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果を FTSE 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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
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）  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額 |            |            | FTSE 世界国債インデックス<br>(除く日本、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 |
|---------------------|---------|------------|------------|--------------------------------------|------------|---------------|-------------|------------|
|                     | (分配落)   | 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        |
| 1 期末 (2016年11月30日)  | 10,317  | 0          | 3.2        | 10,267                               | 2.7        | 98.1          | —           | 187        |
| 2 期末 (2017年11月30日)  | 11,005  | 0          | 6.7        | 10,933                               | 6.5        | 98.3          | —           | 1,616      |
| 3 期末 (2018年11月30日)  | 10,796  | 0          | △ 1.9      | 10,747                               | △ 1.7      | 98.2          | —           | 1,372      |
| 4 期末 (2019年12月 2 日) | 11,245  | 0          | 4.2        | 11,225                               | 4.5        | 98.3          | —           | 1,730      |
| 5 期末 (2020年11月30日)  | 11,728  | 0          | 4.3        | 11,748                               | 4.7        | 98.4          | —           | 2,085      |

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- (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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 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 6) 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 7) 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。

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

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

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

### 基準価額・騰落率

期首：11,245円

期末：11,728円（分配金 0 円）

騰落率：4.3%（分配金込み）

### 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、為替市場で米ドルなどが下落（円高）したものの債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したため、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。

| 年 月 日             | 基 準 価 額 |       | FTSE 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) 2019年12月 2 日 | 円       | %     |                                      | %     | %             | %           |
|                   | 11, 245 | —     | 11, 225                              | —     | 98. 3         | —           |
| 12月末              | 11, 280 | 0. 3  | 11, 263                              | 0. 3  | 98. 1         | —           |
| 2020年 1 月末        | 11, 368 | 1. 1  | 11, 323                              | 0. 9  | 98. 2         | —           |
| 2 月末              | 11, 500 | 2. 3  | 11, 548                              | 2. 9  | 98. 1         | —           |
| 3 月末              | 11, 515 | 2. 4  | 11, 448                              | 2. 0  | 98. 2         | —           |
| 4 月末              | 11, 293 | 0. 4  | 11, 264                              | 0. 3  | 98. 1         | —           |
| 5 月末              | 11, 456 | 1. 9  | 11, 459                              | 2. 1  | 97. 8         | —           |
| 6 月末              | 11, 636 | 3. 5  | 11, 644                              | 3. 7  | 98. 1         | —           |
| 7 月末              | 11, 750 | 4. 5  | 11, 771                              | 4. 9  | 97. 9         | —           |
| 8 月末              | 11, 735 | 4. 4  | 11, 735                              | 4. 5  | 98. 2         | —           |
| 9 月末              | 11, 788 | 4. 8  | 11, 788                              | 5. 0  | 98. 0         | —           |
| 10月末              | 11, 611 | 3. 3  | 11, 625                              | 3. 6  | 98. 0         | —           |
| (期末) 2020年11月30日  | 11, 728 | 4. 3  | 11, 748                              | 4. 7  | 98. 4         | —           |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2019. 12. 3 ~ 2020. 11. 30)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し民主党が上下院を制した場合の拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。

### ■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると米ドルなどが下落しました。

対円為替相場は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2020年に入ってから、新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まったことなどから円高が進みました。5月以降は、経済活動の再開期待などからユーロを中心に上昇しました。7月には、米中関係の悪化や追加経済対策をめぐる不透明感から米ドルを中心に下落傾向となりました。10月以降は、感染再拡大に対する懸念や米国大統領および連邦議会選挙に対する不透明感などから、米ドルなどが下落しました。

## 前作成期末における「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（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））に極力近づけ、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

(2019. 12. 3 ~ 2020. 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。

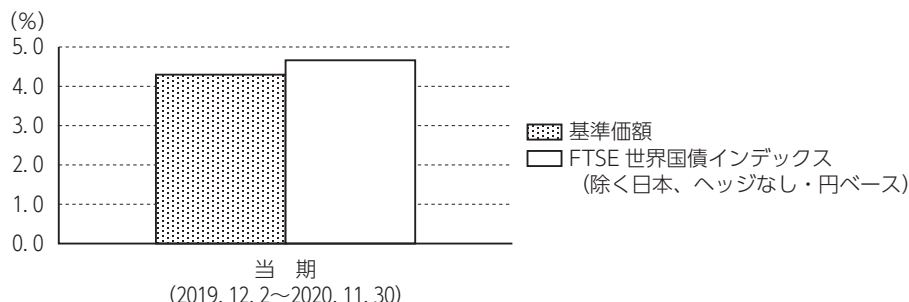
### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

当作成期のベンチマーク（FTSE 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4.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.3%となりました。

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。また、当作成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0.2%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。



## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、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（1万口当り）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2019年12月3日<br>～2020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) | 1,728                      |

(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>(2019. 12. 3～2020. 11. 30) |          | 項 目 の 概 要                                                               |
|-----------|-----------------------------------|----------|-------------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                               | 比 率      |                                                                         |
| 信 託 報 酬   | 23円                               | 0. 197%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は11, 522円です。                     |
| (投 信 会 社) | (10)                              | (0. 087) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価                       |
| (販 売 会 社) | (10)                              | (0. 087) | 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 会 社) | (3)                               | (0. 022) | 受託会社分は、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＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数<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＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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 | 3                                 | 0. 024   | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数                                         |
| (保 管 費 用) | (2)                               | (0. 016) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| (監 査 費 用) | (1)                               | (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                                             |
| (そ の 他)   | (0)                               | (0. 000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                      |
| 合 計       | 26                                | 0. 221   |                                                                         |

(注 1) 当作成期中の費用（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。

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

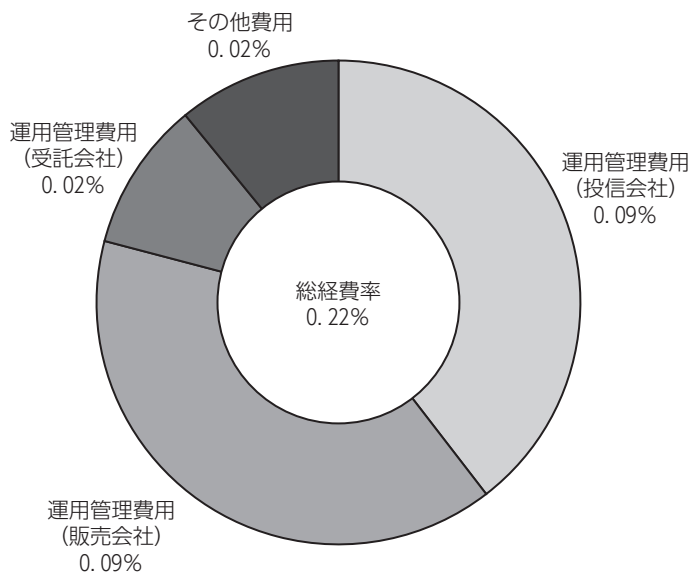
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## 参考情報

## ■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.22%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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

(2019年12月3日から2020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 | 117, 198 | 346, 710 | 25, 241 | 74, 267 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成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 | 600, 033 | 691, 990 | 2, 083, 306 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020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 | 2, 083, 306 | 99. 8  |
| コール・ローン等、その他          | 4, 057      | 0. 2   |
| 投資信託財産総額              | 2, 087, 363 | 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=103. 89円、1カナダ・ドル=79. 95円、1オーストラリア・ドル=76. 91円、1シンガポール・ドル=77. 69円、1イギリス・ポンド=138. 55円、1イスラエル・シェケル=31. 34円、1デンマーク・クローネ=16. 71円、1ノルウェー・クローネ=11. 76円、1スウェーデン・クローネ=12. 22円、1メキシコ・ペソ=5. 19円、1マレーシア・リンギット=25. 53円、1ポーランド・ズロチ=27. 71円、1ユーロ=124. 38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(217, 489, 673千円)の投資信託財産総額(218, 909, 428千円)に対する比率は、99. 4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

| 項 目                        | 当 期 末             |
|----------------------------|-------------------|
| (A) 資産                     | 2, 087, 363, 453円 |
| コール・ローン等                   | 4, 057, 228       |
| 外国債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 2, 083, 306, 225  |
| (B) 負債                     | 2, 060, 317       |
| 未払解約金                      | 62, 765           |
| 未払信託報酬                     | 1, 917, 734       |
| その他未払費用                    | 79, 818           |
| (C) 純資産総額(A－B)             | 2, 085, 303, 136  |
| 元本                         | 1, 778, 053, 858  |
| 次期繰越損益金                    | 307, 249, 278     |
| (D) 受益権総口数                 | 1, 778, 053, 858口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)             | 11, 728円          |

\* 期首における元本額は1, 538, 567, 924円、当作成期間中における追加設定元本額は359, 903, 793円、同解約元本額は120, 417, 859円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11, 728円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | △ 1, 110円        |
| 受取利息             | 34               |
| 支払利息             | △ 1, 144         |
| (B) 有価証券売買損益     | 79, 576, 187     |
| 売買益              | 82, 429, 709     |
| 売買損              | △ 2, 853, 522    |
| (C) 信託報酬等        | △ 3, 875, 966    |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 75, 699, 111     |
| (E) 前期繰越損益金      | 83, 573, 204     |
| (F) 追加信託差損益金     | 147, 976, 963    |
| (配当等相当額)         | ( 117, 399, 613) |
| (売買損益相当額)        | ( 30, 577, 350)  |
| (G) 合計(D＋E＋F)    | 307, 249, 278    |
| 次期繰越損益金(G)       | 307, 249, 278    |
| 追加信託差損益金         | 147, 976, 963    |
| (配当等相当額)         | ( 117, 399, 613) |
| (売買損益相当額)        | ( 30, 577, 350)  |
| 分配準備積立金          | 159, 273, 425    |
| 繰越損益金            | △ 1, 110         |

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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        | 75,698,814     |
| (c) 収益調整金                  | 147,976,963    |
| (d) 分配準備積立金                | 83,574,611     |
| (e) 当期分配対象額（a + b + c + d） | 307,250,388    |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e - f）       | 307,250,388    |
| (h) 受益権総口数                 | 1,778,053,858口 |

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第21期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

外国債券インデックスマザーファンドの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。

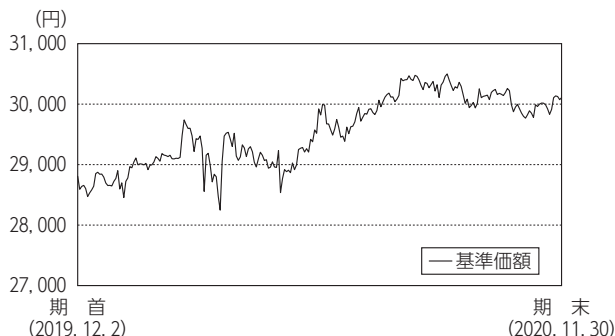
|        |                                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 |
| 主要投資対象 | 外国の公社債                                                                 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下                                                            |

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



| 年 月 日            | 基 準 価 額 |     | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |     | 公 社 債 | 債 券  |
|------------------|---------|-----|-------------------------------------|-----|-------|------|
|                  | 円       | 騰落率 | (ベンチマーク)                            | 騰落率 | 組入比率  | 先物比率 |
| (期首) 2019年12月2日  | 28,807  | —   | 29,079                              | —   | 98.4  | —    |
| 12月末             | 28,900  | 0.3 | 29,177                              | 0.3 | 98.2  | —    |
| 2020年1月末         | 29,132  | 1.1 | 29,333                              | 0.9 | 98.3  | —    |
| 2月末              | 29,474  | 2.3 | 29,916                              | 2.9 | 98.2  | —    |
| 3月末              | 29,517  | 2.5 | 29,656                              | 2.0 | 98.3  | —    |
| 4月末              | 28,953  | 0.5 | 29,181                              | 0.3 | 98.2  | —    |
| 5月末              | 29,377  | 2.0 | 29,685                              | 2.1 | 97.9  | —    |
| 6月末              | 29,845  | 3.6 | 30,164                              | 3.7 | 98.2  | —    |
| 7月末              | 30,143  | 4.6 | 30,493                              | 4.9 | 98.0  | —    |
| 8月末              | 30,109  | 4.5 | 30,401                              | 4.5 | 98.3  | —    |
| 9月末              | 30,250  | 5.0 | 30,538                              | 5.0 | 98.1  | —    |
| 10月末             | 29,799  | 3.4 | 30,116                              | 3.6 | 98.1  | —    |
| (期末) 2020年11月30日 | 30,106  | 4.5 | 30,435                              | 4.7 | 98.5  | —    |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

(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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(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：28,807円 期末：30,106円 騰落率：4.5%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、為替市場で米ドルなどが下落(円高)したものの債券市場で金利が低下(債券価格は上昇)したため、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外債券市場

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し民主党が上下院を制したものの拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると米ドルなどが下落しました。

対円為替相場は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2020年に入ってから、新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まったことなどから円高が進みました。5月以降は、経済活動の再開期待などからユーロを中心に上昇しました。7月には、米中関係の悪化や追加経済対策をめぐる不透明感から米ドルを中心に下落傾向となりました。10月以降は、感染再拡大に対する懸念や米大統領および連邦議会選挙に対する不透明感などから、米ドルなどが下落しました。

◆前作成期末における「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(FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース))に極力近づけ、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

当作成期におきましては、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

当作成期のベンチマークの騰落率は4.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.5%となりました。

当作成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0.2%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。

外国債券インデックスマザーファンド

■ 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) | 5<br>( 5) |
| (その他)           | ( 0)      |
| 合 計             | 5         |

(注 1) 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) 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

(2019年12月 3 日から2020年11月30日まで)

|     |         |      | 買 付 額                            | 売 付 額                            |
|-----|---------|------|----------------------------------|----------------------------------|
|     |         |      | 千アメリカ・ドル                         | 千アメリカ・ドル                         |
| 外 国 | アメリカ    | 国債証券 | 244, 186<br>( — )                | 221, 904<br>( — )                |
|     | カナダ     | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>18, 392<br>( — )      | 千カナダ・ドル<br>9, 377<br>( — )       |
|     | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>31, 353<br>( — )  | 千オーストラリア・ドル<br>5, 400<br>( — )   |
|     | シンガポール  | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>3, 085<br>( — )    | 千シンガポール・ドル<br>1, 151<br>( — )    |
|     | イギリス    | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>26, 395<br>( — )    | 千イギリス・ポンド<br>11, 406<br>( — )    |
|     | イスラエル   | 国債証券 | 千イスラエル・シェケル<br>30, 447<br>( — )  | 千イスラエル・シェケル<br>544<br>( — )      |
|     | デンマーク   | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ<br>16, 467<br>( — )  | 千デンマーク・クローネ<br>2, 271<br>( — )   |
|     | ノルウェー   | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>10, 993<br>( — )  | 千ノルウェー・クローネ<br>7, 241<br>( — )   |
|     | スウェーデン  | 国債証券 | 千スウェーデン・クローネ<br>14, 305<br>( — ) | 千スウェーデン・クローネ<br>11, 290<br>( — ) |
|     | メキシコ    | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>81, 550<br>( — )     | 千メキシコ・ペソ<br>32, 935<br>( — )     |
| 外 国 | マレーシア   | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>13, 203<br>( — ) | 千マレーシア・リンギット<br>5, 100<br>( — )  |

|     |                 |      | 買 付 額                          | 売 付 額                           |
|-----|-----------------|------|--------------------------------|---------------------------------|
| 外 国 | 南アフリカ           | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド<br>7, 914<br>( — )  | 千南アフリカ・ランド<br>137, 657<br>( — ) |
|     | ポーランド           | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>18, 643<br>( — ) | 千ポーランド・ズロチ<br>8, 566<br>( — )   |
|     | ユーロ<br>(アイルランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>4, 308<br>( — )        | 千ユーロ<br>849<br>( — )            |
|     | ユーロ<br>(オランダ)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>7, 400<br>( — )        | 千ユーロ<br>2, 393<br>( — )         |
|     | ユーロ<br>(ベルギー)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>10, 174<br>( — )       | 千ユーロ<br>3, 003<br>( — )         |
|     | ユーロ<br>(フランス)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>50, 275<br>( — )       | 千ユーロ<br>21, 351<br>( — )        |
|     | ユーロ<br>(ドイツ)    | 国債証券 | 千ユーロ<br>49, 813<br>( — )       | 千ユーロ<br>15, 873<br>( — )        |
|     | ユーロ<br>(スペイン)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>29, 263<br>( — )       | 千ユーロ<br>10, 586<br>( — )        |
|     | ユーロ<br>(イタリア)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>43, 888<br>( — )       | 千ユーロ<br>22, 171<br>( — )        |
|     | ユーロ<br>(フィンランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>2, 826<br>( — )        | 千ユーロ<br>626<br>( — )            |
| 外 国 | ユーロ<br>(オーストリア) | 国債証券 | 千ユーロ<br>6, 786<br>( — )        | 千ユーロ<br>2, 319<br>( — )         |
|     | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 国債証券 | 千ユーロ<br>204, 737<br>( — )      | 千ユーロ<br>79, 175<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。

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

| 当                                                        |           | 期                                                        |         |
|----------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------------------------------|---------|
| 買                                                        |           | 売                                                        |         |
| 付                                                        |           | 付                                                        |         |
| 銘 柄                                                      | 金 額       | 銘 柄                                                      | 金 額     |
|                                                          | 千円        |                                                          | 千円      |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15  | 1,400,722 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30  | 869,839 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/8/15 | 1,039,310 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2024/5/31     | 573,867 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/5/15 | 831,431   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/6/15 | 542,018 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2050/8/15 | 786,370   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30   | 536,388 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/6/30  | 783,138   | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.25% 2021/10/25           | 535,670 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/9/30  | 679,021   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2021/6/30 | 505,631 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2050/2/15     | 664,353   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2021/7/31  | 504,550 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2027/4/30   | 608,726   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15 | 454,267 |
| GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14                   | 608,569   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2045/11/15    | 445,066 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/8/15 | 601,899   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2020/12/31  | 441,566 |

(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>比率 | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|         |                        | 外 貨 建 金 額              | 邦貨換算金額     |      |                     |           |      |      |
|         |                        | 千円                     | 千円         | %    | %                   | %         | %    | %    |
| アメリカ    | 千アメリカ・ドル<br>820,457    | 千アメリカ・ドル<br>897,323    | 93,222,970 | 42.6 | —                   | 18.7      | 16.0 | 7.9  |
| カナダ     | 千カナダ・ドル<br>48,203      | 千カナダ・ドル<br>54,207      | 4,333,924  | 2.0  | —                   | 0.9       | 0.7  | 0.4  |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>67,164  | 千オーストラリア・ドル<br>75,437  | 5,801,880  | 2.7  | —                   | 1.8       | 0.6  | 0.2  |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>10,378   | 千シンガポール・ドル<br>11,857   | 921,200    | 0.4  | —                   | 0.3       | 0.1  | 0.0  |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>78,966    | 千イギリス・ポンド<br>104,078   | 14,420,010 | 6.6  | —                   | 5.1       | 1.1  | 0.4  |
| イスラエル   | 千イスラエル・シェケル<br>25,400  | 千イスラエル・シェケル<br>29,484  | 924,033    | 0.4  | —                   | 0.2       | 0.2  | 0.0  |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>56,061  | 千デンマーク・クローネ<br>71,697  | 1,198,067  | 0.5  | —                   | 0.4       | 0.1  | 0.1  |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>36,634  | 千ノルウェー・クローネ<br>38,933  | 457,858    | 0.2  | —                   | 0.1       | 0.1  | —    |
| スウェーデン  | 千スウェーデン・クローネ<br>50,870 | 千スウェーデン・クローネ<br>56,926 | 695,644    | 0.3  | —                   | 0.2       | 0.1  | 0.1  |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>307,034    | 千メキシコ・ペソ<br>342,802    | 1,779,145  | 0.8  | —                   | 0.4       | 0.2  | 0.1  |
| マレーシア   | 千マレーシア・リンギット<br>39,094 | 千マレーシア・リンギット<br>42,024 | 1,072,884  | 0.5  | —                   | 0.3       | 0.1  | 0.0  |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>45,329   | 千ポーランド・ズロチ<br>49,569   | 1,373,582  | 0.6  | —                   | 0.3       | 0.3  | 0.1  |

外国債券インデックスマザーファンド

| 作成期         |        | 当 期             |                 |                 |          | 末                  |           |          |          |
|-------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|----------|--------------------|-----------|----------|----------|
| 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年末満     |
| ユ<br>ー<br>ロ | アイルランド | 千ユーロ<br>11,943  | 千ユーロ<br>13,978  | 千円<br>1,738,620 | %<br>0.8 | %<br>—             | %<br>0.6  | %<br>0.2 | %<br>0.1 |
|             | オランダ   | 千ユーロ<br>27,805  | 千ユーロ<br>34,178  | 4,251,147       | 1.9      | —                  | 1.3       | 0.5      | 0.2      |
|             | ベルギー   | 千ユーロ<br>35,009  | 千ユーロ<br>44,357  | 5,517,247       | 2.5      | —                  | 2.0       | 0.4      | 0.1      |
|             | フランス   | 千ユーロ<br>148,837 | 千ユーロ<br>183,176 | 22,783,533      | 10.4     | —                  | 7.0       | 2.6      | 0.7      |
|             | ドイツ    | 千ユーロ<br>107,345 | 千ユーロ<br>130,943 | 16,286,782      | 7.4      | —                  | 4.8       | 2.1      | 0.6      |
|             | スペイン   | 千ユーロ<br>86,979  | 千ユーロ<br>106,965 | 13,304,319      | 6.1      | —                  | 4.1       | 1.6      | 0.4      |
|             | イタリア   | 千ユーロ<br>139,894 | 千ユーロ<br>167,518 | 20,835,981      | 9.5      | —                  | 6.0       | 2.5      | 1.1      |
|             | フィンランド | 千ユーロ<br>9,664   | 千ユーロ<br>10,842  | 1,348,586       | 0.6      | —                  | 0.4       | 0.1      | 0.1      |
|             | オーストリア | 千ユーロ<br>21,268  | 千ユーロ<br>26,576  | 3,305,593       | 1.5      | —                  | 1.0       | 0.4      | 0.1      |
|             | 小計     | 588,744         | 718,538         | 89,371,812      | 40.8     | —                  | 27.2      | 10.3     | 3.4      |
| 合 計         |        | —               | —               | 215,573,016     | 98.5     | —                  | 56.0      | 29.8     | 12.7     |

(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 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       |            |
| アメリカ  | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 2, 153   | 2, 191    | 227, 701 | 2021/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 3, 224   | 3, 297    | 342, 567 | 2022/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 2, 459   | 2, 516    | 261, 402 | 2022/05/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 2, 543   | 2, 606    | 270, 826 | 2022/08/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 6, 668   | 6, 858    | 712, 571 | 2022/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 4, 350   | 4, 526    | 470, 206 | 2023/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 4, 685   | 4, 865    | 505, 468 | 2023/05/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 4, 568   | 4, 854    | 504, 377 | 2023/08/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 5, 021   | 5, 398    | 560, 874 | 2023/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 5, 229   | 5, 654    | 587, 417 | 2024/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 4, 912   | 5, 296    | 550, 254 | 2024/05/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8. 0000 | 2, 106   | 2, 265    | 235, 372 | 2021/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 2500 | 654      | 761       | 79, 098  | 2023/08/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 0000 | 855      | 1, 102    | 114, 494 | 2026/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 1250 | 709      | 977       | 101, 589 | 2027/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 5000 | 700      | 955       | 99, 317  | 2028/08/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 738      | 1, 000    | 103, 960 | 2028/11/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 473      | 645       | 67, 091  | 2029/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 2500 | 714      | 1, 072    | 111, 398 | 2030/05/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 3750 | 2, 391   | 3, 466    | 360, 101 | 2031/02/15 |
|       | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 1, 176   | 1, 748    | 181, 685 | 2036/02/15 |

| 当 期 |                                  |      |        | 未 価 額    |           |         | 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 | 5.0000 | 847      | 1,346     | 139,836 | 2037/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 548      | 826       | 85,828  | 2038/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 519      | 795       | 82,622  | 2038/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 1,049    | 1,445     | 150,197 | 2039/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,121    | 1,687     | 175,364 | 2039/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,060    | 1,645     | 170,940 | 2039/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,210    | 1,856     | 192,901 | 2039/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.6250 | 1,010    | 1,597     | 166,008 | 2040/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,678    | 2,586     | 268,750 | 2040/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.8750 | 1,091    | 1,586     | 164,835 | 2040/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,469    | 2,241     | 232,831 | 2040/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.7500 | 1,254    | 2,033     | 211,264 | 2041/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,365    | 2,122     | 220,524 | 2041/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 1,517    | 2,185     | 227,079 | 2041/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,450    | 1,924     | 199,927 | 2041/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,623    | 2,158     | 224,294 | 2042/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 1,353    | 1,765     | 183,412 | 2042/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,231    | 2,805     | 291,424 | 2042/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,630    | 2,048     | 212,866 | 2042/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,626    | 3,496     | 363,204 | 2043/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 2,298    | 2,947     | 306,163 | 2043/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,214    | 4,603     | 478,235 | 2043/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 2,081    | 3,036     | 315,441 | 2043/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,307    | 4,747     | 493,255 | 2044/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 3,327    | 4,615     | 479,467 | 2044/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 6,162    | 6,645     | 690,378 | 2044/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,929    | 2,579     | 267,959 | 2044/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,163    | 2,200     | 228,628 | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,921    | 6,377     | 662,608 | 2024/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,846    | 5,047     | 524,423 | 2044/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,886    | 2,936     | 305,094 | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,169    | 3,238     | 336,440 | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,527    | 2,567     | 266,733 | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,743    | 6,152     | 639,150 | 2025/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 2,563    | 3,099     | 322,019 | 2045/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,809    | 3,885     | 403,690 | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,891    | 2,953     | 306,797 | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 5,788    | 6,250     | 649,372 | 2025/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,835    | 3,727     | 387,280 | 2045/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,612    | 2,671     | 277,550 | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 1,326    | 1,360     | 141,309 | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,821    | 2,908     | 302,161 | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 4,179    | 4,307     | 447,550 | 2022/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,743    | 6,189     | 643,017 | 2025/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,373    | 4,351     | 452,095 | 2045/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,445    | 2,518     | 261,631 | 2022/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,472    | 2,544     | 264,358 | 2022/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,840    | 6,378     | 662,644 | 2025/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,159    | 2,846     | 295,757 | 2045/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,558    | 2,642     | 274,552 | 2022/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 6,287    | 6,518     | 677,186 | 2022/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 4,992    | 5,195     | 539,804 | 2022/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 4,366    | 4,643     | 482,390 | 2026/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,561    | 2,649     | 275,249 | 2023/01/31 |

# 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 | 2.5000 | 3,648    | 4,419     | 459,139 | 2046/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,962    | 3,050     | 316,904 | 2023/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,623    | 3,735     | 388,125 | 2023/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,729    | 3,969     | 412,405 | 2026/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,070    | 2,142     | 222,594 | 2023/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,423    | 4,148     | 430,959 | 2046/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,590     | 269,119 | 2023/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,000    | 3,092     | 321,309 | 2023/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 5,400    | 5,716     | 593,875 | 2026/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,480    | 4,028     | 418,533 | 2046/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,780    | 2,859     | 297,071 | 2023/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,400    | 2,478     | 257,456 | 2023/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,505    | 2,589     | 268,986 | 2023/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,300    | 5,767     | 599,225 | 2026/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,000    | 3,031     | 314,955 | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,604     | 270,599 | 2023/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,500    | 4,536     | 471,248 | 2046/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,490    | 2,632     | 273,539 | 2023/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,400    | 3,454     | 358,937 | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 4,000    | 4,080     | 423,933 | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,500    | 2,657     | 276,077 | 2023/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 6,140    | 6,790     | 705,455 | 2027/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010    | 3,070     | 319,035 | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,480    | 2,639     | 274,252 | 2024/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,545    | 4,701     | 488,415 | 2047/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010    | 3,074     | 319,450 | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,300    | 2,441     | 253,656 | 2024/02/29 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 4,550    | 4,837     | 502,611 | 2024/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,900    | 2,966     | 308,222 | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 6,400    | 7,149     | 742,755 | 2027/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,000    | 2,656     | 275,990 | 2047/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,000    | 3,072     | 319,240 | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,000    | 3,181     | 330,491 | 2024/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000    | 3,072     | 319,168 | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,300    | 5,626     | 584,557 | 2024/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000    | 3,075     | 319,558 | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,400    | 2,550     | 265,016 | 2024/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,900    | 6,556     | 681,141 | 2027/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,900    | 2,984     | 310,060 | 2022/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,000    | 3,205     | 333,022 | 2024/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,450    | 4,390     | 456,090 | 2047/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,200    | 3,282     | 341,018 | 2022/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,000    | 2,120     | 220,327 | 2024/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,500    | 2,579     | 267,942 | 2022/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,500    | 2,677     | 278,126 | 2024/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,500    | 2,588     | 268,916 | 2022/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,500    | 6,122     | 636,076 | 2027/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,500    | 4,460     | 463,380 | 2047/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,500    | 3,769     | 391,649 | 2024/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,200    | 3,433     | 356,756 | 2024/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,800    | 3,022     | 314,003 | 2024/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 3,500    | 3,667     | 380,999 | 2023/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,650    | 6,500     | 675,342 | 2028/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 3,300    | 3,481     | 361,717 | 2023/02/28 |

| 当 期 |                                  |      |        | 未 評 価 額  |           |         | 償還年月日      |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 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 | 2.5000 | 2,600    | 2,838     | 294,867 | 2025/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,700    | 2,979     | 309,560 | 2025/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,800    | 5,060     | 525,735 | 2048/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 2,900    | 3,057     | 317,613 | 2023/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,900    | 3,189     | 331,312 | 2025/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 4,200    | 5,721     | 594,405 | 2048/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 6,500    | 7,558     | 785,282 | 2028/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,500    | 2,655     | 275,853 | 2023/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 1,900    | 2,112     | 219,504 | 2025/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,550    | 3,953     | 410,761 | 2025/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,500    | 2,660     | 276,383 | 2023/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,500    | 2,657     | 276,098 | 2023/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,000    | 3,329     | 345,928 | 2025/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,850    | 4,114     | 427,410 | 2023/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 6,700    | 7,812     | 811,616 | 2028/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 4,220    | 5,635     | 585,456 | 2048/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 2,500    | 2,794     | 290,302 | 2025/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,600    | 3,853     | 400,356 | 2023/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,600    | 4,006     | 416,225 | 2025/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,500    | 2,817     | 292,676 | 2025/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,000    | 3,227     | 335,288 | 2023/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,500    | 2,821     | 293,081 | 2025/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 4,000    | 4,312     | 447,990 | 2023/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 4,000    | 4,106     | 426,597 | 2021/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 6,900    | 8,200     | 851,972 | 2028/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 4,520    | 6,447     | 669,812 | 2048/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,000    | 3,371     | 350,260 | 2025/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 2,000    | 2,160     | 224,450 | 2023/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,800    | 2,872     | 298,446 | 2021/12/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 3,500    | 3,895     | 404,747 | 2025/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,500    | 2,686     | 279,082 | 2023/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,000    | 3,079     | 319,910 | 2022/01/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 6,600    | 7,610     | 790,664 | 2029/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,000    | 3,085     | 320,543 | 2022/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 4,000    | 4,289     | 445,654 | 2024/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,500    | 2,786     | 289,450 | 2026/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 4,700    | 6,295     | 654,069 | 2049/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 2,500    | 2,774     | 288,232 | 2026/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 3,300    | 3,531     | 366,859 | 2024/02/29 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 3,500    | 3,600     | 374,054 | 2022/03/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,500    | 2,743     | 285,027 | 2026/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,700    | 3,806     | 395,486 | 2022/04/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,400    | 3,497     | 363,367 | 2022/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 4,650    | 6,094     | 633,145 | 2049/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 3,900    | 4,425     | 459,804 | 2029/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,500    | 3,741     | 388,726 | 2024/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 2,800    | 3,093     | 321,389 | 2026/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,500    | 3,585     | 372,461 | 2022/06/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,000    | 3,276     | 340,399 | 2026/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,500    | 3,688     | 383,213 | 2024/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,800    | 3,021     | 313,933 | 2026/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 4,000    | 4,102     | 426,256 | 2022/07/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 5,500    | 5,802     | 602,861 | 2024/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,500    | 2,699     | 280,419 | 2026/07/31 |

# 外国債券インデックスマザーファンド

| 当 期 |                                  |      |        | 未 評 価 額  |           |           | 償還年月日      |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|-----------|------------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 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 | 1.6250 | 6,900    | 7,414     | 770,317   | 2029/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,500    | 3,580     | 371,978   | 2022/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 4,600    | 5,351     | 555,996   | 2049/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,800    | 2,945     | 305,957   | 2026/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 4,148     | 431,010   | 2024/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,000    | 3,071     | 319,131   | 2022/09/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,665     | 276,931   | 2026/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,000    | 3,141     | 326,349   | 2024/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,900    | 2,966     | 308,141   | 2022/10/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 1,000    | 1,047     | 108,840   | 2024/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,550    | 2,582     | 268,281   | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,000    | 3,200     | 332,461   | 2026/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 5,850    | 6,356     | 660,363   | 2029/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 4,500    | 5,371     | 558,009   | 2049/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 1,500    | 1,520     | 158,007   | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,000    | 2,133     | 221,690   | 2026/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,000    | 3,145     | 326,814   | 2024/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,000    | 3,089     | 320,982   | 2022/12/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,500    | 2,687     | 279,243   | 2026/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,500    | 2,648     | 275,165   | 2024/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 1,500    | 1,524     | 158,354   | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 4,000    | 4,114     | 427,424   | 2023/01/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 4,700    | 4,910     | 510,138   | 2025/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,500    | 2,536     | 263,467   | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,250    | 2,310     | 239,986   | 2023/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,600    | 3,829     | 397,872   | 2030/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,200    | 3,392     | 352,394   | 2027/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,400    | 5,964     | 619,647   | 2050/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 200      | 202       | 21,033    | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 300      | 311       | 32,311    | 2027/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 5,200    | 5,380     | 558,963   | 2025/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 1,200    | 1,209     | 125,626   | 2023/03/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 1,500    | 1,512     | 157,112   | 2025/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.3750 | 200      | 200       | 20,841    | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.2500 | 13,200   | 13,227    | 1,374,186 | 2023/04/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 1,600    | 1,609     | 167,196   | 2027/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 7,800    | 7,670     | 796,849   | 2030/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 3,500    | 3,496     | 363,200   | 2023/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.3750 | 2,700    | 2,706     | 281,204   | 2025/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 3,200    | 3,199     | 332,408   | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 5,700    | 5,684     | 590,550   | 2027/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 5,600    | 5,168     | 536,922   | 2050/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 5,000    | 4,814     | 500,173   | 2040/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 500      | 499       | 51,926    | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 3,500    | 3,488     | 362,447   | 2027/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.2500 | 3,000    | 2,990     | 310,694   | 2025/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.2500 | 5,500    | 5,510     | 572,486   | 2023/06/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 5,500    | 5,497     | 571,149   | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.2500 | 7,500    | 7,470     | 776,128   | 2025/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 3,500    | 3,486     | 362,222   | 2027/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 1,000    | 998       | 103,747   | 2023/07/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.2500 | 3,400    | 3,386     | 351,788   | 2025/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 3,500    | 3,497     | 363,400   | 2022/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.1250 | 800      | 798       | 82,998    | 2023/08/15 |

|      |     | 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 | 0. 6250 | 10, 000  | 9, 810    | 1, 019, 171  | 2030/08/15 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 3750 | 5, 000   | 4, 936    | 512, 832     | 2027/07/31 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1. 3750 | 7, 700   | 7, 333    | 761, 827     | 2050/08/15 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1. 1250 | 5, 800   | 5, 570    | 578, 736     | 2040/08/15 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 5000 | 3, 500   | 3, 481    | 361, 680     | 2027/08/31 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 1250 | 3, 000   | 2, 997    | 311, 461     | 2022/08/31 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 1250 | 2, 000   | 1, 996    | 207, 430     | 2023/09/15 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 2500 | 6, 500   | 6, 468    | 672, 009     | 2025/09/30 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 1250 | 3, 000   | 2, 998    | 311, 486     | 2022/09/30 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 3750 | 4, 000   | 3, 942    | 409, 551     | 2027/09/30 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 2500 | 3, 500   | 3, 484    | 361, 993     | 2025/08/31 |  |
|      |     | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0. 1250 | 4, 200   | 4, 191    | 435, 500     | 2023/10/15 |  |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 249銘柄                                |      |         |          |           |              |            |  |
|      | 金 額 |                                      |      |         | 820, 457 | 897, 323  | 93, 222, 970 |            |  |
| カナダ  |     |                                      |      |         | 千カナダ・ドル  | 千カナダ・ドル   |              |            |  |
|      |     | Canada Government International Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 405      | 622       | 49, 753      | 2064/12/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 8. 0000 | 586      | 866       | 69, 298      | 2027/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5. 7500 | 983      | 1, 401    | 112, 035     | 2029/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5. 7500 | 1, 117   | 1, 771    | 141, 659     | 2033/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5. 0000 | 1, 012   | 1, 645    | 131, 567     | 2037/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 4. 0000 | 1, 363   | 2, 111    | 168, 839     | 2041/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 7500 | 1, 751   | 1, 818    | 145, 382     | 2022/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 3. 5000 | 1, 461   | 2, 219    | 177, 428     | 2045/12/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 5000 | 1, 253   | 1, 292    | 103, 307     | 2023/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 5000 | 1, 405   | 1, 512    | 120, 956     | 2024/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 7500 | 1, 337   | 1, 846    | 147, 611     | 2048/12/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 2500 | 1, 156   | 1, 252    | 100, 136     | 2025/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 5000 | 969      | 1, 023    | 81, 864      | 2026/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 0000 | 1, 240   | 1, 279    | 102, 324     | 2027/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 5000 | 1, 440   | 1, 445    | 115, 606     | 2022/03/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 0000 | 1, 750   | 1, 774    | 141, 837     | 2022/09/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 0000 | 1, 200   | 1, 328    | 106, 242     | 2028/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 7500 | 4, 300   | 4, 445    | 355, 439     | 2023/03/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 0000 | 1, 300   | 1, 362    | 108, 908     | 2023/09/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 0000 | 2, 110   | 2, 559    | 204, 616     | 2051/12/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 2500 | 1, 220   | 1, 386    | 110, 858     | 2029/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2. 2500 | 1, 200   | 1, 276    | 102, 058     | 2024/03/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 5000 | 1, 400   | 1, 462    | 116, 889     | 2024/09/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 2500 | 3, 450   | 3, 630    | 290, 256     | 2030/06/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 2500 | 800      | 808       | 64, 621      | 2021/11/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 2500 | 1, 600   | 1, 660    | 132, 756     | 2025/03/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 5000 | 1, 100   | 1, 117    | 89, 333      | 2022/02/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1. 5000 | 5        | 5         | 407          | 2022/05/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 5000 | 2, 890   | 2, 902    | 232, 079     | 2025/09/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 2500 | 2, 300   | 2, 301    | 184, 015     | 2022/08/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 2500 | 700      | 700       | 55, 987      | 2022/11/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 5000 | 900      | 880       | 70, 392      | 2030/12/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 2500 | 500      | 494       | 39, 573      | 2026/03/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 2500 | 500      | 499       | 39, 927      | 2024/04/01 |  |
|      |     | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0. 2500 | 1, 500   | 1, 500    | 119, 948     | 2023/02/01 |  |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 35銘柄                                 |      |         |          |           |              |            |  |
|      | 金 額 |                                      |      |         | 48, 203  | 54, 207   | 4, 333, 924  |            |  |

# 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    |            |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 3,162   | 3,453     | 265,616   | 2022/07/15 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 3,568   | 4,026     | 309,715   | 2023/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 2,789   | 3,541     | 272,406   | 2027/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 3,473   | 3,783     | 290,977   | 2024/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 3,404   | 4,102     | 315,520   | 2029/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 3,498   | 3,960     | 304,575   | 2025/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 1,258   | 1,762     | 135,527   | 2033/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 3,248   | 3,928     | 302,165   | 2026/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,113   | 1,497     | 115,148   | 2037/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,307   | 1,568     | 120,618   | 2035/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 792     | 1,008     | 77,576    | 2039/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,672   | 3,075     | 236,569   | 2027/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 3,678   | 4,117     | 316,698   | 2028/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 1,252   | 1,567     | 120,531   | 2047/03/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 800     | 816       | 62,820    | 2021/12/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,800   | 3,249     | 249,881   | 2028/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,850   | 1,928     | 148,339   | 2022/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,600   | 3,039     | 233,782   | 2029/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 4,870   | 5,605     | 431,086   | 2030/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 990     | 1,176     | 90,510    | 2041/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 2,840   | 3,000     | 230,750   | 2031/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 900     | 922       | 70,986    | 2032/05/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 2,400   | 2,406     | 185,086   | 2024/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,700   | 2,725     | 209,646   | 2030/12/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,500   | 1,454     | 111,863   | 2051/06/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 2,500   | 2,494     | 191,882   | 2025/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,500   | 2,505     | 192,732   | 2031/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,700   | 2,715     | 208,863   | 2026/09/21 |
| 通貨小計    | 銘柄数                        | 28銘柄 |        |         |           |           |            |
|         | 金 額                        |      |        | 67,164  | 75,437    | 5,801,880 |            |
| シンガポール  | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.5000 | 772     | 905       | 70,346    | 2027/03/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.1250 | 788     | 827       | 64,288    | 2022/09/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.0000 | 623     | 683       | 53,124    | 2024/09/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 809     | 958       | 74,430    | 2030/09/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 400     | 512       | 39,777    | 2042/04/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 671     | 713       | 55,429    | 2023/07/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.3750 | 568     | 724       | 56,307    | 2033/09/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 625     | 728       | 56,577    | 2029/07/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.3750 | 524     | 568       | 44,190    | 2025/06/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 688     | 908       | 70,608    | 2046/03/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.1250 | 450     | 488       | 37,939    | 2026/06/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.7500 | 500     | 510       | 39,625    | 2022/04/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 650     | 751       | 58,345    | 2036/08/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.7500 | 450     | 464       | 36,079    | 2023/02/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.6250 | 550     | 623       | 48,446    | 2028/05/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.0000 | 490     | 516       | 40,097    | 2024/02/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.3750 | 350     | 418       | 32,487    | 2039/07/01 |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.8750 | 470     | 554       | 43,099    | 2050/03/01 |
| 通貨小計    | 銘柄数                        | 18銘柄 |        |         |           |           |            |
|         | 金 額                        |      |        | 10,378  | 11,857    | 921,200   |            |

| 区 分  |            | 当 期                 |      |        | 未         |           |            |
|------|------------|---------------------|------|--------|-----------|-----------|------------|
|      |            | 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     |
|      |            |                     |      | %      | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円         |
| イギリス |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 1,621     | 1,776     | 246,129    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.5000 | 1,682     | 2,785     | 385,874    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.5000 | 1,465     | 1,586     | 219,863    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.5000 | 2,320     | 2,341     | 324,351    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.5000 | 1,940     | 2,247     | 311,454    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 2,750     | 3,212     | 445,098    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,510     | 1,969     | 272,931    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.2500 | 2,010     | 2,163     | 299,692    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.7500 | 2,000     | 2,042     | 282,985    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.6250 | 2,500     | 2,787     | 386,201    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.6250 | 1,060     | 1,491     | 206,643    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.0000 | 2,600     | 2,692     | 372,992    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,110     | 1,366     | 189,388    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.6250 | 850       | 1,051     | 145,731    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.8750 | 1,800     | 1,899     | 263,116    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.6250 | 2,600     | 2,674     | 370,532    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.2500 | 940       | 1,021     | 141,593    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.1250 | 2,300     | 2,306     | 319,550    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.3750 | 2,300     | 2,313     | 320,468    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.5000 | 650       | 590       | 81,783     |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.1250 | 1,500     | 1,505     | 208,577    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.1250 | 1,000     | 997       | 138,175    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.6250 | 1,100     | 1,038     | 143,852    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.6250 | 900       | 898       | 124,524    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 0.1250 | 1,300     | 1,304     | 180,786    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 6.0000 | 949       | 1,386     | 192,137    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,840     | 2,635     | 365,215    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 5.0000 | 1,472     | 1,788     | 247,797    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,662     | 2,547     | 353,006    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,257     | 2,127     | 294,792    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,908     | 3,915     | 542,535    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,666     | 3,001     | 415,799    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,232     | 1,589     | 220,228    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 2,416     | 4,231     | 586,291    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,830     | 2,635     | 365,086    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,343     | 2,530     | 350,607    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,446     | 2,345     | 325,034    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,382     | 1,453     | 201,314    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,260     | 1,926     | 266,915    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,574     | 3,287     | 455,481    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,577     | 2,604     | 360,841    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,552     | 2,824     | 391,308    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 2,242     | 2,313     | 320,522    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.2500 | 2,166     | 3,278     | 454,284    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.2500 | 1,582     | 1,682     | 233,130    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 1,586     | 3,330     | 461,456    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.7500 | 1,092     | 1,206     | 167,187    |
|      |            | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 2,124     | 3,368     | 466,731    |
| 通貨小計 | 銘柄数<br>金 額 | 48銘柄                |      |        | 78,966    | 104,078   | 14,420,010 |

# 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       |            |
| イスラエル                          |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 6.2500 | 千イスラエル・シケル<br>2,000   | 千イスラエル・シケル<br>2,681   | 千円<br>84,053 | 2026/10/30 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 5.5000 | 2,000                 | 2,127                 | 66,679       | 2022/01/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 4.2500 | 1,800                 | 1,971                 | 61,788       | 2023/03/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 5.5000 | 1,900                 | 3,254                 | 101,990      | 2042/01/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 3.7500 | 2,000                 | 2,232                 | 69,962       | 2024/03/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 1.7500 | 2,300                 | 2,450                 | 76,788       | 2025/08/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 2.0000 | 1,800                 | 1,970                 | 61,752       | 2027/03/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 1.2500 | 1,000                 | 1,022                 | 32,041       | 2022/11/30 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 3.7500 | 2,100                 | 2,940                 | 92,144       | 2047/03/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 2.2500 | 1,800                 | 2,020                 | 63,324       | 2028/09/28 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 1.5000 | 1,500                 | 1,557                 | 48,802       | 2023/11/30 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 0.7500 | 1,000                 | 1,010                 | 31,667       | 2022/07/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 1.0000 | 1,900                 | 1,936                 | 60,676       | 2030/03/31 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 0.5000 | 600                   | 603                   | 18,928       | 2025/04/30 |
|                                |            | Israel Government Bond - Fixed | 国債証券  | 1.5000 | 700                   | 706                   | 22,146       | 2037/05/31 |
| Israel Government Bond - Fixed | 国債証券       | 0.1500                         | 1,000 | 998    | 31,286                | 2023/07/31            |              |            |
| 通貨小計                           | 銘柄数<br>金 額 | 16銘柄                           |       | 25,400 | 29,484                | 924,033               |              |            |
| 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>13,662 | 千デンマーク・クローネ<br>26,252 | 438,685      | 2039/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 3.0000 | 7,550                 | 7,812                 | 130,545      | 2021/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 1.5000 | 4,846                 | 5,162                 | 86,266       | 2023/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 1.7500 | 6,013                 | 6,735                 | 112,544      | 2025/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 0.5000 | 7,900                 | 8,490                 | 141,883      | 2027/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 0.5000 | 9,590                 | 10,450                | 174,628      | 2029/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 0.2500 | 4,300                 | 4,377                 | 73,141       | 2022/11/15 |
|                                |            | DANISH GOVERNMENT BOND         | 国債証券  | 0.2500 | 2,200                 | 2,416                 | 40,372       | 2052/11/15 |
| 通貨小計                           | 銘柄数<br>金 額 | 8銘柄                            |       | 56,061 | 71,697                | 1,198,067             |              |            |
| ノルウェー                          |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 2.0000 | 千ノルウェー・クローネ<br>8,204  | 千ノルウェー・クローネ<br>8,555  | 100,617      | 2023/05/24 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 3.0000 | 4,095                 | 4,448                 | 52,310       | 2024/03/14 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 1.7500 | 5,395                 | 5,693                 | 66,950       | 2025/03/13 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 1.5000 | 3,340                 | 3,508                 | 41,258       | 2026/02/19 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 1.7500 | 3,450                 | 3,687                 | 43,368       | 2027/02/17 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 2.0000 | 3,500                 | 3,828                 | 45,026       | 2028/04/26 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 1.7500 | 3,850                 | 4,166                 | 48,997       | 2029/09/06 |
|                                |            | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND      | 国債証券  | 1.3750 | 4,800                 | 5,045                 | 59,329       | 2030/08/19 |
| 通貨小計                           | 銘柄数<br>金 額 | 8銘柄                            |       | 36,634 | 38,933                | 457,858               |              |            |
| スウェーデン                         |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 3.5000 | 千スウェーデン・クローネ<br>4,655 | 千スウェーデン・クローネ<br>7,308 | 89,314       | 2039/03/30 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 3.5000 | 8,465                 | 8,962                 | 109,521      | 2022/06/01 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 1.5000 | 8,025                 | 8,471                 | 103,526      | 2023/11/13 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 2.5000 | 7,595                 | 8,570                 | 104,735      | 2025/05/12 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 1.0000 | 7,180                 | 7,723                 | 94,377       | 2026/11/12 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 0.7500 | 4,550                 | 4,869                 | 59,510       | 2028/05/12 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 0.7500 | 7,400                 | 7,977                 | 97,484       | 2029/11/12 |
|                                |            | SWEDISH GOVERNMENT BOND        | 国債証券  | 0.1250 | 3,000                 | 3,041                 | 37,172       | 2031/05/12 |
| 通貨小計                           | 銘柄数<br>金 額 | 8銘柄                            |       | 50,870 | 56,926                | 695,644               |              |            |

|       |            | 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    |            |  |  |
|       |            |                      |      | %       | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ  | 千円        |            |  |  |
| メキシコ  |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 5.7500  | 20,290   | 20,912    | 108,537   | 2026/03/05 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 8.0000  | 18,300   | 20,526    | 106,533   | 2047/11/07 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 7.2500  | 29,000   | 29,831    | 154,825   | 2021/12/09 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 8.0000  | 23,800   | 26,462    | 137,339   | 2024/09/05 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 6.7500  | 7,200    | 7,556     | 39,216    | 2023/03/09 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 8.0000  | 30,033   | 32,936    | 170,939   | 2023/12/07 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 10.0000 | 23,919   | 28,453    | 147,672   | 2024/12/05 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 7.5000  | 27,968   | 31,272    | 162,302   | 2027/06/03 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 10.0000 | 8,874    | 11,998    | 62,272    | 2036/11/20 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 8.5000  | 29,544   | 35,381    | 183,627   | 2029/05/31 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 8.5000  | 16,894   | 20,095    | 104,296   | 2038/11/18 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 7.7500  | 15,015   | 17,243    | 89,492    | 2031/05/29 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 6.5000  | 28,599   | 29,485    | 153,031   | 2022/06/09 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 7.7500  | 19,654   | 21,576    | 111,984   | 2042/11/13 |  |  |
|       |            | Mexican Bonos        | 国債証券 | 7.7500  | 7,944    | 9,069     | 47,073    | 2034/11/23 |  |  |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金 額 | 15銘柄                 |      |         | 307,034  | 342,802   | 1,779,145 |            |  |  |
| マレーシア |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5020  | 2,373    | 2,511     | 64,109    | 2027/05/31 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.4980  | 1,178    | 1,336     | 34,124    | 2030/04/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.3920  | 1,514    | 1,668     | 42,584    | 2026/04/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2320  | 1,300    | 1,449     | 37,002    | 2031/06/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4180  | 875      | 900       | 22,998    | 2022/08/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8920  | 731      | 791       | 20,215    | 2027/03/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4800  | 1,001    | 1,036     | 26,472    | 2023/03/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8440  | 1,427    | 1,520     | 38,828    | 2033/04/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7330  | 1,186    | 1,271     | 32,462    | 2028/06/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.9350  | 600      | 691       | 17,648    | 2043/09/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1810  | 1,057    | 1,135     | 28,982    | 2024/07/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9550  | 1,737    | 1,877     | 47,926    | 2025/09/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7950  | 1,161    | 1,203     | 30,731    | 2022/09/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2540  | 1,220    | 1,349     | 34,454    | 2035/05/31 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8000  | 1,302    | 1,364     | 34,825    | 2023/08/17 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.7360  | 930      | 1,030     | 26,304    | 2046/03/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9000  | 650      | 702       | 17,942    | 2026/11/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.6200  | 352      | 358       | 9,163     | 2021/11/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8820  | 1,600    | 1,645     | 41,999    | 2022/03/10 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0590  | 750      | 804       | 20,530    | 2024/09/30 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8990  | 1,190    | 1,291     | 32,978    | 2027/11/16 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.7620  | 1,050    | 1,229     | 31,393    | 2037/04/07 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8820  | 1,200    | 1,284     | 32,782    | 2025/03/14 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7570  | 2,500    | 2,611     | 66,665    | 2023/04/20 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.6420  | 1,200    | 1,372     | 35,039    | 2033/11/07 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.8930  | 600      | 710       | 18,126    | 2038/06/08 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9060  | 650      | 700       | 17,892    | 2026/07/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8850  | 1,910    | 2,065     | 52,744    | 2029/08/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.9210  | 1,200    | 1,351     | 34,493    | 2048/07/06 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4780  | 400      | 419       | 10,713    | 2024/06/14 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8280  | 1,300    | 1,354     | 34,577    | 2034/07/05 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7570  | 1,750    | 1,786     | 45,621    | 2040/05/22 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0650  | 700      | 699       | 17,870    | 2050/06/15 |  |  |
|       |            | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.6320  | 500      | 496       | 12,675    | 2031/04/15 |  |  |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金 額 | 34銘柄                 |      |         | 39,094   | 42,024    | 1,072,884 |            |  |  |

# 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    |
|              |  |                             |      | %      | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |
| ポーランド        |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 2,309      | 2,547      | 70,594    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 4,377      | 4,835      | 133,989   |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 3,170      | 3,520      | 97,541    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.2500 | 3,320      | 3,424      | 94,895    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 3,850      | 4,051      | 112,267   |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 2,870      | 3,101      | 85,931    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.7500 | 4,840      | 5,517      | 152,892   |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.2500 | 3,400      | 3,666      | 101,594   |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | —      | 3,200      | 3,198      | 88,629    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 0.7500 | 1,000      | 1,013      | 28,097    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 1.2500 | 1,300      | 1,302      | 36,102    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 827        | 1,154      | 31,978    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 4.0000 | 2,625      | 2,924      | 81,030    |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.7500 | 3,650      | 4,125      | 114,320   |
|              |  | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 4,591      | 5,186      | 143,717   |
| 通貨小計         |  | 銘柄数                         | 15銘柄 |        |            |            |           |
|              |  | 金 額                         |      |        | 45,329     | 49,569     | 1,373,582 |
| ユーロ (アイルランド) |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.4000 | 1,031      | 1,300      | 161,763   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.9000 | 624        | 690        | 85,861    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.4000 | 607        | 689        | 85,701    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.4000 | 961        | 1,213      | 150,888   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.8000 | 516        | 525        | 65,409    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.0000 | 881        | 1,260      | 156,765   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.0000 | 1,073      | 1,166      | 145,065   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.7000 | 550        | 703        | 87,541    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | —      | 350        | 354        | 44,095    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.9000 | 800        | 881        | 109,582   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.3000 | 750        | 888        | 110,469   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.3500 | 450        | 526        | 65,474    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.1000 | 1,200      | 1,352      | 168,245   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.5000 | 600        | 798        | 99,341    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.4000 | 250        | 266        | 33,184    |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.2000 | 800        | 836        | 104,018   |
|              |  | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.2000 | 500        | 524        | 65,211    |
| 国 小 計        |  | 銘柄数                         | 17銘柄 |        |            |            |           |
|              |  | 金 額                         |      |        | 11,943     | 13,978     | 1,738,620 |
| ユーロ (オランダ)   |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.5000 | 548        | 645        | 80,247    |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,139      | 1,648      | 204,993   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,685      | 2,897      | 360,335   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 791        | 867        | 107,864   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,779      | 3,332      | 414,497   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,438      | 1,508      | 187,604   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,168      | 1,593      | 198,247   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,385      | 1,477      | 183,713   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,579      | 2,830      | 352,104   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,514      | 1,666      | 207,246   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,791      | 1,872      | 232,958   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,638      | 1,749      | 217,606   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,200      | 1,209      | 150,476   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 2,200      | 2,407      | 299,459   |
|              |  | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,400      | 1,432      | 178,227   |

| 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          |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,150   | 1,272     | 158,233     |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,200   | 1,286     | 160,030     |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 900     | 1,033     | 128,512     |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,900   | 1,994     | 248,022     |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 800     | 832       | 103,540     |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 600     | 620       | 77,223      |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 21銘柄                        |      |        |         |           |             |
|           | 金 額 |                             |      |        | 27,805  | 34,178    | 4,251,147   |
| ユーロ（ベルギー） |     |                             |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.8000 | 1,699   | 1,815     | 225,803     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.0000 | 1,774   | 2,026     | 252,110     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.9000 | 1,058   | 1,412     | 175,646     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.0000 | 2,283   | 2,493     | 310,129     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.6000 | 1,244   | 1,667     | 207,454     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 2.1500 | 640     | 1,098     | 136,642     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.2000 | 1,490   | 1,529     | 190,279     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.8000 | 1,400   | 1,529     | 190,207     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.5000 | 1,050   | 1,099     | 136,799     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 2.2500 | 780     | 1,281     | 159,385     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.4500 | 400     | 498       | 62,057      |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.8000 | 1,340   | 1,477     | 183,749     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.2500 | 850     | 1,012     | 125,900     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.9000 | 1,500   | 1,678     | 208,741     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.7000 | 600     | 835       | 103,921     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.1000 | 1,220   | 1,278     | 159,010     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.4000 | 660     | 698       | 86,924      |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | —      | 1,200   | 1,246     | 155,060     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 5.5000 | 1,706   | 2,478     | 308,236     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 5.0000 | 2,104   | 3,686     | 458,506     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.0000 | 877     | 932       | 115,934     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.2500 | 1,604   | 2,937     | 365,392     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.5000 | 1,001   | 1,280     | 159,208     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.2500 | 1,316   | 1,436     | 178,729     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.0000 | 780     | 1,167     | 145,273     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 2.2500 | 1,338   | 1,441     | 179,263     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 3.7500 | 843     | 1,556     | 193,604     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 2.6000 | 1,505   | 1,684     | 209,578     |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 3.0000 | 747     | 1,074     | 133,693     |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 29銘柄                        |      |        |         |           |             |
|           | 金 額 |                             |      |        | 35,009  | 44,357    | 5,517,247   |
| ユーロ（フランス） |     |                             |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 8.5000 | 1,985   | 2,428     | 302,072     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 6.0000 | 3,025   | 4,033     | 501,630     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 5.5000 | 3,323   | 5,031     | 625,824     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 5.7500 | 2,927   | 5,073     | 631,083     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.7500 | 2,659   | 4,574     | 569,001     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.0000 | 1,764   | 3,853     | 479,249     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.0000 | 2,374   | 4,104     | 510,503     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.2500 | 4,097   | 4,696     | 584,188     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.5000 | 3,564   | 6,786     | 844,064     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.0000 | 1,717   | 3,983     | 495,413     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 3.5000 | 3,146   | 3,861     | 480,355     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 3.0000 | 3,630   | 3,819     | 475,094     |

# 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         |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 5,199   | 6,415     | 797,916    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 3,694   | 3,905     | 485,731    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,588   | 4,495     | 559,096    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 3,347   | 3,554     | 442,114    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 5,086   | 5,617     | 698,734    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 5,887   | 7,540     | 937,943    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 4,899   | 5,385     | 669,832    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 3,492   | 3,679     | 457,615    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 5,101   | 5,528     | 687,681    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 4,920   | 5,882     | 731,677    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 3,787   | 4,025     | 500,649    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 3,869   | 4,674     | 581,470    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,287   | 1,993     | 247,903    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 3,800   | 3,996     | 497,122    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 4,000   | 4,042     | 502,838    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,570   | 3,408     | 423,979    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 3,400   | 3,753     | 466,915    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 3,000   | 4,401     | 547,515    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,400   | 2,440     | 303,524    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 4,400   | 4,827     | 600,439    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 3,950   | 4,717     | 586,819    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 4,950   | 5,453     | 678,326    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 3,400   | 3,481     | 433,037    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,400   | 1,412     | 175,629    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 2,750   | 3,690     | 459,079    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 5,250   | 5,685     | 707,213    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 3,130   | 3,221     | 400,700    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,800   | 2,907     | 361,626    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,400   | 2,438     | 303,324    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,870   | 2,098     | 261,022    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 3,000   | 3,098     | 385,356    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,000   | 1,083     | 134,730    |
|          |            | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,000   | 2,070     | 257,481    |
| 国 小 計    | 銘柄数<br>金 額 | 45銘柄                   |      |        | 148,837 | 183,176   | 22,783,533 |
| ユーロ（ドイツ） |            |                        |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 974     | 1,189     | 147,999    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 1,167   | 1,741     | 216,650    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.6250 | 2,162   | 3,167     | 393,998    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 950     | 1,357     | 168,895    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 1,951   | 3,219     | 400,477    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 3,448   | 5,647     | 702,454    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,405   | 2,446     | 304,271    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 3,571   | 6,208     | 772,249    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,325   | 2,510     | 312,279    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,439   | 2,939     | 365,649    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,874   | 5,185     | 644,983    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,807   | 1,862     | 231,598    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,222   | 2,311     | 287,535    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,808   | 4,728     | 588,082    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,644   | 1,710     | 212,721    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,410   | 1,481     | 184,319    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,817   | 1,920     | 238,837    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,599   | 1,721     | 214,134    |
|          |            | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,561   | 1,690     | 210,281    |

| 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     |       |
|            |                         |      |        |         |         |            |            |       |
|            |                         |      |        | %       | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円         |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000 | 2,979   | 5,158   | 641,558    | 2046/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.5000 | 1,594   | 1,722   | 214,213    | 2024/05/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 4,042   | 4,315   | 536,764    | 2024/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,194   | 2,315   | 287,985    | 2025/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 3,134   | 3,402   | 423,197    | 2025/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,368   | 2,528   | 314,527    | 2026/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,420   | 2,527   | 314,421    | 2026/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 6,200   | 6,595   | 820,409    | 2027/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,300   | 2,496   | 310,473    | 2027/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.2500 | 2,370   | 3,358   | 417,721    | 2048/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 1,900   | 2,071   | 257,628    | 2028/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 4,400   | 4,730   | 588,350    | 2028/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 2,200   | 2,371   | 295,012    | 2029/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 3,000   | 3,174   | 394,849    | 2029/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,750   | 1,846   | 229,701    | 2050/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,750   | 1,852   | 230,435    | 2030/02/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,200   | 2,328   | 289,591    | 2035/05/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,000   | 2,101   | 261,329    | 2027/11/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 700     | 741     | 92,168     | 2030/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,200   | 1,273   | 158,369    | 2030/08/15 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 800     | 806     | 100,250    | 2021/12/10 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 300     | 302     | 37,664     | 2022/03/11 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 100     | 101     | 12,579     | 2022/06/10 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 100     | 101     | 12,606     | 2022/09/16 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,160   | 1,171   | 145,733    | 2022/04/08 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,100   | 2,129   | 264,927    | 2022/10/07 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 5,730   | 5,838   | 726,145    | 2023/04/14 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,900   | 1,943   | 241,792    | 2023/10/13 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,920   | 1,971   | 245,204    | 2024/04/05 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,700   | 1,752   | 217,956    | 2024/10/18 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,400   | 2,482   | 308,789    | 2025/04/11 |       |
|            | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,300   | 2,387   | 296,999    | 2025/10/10 |       |
| 国 小 計      | 銘柄数                     | 51銘柄 |        |         |         |            |            |       |
|            | 金 額                     |      |        | 107,345 | 130,943 | 16,286,782 |            |       |
|            |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ    |            |            |       |
| ユーロ (スペイン) | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 2,652   | 3,984   | 495,598    | 2029/01/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 2,045   | 2,234   | 277,974    | 2025/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 2,052   | 2,435   | 302,957    | 2030/07/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1500 | 2,192   | 2,474   | 307,789    | 2025/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 2,733   | 3,083   | 383,485    | 2026/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.9000 | 1,952   | 2,927   | 364,165    | 2046/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.4500 | 1,550   | 2,827   | 351,712    | 2066/07/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3000 | 3,030   | 3,329   | 414,181    | 2026/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4000 | 2,080   | 2,109   | 262,391    | 2022/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,900   | 2,123   | 264,070    | 2027/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.3500 | 2,200   | 2,777   | 345,405    | 2033/07/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 2,050   | 2,290   | 284,877    | 2027/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4500 | 1,600   | 1,632   | 203,051    | 2022/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4000 | 1,900   | 2,124   | 264,243    | 2028/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7000 | 1,300   | 1,910   | 237,669    | 2048/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.3500 | 2,400   | 2,458   | 305,804    | 2023/07/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4000 | 1,900   | 2,130   | 264,957    | 2028/07/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.0500 | 1,700   | 1,709   | 212,655    | 2021/10/31 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 2,600   | 2,938   | 365,528    | 2029/04/30 |       |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.8500 | 2,050   | 2,482   | 308,733    | 2035/07/30 |       |

# 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     |
|            |     |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 2,300   | 2,367     | 294,410    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.6000 | 2,800   | 2,962     | 368,501    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,360   | 1,424     | 177,171    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,460   | 2,494     | 310,224    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,500   | 1,529     | 190,279    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,200   | 1,242     | 154,572    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.8000 | 2,400   | 2,569     | 319,554    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 2,900   | 3,241     | 403,239    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2000 | 900     | 996       | 123,938    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,979   | 3,261     | 405,679    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2000 | 1,854   | 2,954     | 367,519    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.9000 | 2,158   | 3,906     | 485,844    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8000 | 1,682   | 1,969     | 245,000    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7000 | 2,473   | 4,434     | 551,558    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6500 | 2,189   | 2,717     | 338,058    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.9000 | 1,965   | 2,671     | 332,261    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.8500 | 1,978   | 2,126     | 264,536    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.4000 | 1,958   | 2,214     | 275,402    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.4000 | 1,901   | 2,179     | 271,029    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 1,770   | 2,515     | 312,852    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 1,299   | 2,566     | 319,167    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.8000 | 1,970   | 2,265     | 281,746    |
|            |     | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,097   | 2,367     | 294,515    |
| 国 小 計      | 銘柄数 | 43銘柄                    |      |        |         |           |            |
|            | 金 額 |                         |      |        | 86,979  | 106,965   | 13,304,319 |
|            |     |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
| ユーロ (イタリア) |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 9.0000 | 1,906   | 2,428     | 302,008    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.2500 | 1,110   | 1,577     | 196,257    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 2,392   | 3,414     | 424,642    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,814   | 2,007     | 249,735    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,509   | 2,126     | 264,508    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3500 | 1,629   | 1,669     | 207,658    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 2,487   | 2,666     | 331,635    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6500 | 2,065   | 2,284     | 284,131    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,891   | 2,083     | 259,169    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 1,504   | 1,555     | 193,448    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7000 | 1,610   | 2,077     | 258,454    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.9500 | 1,359   | 1,400     | 174,209    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 1,786   | 1,938     | 241,155    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 2,324   | 2,754     | 342,572    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 1,068   | 1,141     | 141,922    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.6500 | 1,550   | 1,593     | 198,260    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.3500 | 1,358   | 1,368     | 170,230    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8000 | 968     | 1,288     | 160,307    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.4500 | 1,500   | 1,798     | 223,716    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2000 | 1,510   | 1,705     | 212,148    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.8500 | 1,300   | 1,394     | 173,441    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2000 | 2,050   | 2,095     | 260,682    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.4500 | 1,850   | 2,710     | 337,117    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0500 | 2,700   | 3,028     | 376,712    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.9000 | 1,700   | 1,738     | 216,264    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 1,600   | 1,703     | 211,883    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.9500 | 1,300   | 1,686     | 209,823    |
|            |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 2,100   | 2,358     | 293,296    |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分          |  | 銘 柄                               | 種 類  | 当 期    |         | 未 評 価 額   |            | 償還年月日      |
|--------------|--|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|------------|------------|
|              |  |                                   |      | 年利率    | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 |            |            |
|              |  |                                   |      |        |         | 千ユーロ      | 千円         |            |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9500 | 1,900   | 1,957     | 243,499    | 2023/03/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 1,300   | 1,389     | 172,850    | 2025/05/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.8000 | 3,050   | 3,638     | 452,586    | 2028/12/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.4500 | 2,200   | 2,374     | 295,384    | 2023/10/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.5000 | 1,550   | 1,744     | 217,032    | 2025/11/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.3500 | 1,270   | 1,684     | 209,461    | 2035/03/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.8500 | 1,250   | 1,967     | 244,680    | 2049/09/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.0000 | 1,550   | 1,587     | 197,423    | 2022/07/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.0000 | 1,900   | 2,318     | 288,388    | 2029/08/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.7500 | 2,200   | 2,354     | 292,897    | 2024/07/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.1000 | 2,100   | 2,339     | 290,930    | 2026/07/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.1000 | 1,250   | 1,660     | 206,574    | 2040/03/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.3500 | 1,900   | 2,050     | 255,003    | 2030/04/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.0500 | 740     | 747       | 92,959     | 2023/01/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3500 | 1,300   | 1,327     | 165,063    | 2025/02/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.8500 | 2,350   | 2,449     | 304,709    | 2027/01/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.4500 | 1,800   | 2,235     | 278,108    | 2050/09/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 1,500   | 1,603     | 199,504    | 2036/03/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.6000 | 2,000   | 2,049     | 254,946    | 2023/06/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.8500 | 2,300   | 2,502     | 311,268    | 2025/07/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9500 | 2,000   | 2,081     | 258,946    | 2030/08/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.6500 | 2,400   | 2,654     | 330,199    | 2030/12/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3000 | 1,300   | 1,322     | 164,499    | 2023/08/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9500 | 1,700   | 1,780     | 221,508    | 2027/09/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.5000 | 800     | 819       | 101,984    | 2026/02/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.8000 | 1,400   | 1,539     | 191,438    | 2041/03/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9000 | 1,300   | 1,339     | 166,638    | 2031/04/01 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | —      | 100     | 100       | 12,538     | 2024/01/15 |
|              |  | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.7000 | 800     | 845       | 105,110    | 2051/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,754   | 3,912     | 486,684    | 2029/11/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 6.0000 | 2,849   | 4,399     | 547,211    | 2031/05/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.7500 | 1,805   | 2,852     | 354,786    | 2033/02/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,298   | 3,522     | 438,127    | 2034/08/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,740   | 3,943     | 490,515    | 2037/02/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,044   | 3,375     | 419,857    | 2039/08/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,251   | 2,560     | 318,493    | 2023/08/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,118   | 2,581     | 321,103    | 2025/03/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,243   | 3,740     | 465,267    | 2040/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,070   | 2,555     | 317,906    | 2026/03/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,012   | 2,150     | 267,514    | 2022/03/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 2,657   | 2,934     | 364,943    | 2022/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,960   | 2,183     | 271,612    | 2022/11/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,410   | 3,222     | 400,773    | 2028/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,894   | 2,119     | 263,590    | 2023/05/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,813   | 3,079     | 383,056    | 2044/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,194   | 2,535     | 315,324    | 2024/03/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,201   | 2,526     | 314,304    | 2024/09/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,838   | 3,615     | 449,727    | 2030/03/01 |
|              |  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.1500 | 1,593   | 1,637     | 203,641    | 2021/12/15 |
| 国 小 計        |  | 銘柄数                               | 77銘柄 |        |         |           |            |            |
|              |  | 金 額                               |      |        | 139,894 | 167,518   | 20,835,981 |            |
| ユーロ (フィンランド) |  | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.7500 | 614     | 688       | 85,676     | 2031/04/15 |
|              |  | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.8750 | 279     | 300       | 37,354     | 2025/09/15 |
|              |  | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.5000 | 1,111   | 1,181     | 147,010    | 2026/04/15 |

# 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 |
|              |     |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | —      | 200     | 204       | 25,396      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.3750 | 360     | 496       | 61,731      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | —      | 770     | 777       | 96,759      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 800     | 860       | 107,019     |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.1250 | 370     | 439       | 54,677      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 500     | 541       | 67,346      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 500     | 544       | 67,708      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | —      | 200     | 205       | 25,556      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.1250 | 310     | 324       | 40,409      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.2500 | 400     | 427       | 53,167      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | —      | 500     | 520       | 64,777      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 667     | 813       | 101,216     |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 389     | 489       | 60,843      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.6250 | 312     | 325       | 40,480      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 446     | 470       | 58,472      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.6250 | 407     | 651       | 81,044      |
|              |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 529     | 578       | 71,937      |
| 国 小 計        | 銘柄数 | 20銘柄                    |      |        |         |           |             |
|              | 金 額 |                         |      |        | 9,664   | 10,842    | 1,348,586   |
| ユーロ (オーストリア) |     |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.2000 | 1,373   | 1,502     | 186,894     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 1,126   | 1,220     | 151,765     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 784     | 1,090     | 135,652     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 240     | 409       | 50,950      |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 900     | 917       | 114,077     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 1,780   | 1,910     | 237,664     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.1000 | 540     | 1,225     | 152,459     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 400     | 405       | 50,414      |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 900     | 987       | 122,878     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 980     | 1,063     | 132,311     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 800     | 820       | 102,093     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 680     | 708       | 88,063      |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 1,000   | 1,017     | 126,528     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 700     | 842       | 104,810     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 400     | 404       | 50,317      |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 6.2500 | 825     | 1,209     | 150,419     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.1500 | 1,673   | 2,878     | 358,056     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.8500 | 875     | 1,137     | 141,423     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 797     | 845       | 105,156     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.4000 | 872     | 943       | 117,371     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.8000 | 338     | 831       | 103,397     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.1500 | 623     | 1,102     | 137,079     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.7500 | 959     | 1,028     | 127,899     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.4000 | 771     | 1,054     | 131,133     |
|              |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.6500 | 932     | 1,019     | 126,773     |
| 国 小 計        | 銘柄数 | 25銘柄                    |      |        |         |           |             |
|              | 金 額 |                         |      |        | 21,268  | 26,576    | 3,305,593   |
| 通貨小計         | 銘柄数 | 328銘柄                   |      |        |         |           |             |
|              | 金 額 |                         |      |        | 588,744 | 718,538   | 89,371,812  |
| 合 計          | 銘柄数 | 810銘柄                   |      |        |         |           |             |
|              | 金 額 |                         |      |        |         |           | 215,573,016 |

(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

2020年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 215,573,016 | 98.5  |
| コール・ローン等、その他 | 3,336,412   | 1.5   |
| 投資信託財産総額     | 218,909,428 | 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=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1シンガポール・ドル=77.69円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シェケル=31.34円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1メキシコ・ペソ=5.19円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1ポーランド・ズロチ=27.71円、1ユーロ=124.38円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産(217,489,673千円)の投資信託財産総額(218,909,428千円)に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A)資産          | 221,017,451,889円 |
| コール・ローン等       | 2,032,950,395    |
| 公社債(評価額)       | 215,573,016,059  |
| 未収入金           | 2,130,088,310    |
| 未収利息           | 1,222,948,097    |
| 前払費用           | 58,449,028       |
| (B)負債          | 2,181,996,278    |
| 未払金            | 2,110,180,468    |
| 未払解約金          | 71,815,810       |
| (C)純資産総額(A-B)  | 218,835,455,611  |
| 元本             | 72,688,498,430   |
| 次期繰越増益金        | 146,146,957,181  |
| (D)受益権総口数      | 72,688,498,430口  |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 30,106円          |

- \*期首における元本額は66,118,107,712円、当作成期間中における追加設定元本額は13,500,674,811円、同解約元本額は6,930,284,093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 A601,675,980円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)12,401,222円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)102,686,952円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)29,631,947円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)339,511,943円、外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)90,339,707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)462,489,583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)1,814,096,236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)654,015,808円、D-1's 外国債券インデックス1,055,376円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 957,155円、iFree 外国債券インデックス691,990,376円、iFree 8資産バランス989,492,660円、iFree 年金バランス49,115,601円、DCダイワ外国債券インデックス48,408,053,236円、ダイワ・ライフ・バランス30 819,754,500円、ダイワ・ライフ・バランス50

- 459,770,424円、ダイワ・ライフ・バランス70 279,428,323円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)459,816,979円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)336,784,366円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)108,589,082円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 8,547,742円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 19,902,336円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 4,844,467円、ダイワつみたてインデックス外国債券163,786,187円、ダイワつみたてインデックスバランス30 3,047,233円、ダイワつみたてインデックスバランス50 977,653円、ダイワつみたてインデックスバランス70 951,206円、ダイワ世界バランスファンド40VA174,483,363円、ダイワ世界バランスファンド60VA131,594,279円、ダイワ・バランスファンド35VA4,234,846,474円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)250,419,145円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券142,610,494円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド34,513,413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)4,864,458,623円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,832,536,410円、ダイワライフスタイル2533,396,711円、ダイワライフスタイル50 59,767,812円、ダイワライフスタイル75 16,157,426円です。
- \*当期末の計算口数当りの純資産額は30,106円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

| 項 目             | 当 期              |
|-----------------|------------------|
| (A)配当等収益        | 4,034,330,893円   |
| 受取利息            | 4,037,282,101    |
| 支払利息            | △ 2,951,208      |
| (B)有価証券売買損益     | 4,567,605,912    |
| 売買益             | 11,533,587,280   |
| 売買損             | △ 6,965,981,368  |
| (C)その他費用        | △ 33,084,010     |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 8,568,852,795    |
| (E)前期繰越増益金      | 124,346,492,561  |
| (F)解約差損益金       | △ 13,361,915,838 |
| (G)追加信託差損益金     | 26,593,527,663   |
| (H)合計(D+E+F+G)  | 146,146,957,181  |
| 次期繰越増益金(H)      | 146,146,957,181  |

- (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。