

第268期末(2024年12月16日)		第263期～第268期	
基準価額	9,317円	騰落率	-0.4%
純資産総額	26,175百万円	分配金合計	60円

(注)騰落率は収益分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	原則として無期限
運用方針	日本を除く世界各国の投資適格債券への分散投資を通じて、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。
主要投資対象	
本ファンド	グローバル・アグリゲート(除く日本)マザーファンドの受益証券
グローバル・アグリゲート(除く日本)マザーファンド	日本を除く世界各国の国債、政府関係機関債、社債、モーゲージ証券、アセットバック証券等
運用方法・組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入比率は高位に保ちます。 ②本ファンドおよびマザーファンドにおける組入制限は下記のとおりです。 <ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への投資については、特に制限を設けません。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
分配方針	原則として毎計算期末(毎月15日。休業日の場合は翌営業日。)に収益の分配を行います。投信会社が経費控除後の配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の中から基準価額水準、市場動向等を勘案して分配金を決定します。

ゴールドマン・サックス 毎月分配債券ファンド

愛称：妖精物語

追加型投信／海外／債券

第263期(決算日2024年7月16日)

第264期(決算日2024年8月15日)

第265期(決算日2024年9月17日)

第266期(決算日2024年10月15日)

第267期(決算日2024年11月15日)

第268期(決算日2024年12月16日)

作成対象期間:2024年6月18日～2024年12月16日

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「ゴールドマン・サックス毎月分配債券ファンド」は、このたび、第263期～第268期の決算を行いました。本ファンドは、日本を除く世界各国の国債、政府関係機関債、社債、モーゲージ証券、アセットバック証券等に分散投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行っております。今期の運用経過等について、以下のとおり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。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒105-5543 東京都港区虎ノ門2-6-1 虎ノ門ヒルズステーションタワー

お問合せ先:03-4587-6000(代表)

受付時間:営業日の午前9時～午後5時 | www.gsam.co.jp

■最近5作成期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	ベンチマーク	期中 騰落率	債券組入 比率	債券先物 比率	純資産額
						%	%	%
①	239期(2022年7月15日)	円 8,318	円 10	% 4.0	24,152	% 4.1	% 97.0	% 12.9
	240期(2022年8月15日)	8,184	10	△1.5	23,660	△2.0	97.4	13.1
	241期(2022年9月15日)	8,352	10	2.2	24,201	2.3	98.5	12.6
	242期(2022年10月17日)	8,129	10	△2.6	23,930	△1.1	95.8	10.8
	243期(2022年11月15日)	8,020	10	△1.2	23,427	△2.1	97.4	12.2
	244期(2022年12月15日)	8,060	10	0.6	23,812	1.6	95.0	10.2
②	245期(2023年1月16日)	7,674	10	△4.7	22,516	△5.4	96.9	14.2
	246期(2023年2月15日)	7,853	10	2.5	23,090	2.6	95.0	16.9
	247期(2023年3月15日)	7,913	10	0.9	22,970	△0.5	95.6	17.2
	248期(2023年4月17日)	8,003	10	1.3	23,468	2.2	97.9	19.0
	249期(2023年5月15日)	8,114	10	1.5	23,860	1.7	96.0	21.4
	250期(2023年6月15日)	8,238	10	1.7	24,457	2.5	97.7	23.7
③	251期(2023年7月18日)	8,265	10	0.4	24,490	0.1	97.7	24.5
	252期(2023年8月15日)	8,448	10	2.3	24,924	1.8	97.6	26.0
	253期(2023年9月15日)	8,505	10	0.8	25,208	1.1	97.7	22.0
	254期(2023年10月16日)	8,423	10	△0.8	25,020	△0.7	97.8	29.8
	255期(2023年11月15日)	8,704	10	3.5	25,939	3.7	96.5	28.1
	256期(2023年12月15日)	8,610	10	△1.0	25,532	△1.6	96.1	24.0
④	257期(2024年1月15日)	8,777	10	2.1	26,250	2.8	96.7	26.3
	258期(2024年2月15日)	8,912	10	1.7	26,634	1.5	98.4	29.0
	259期(2024年3月15日)	8,873	10	△0.3	26,621	△0.0	98.9	30.5
	260期(2024年4月15日)	9,036	10	1.9	27,084	1.7	98.6	25.0
	261期(2024年5月15日)	9,284	10	2.9	27,860	2.9	96.6	25.7
	262期(2024年6月17日)	9,415	10	1.5	28,297	1.6	98.7	25.7
⑤	263期(2024年7月16日)	9,562	10	1.7	28,867	2.0	95.6	36.5
	264期(2024年8月15日)	9,119	10	△4.5	27,637	△4.3	97.2	40.1
	265期(2024年9月17日)	8,873	10	△2.6	26,911	△2.6	97.9	30.1
	266期(2024年10月15日)	9,208	10	3.9	27,851	3.5	95.6	37.0
	267期(2024年11月15日)	9,422	10	2.4	28,219	1.3	96.0	38.0
	268期(2024年12月16日)	9,317	10	△1.0	28,299	0.3	99.0	51.0

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ベンチマーク(ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス(除く日本、円ベース))は、2002年6月28日を10,000として指数化しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

(注4) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率、債券先物比率は、実質比率を記載しております。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	債 券 組 入 比	債 券 先 物 比
第263期	(期首)2024年6月17日	円 9,415	% —	28,297	% —	% 98.7	% 25.7
	6月末	9,587	1.8	28,760	1.6	96.9	29.9
	(期末)2024年7月16日	9,572	1.7	28,867	2.0	95.6	36.5
第264期	(期首)2024年7月16日	9,562	—	28,867	—	95.6	36.5
	7月末	9,235	△3.4	27,530	△4.6	95.5	39.8
	(期末)2024年8月15日	9,129	△4.5	27,637	△4.3	97.2	40.1
第265期	(期首)2024年8月15日	9,119	—	27,637	—	97.2	40.1
	8月末	8,991	△1.4	27,209	△1.5	96.2	46.1
	(期末)2024年9月17日	8,883	△2.6	26,911	△2.6	97.9	30.1
第266期	(期首)2024年9月17日	8,873	—	26,911	—	97.9	30.1
	9月末	9,008	1.5	27,173	1.0	97.0	40.4
	(期末)2024年10月15日	9,218	3.9	27,851	3.5	95.6	37.0
第267期	(期首)2024年10月15日	9,208	—	27,851	—	95.6	37.0
	10月末	9,363	1.7	28,070	0.8	95.9	35.0
	(期末)2024年11月15日	9,432	2.4	28,219	1.3	96.0	38.0
第268期	(期首)2024年11月15日	9,422	—	28,219	—	96.0	38.0
	11月末	9,162	△2.8	27,760	△1.6	96.3	43.0
	(期末)2024年12月16日	9,327	△1.0	28,299	0.3	99.0	51.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

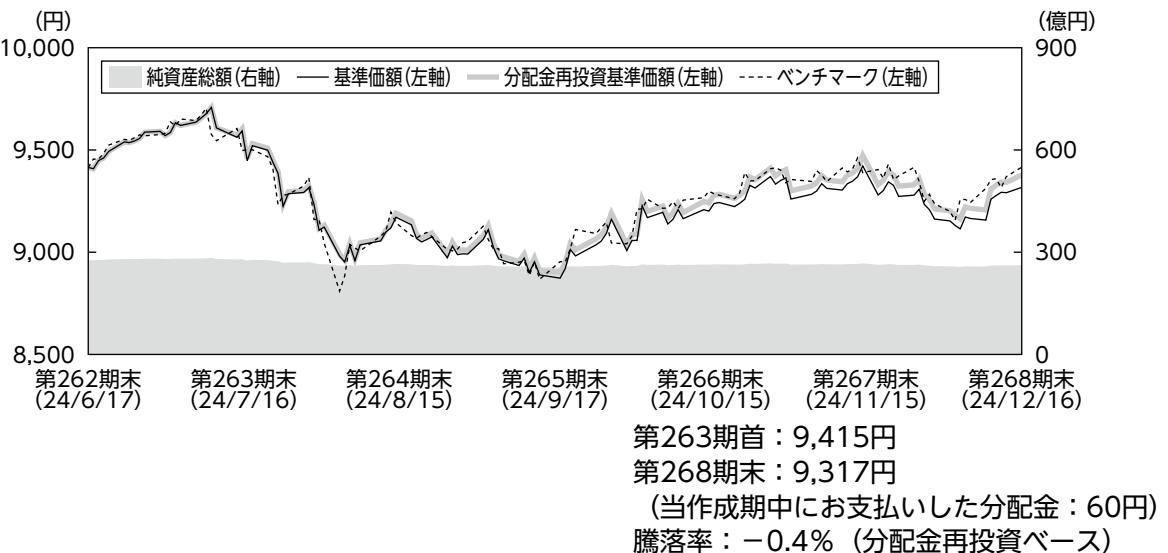
(注2) ベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、円ベース））は、2002年6月28日を10,000として指数化しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注4) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率、債券先物比率は、実質比率を記載しております。

■運用経過

◆基準価額等の推移について（2024年6月18日～2024年12月16日）



(注1) ベンチマークはブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、円ベース）です。

(注2) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注3) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

(注4) 分配金再投資基準価額、ベンチマークは、当成期（以下、「当期」といいます。）の期首の基準価額を起点として指数化しています。

(注5) 謄落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

◆基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の9,415円から98円下落し、期末には9,317円となりました。

上昇要因

主要投資対象となっている欧州（ドイツ）の国債利回りが低下（価格は上昇）したことや、保有する債券からの利息収入などが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

主要投資対象となっている米ドルやユーロなどが対円で下落したことや、分配金をお支払いしたことなどが、基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境について

<外国債券市場>

当期は、米国の10年国債利回りが前期末から上昇（価格は下落）した一方で、ドイツの10年国債利回りは前期末から低下（価格は上昇）しました。

米国では、期の前半は、2024年9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）での利下げを織り込む形で、利回りが低下しました。しかし、期の後半は、雇用統計をはじめ一部の景気指標が市場予想を上回ったことや、米大統領選挙の結果を受けて投資家のリスク選好度が高まったことなどを背景に利回りが上昇し、前期末対比で上昇した水準で期末を迎えました。ユーロ圏では、期の前半は、フランスを中心とした欧州の政治情勢に対する懸念などに加えて、域内経済に対する先行き不透明感などを背景に利回りは低下しました。期の後半は、一部の景気指標が市場予想を上回ったことなどを背景に、利回りは上昇しましたが、前期末対比では低下した水準で期末を迎えました。

非国債セクターについて、社債市場では期中発表された決算内容から良好な企業ファンダメンタルズが確認されたこと、利回りを求める投資家の需要が継続したことなどを背景に、前期末対比ではスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小する展開となりました。

<外国為替市場>

当期は、米ドル、ユーロなどが対円で下落しました。

日銀が2024年7月末の金融政策決定会合で追加利上げを決定した一方でFRB（米連邦準備制度理事会）が利下げを開始したことで、日米短期金利差の縮小が意識されたことや、米国やドイツの一部の景気指標が弱含んだことなどが、米ドル安およびユーロ安要因となりました。

◆ポートフォリオについて

<本ファンド>

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンドの組入れを高位に維持することにより、日本を除く世界各国の国債、政府関係機関債、社債、モーゲージ証券、アセットバック証券等に分散投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

<本マザーファンド>

債券

期首においては、デュレーション戦略における米国の金利デュレーションの長期化ポジション、国別配分戦略における英国やカナダのオーバーウェイトに対する欧州（ドイツ）のアンダーウェイト、セクター配分戦略における証券化商品や社債のオーバーウェイトなどが、主要なポジションとなっていました。

期末においては、デュレーション戦略における米国の金利デュレーションの長期化ポジション、国別配分戦略における英国やオーストラリア、カナダのオーバーウェイトに対する米国や欧州（ドイツ）のアンダーウェイト、セクター配分戦略における証券化商品や社債のオーバーウェイトなどが、主要なポジションとなっています。

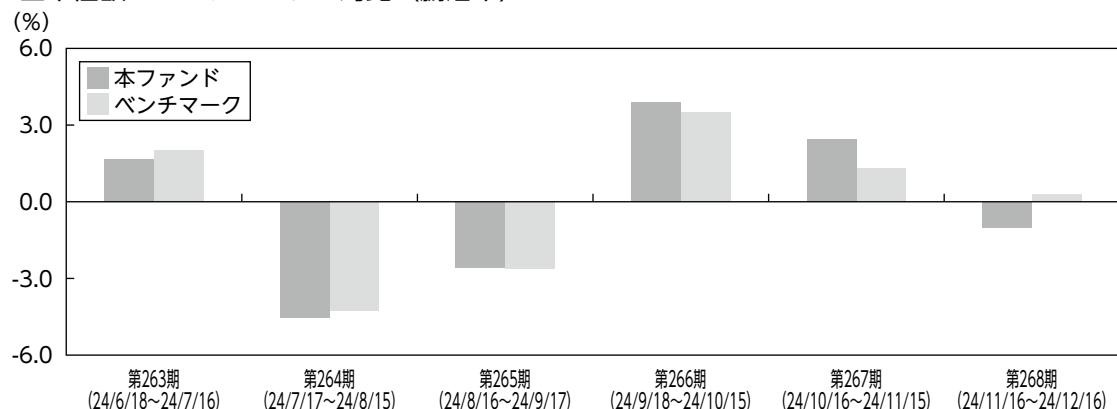
通貨

期首においては、米ドルやユーロなどをオーバーウェイトとする一方で、ニュージーランド・ドルやスイス・フランなどをアンダーウェイトとしていました。

期末においては、米ドルやノルウェー・クローネなどをオーバーウェイトとする一方で、英ポンドやカナダ・ドルなどをアンダーウェイトとしました。

◆ベンチマークとの差異について

<当期の基準価額とベンチマークの対比（騰落率）>



(注1) 基準価額の騰落率は収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

(注2) ベンチマークはブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、円ベース）です。

当期の本ファンドのパフォーマンス（分配金再投資ベース）は-0.4%となり、ベンチマーク (+0.0%) を下回りました。

当期は、国別配分戦略などがマイナス寄与となったものの、デュレーション戦略、セクター配分戦略や証券化商品の個別銘柄選択などがプラス寄与となりました。デュレーション戦略においては、米国の短中期セクターの金利デュレーションの長期化ポジションなどがプラスに寄与しました。また、証券化商品戦略においては、CMB S（商業用不動産担保証券）の個別銘柄選択などがプラスに寄与しました。一方で、国別配分戦略においては、英国のオーバーウェイトに対する欧州（ドイツ）のアンダーウェイトなどがマイナスに寄与しました。

◆分配金について

収益分配金（1万口当たり、税引前）については、分配方針および基準価額の水準などを勘案し、第263期から第268期は各10円としました。収益分配金に充てなかった収益については、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

今後の運用方針について

<本ファンド>

今後も引き続き本マザーファンド受益証券を高位に組入れ、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目標として運用を行います。

<本マザーファンド>

今後も日本を除く世界各国の投資適格債券への分散投資を通じて、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

当社の投資戦略に関して、金利戦略では各国の金融政策の乖離などを投資テーマとし、引き続き機動的にポジションを動かす方針です。セクター配分戦略では社債、証券化商品などをオーバーウェイトとしています。通貨配分戦略では、米ドルなどをオーバーウェイトとする一方、英ポンドなどをアンダーウェイトとしています。景気が想定以上に悪化するリスク・シナリオも検討しつつ、リターンとリスクのバランスを重視し選択的・柔軟な運用を行うことで、市場の不確実性も勘案したポートフォリオ運営を行う方針です。

(上記見通しは2024年12月16日現在のものであり、今後見通しは変更されることがあります。)

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第263期～第268期		項目の概要	
	2024年6月18日～2024年12月16日			
	金額	比率		
信託報酬 (投信会社)	53円 (25)	0.576% (0.274)	信託報酬＝期中の平均基準価額 × 信託報酬率 ファンドの運用、受託会社への指図、基準価額の算出、目論見書・運用報告書等の作成等の対価	
(販売会社)	(25)	(0.274)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、分配金・換金代金・償還金の支払い業務等の対価	
(受託会社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価	
売買委託手数料 (先物・オプション)	2 (2)	0.017 (0.017)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数	
その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	1 (0) (0) (1)	0.014 (0.005) (0.003) (0.006)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用	
合計	56	0.607		
期中の平均基準価額は9,224円です。				

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む。）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、本ファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、本ファンドに対応するものを含みます。

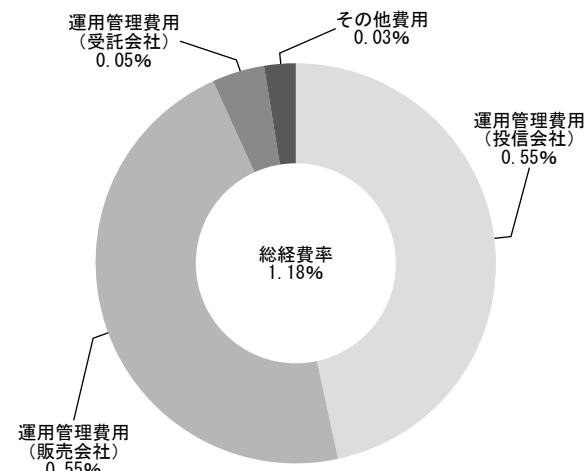
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.18%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

ゴールドマン・サックス毎月分配債券ファンド

■売買及び取引の状況（2024年6月18日から2024年12月16日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

決算期	第263期～第268期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド	千口 27,088	千円 86,172	千口 502,530	千円 1,594,210

■利害関係人との取引状況等（2024年6月18日から2024年12月16日まで）

利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細（2024年12月16日現在）

親投資信託残高

種類	第262期末	第268期末	
	口数	口数	評価額
グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド	千口 8,629,995	千口 8,154,553	千円 26,229,935

■投資信託財産の構成

2024年12月16日現在

項目	第268期末	
	評価額	比率
グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド	千円 26,229,935	% 99.9
コール・ローン等、その他	37,570	0.1
投資信託財産総額	26,267,505	100.0

(注1) グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（28,570,752千円）の投資信託財産総額（29,834,335千円）に対する比率は95.8%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。なお決算日における邦貨換算レートは1オフショア人民元=21.1403円、1米ドル=153.92円、1カナダドル=108.23円、1メキシコペソ=7.6575円、1ユーロ=161.91円、1英ポンド=194.45円、1スイスフラン=172.63円、1スウェーデンクローナ=14.05円、1ノルウェークローネ=13.82円、1デンマーククローネ=21.71円、1チェココルナ=6.4667円、1ハンガリーフォリント=0.395166円、1ポーランドズロチ=37.9817円、1オーストラリアドル=98.03円、1ニュージーランドドル=88.81円、1マレーシアリンギット=34.5708円、1タイバーツ=4.51円、1インドネシアルピア=0.0097円、1韓国ウォン=0.1074円、1イスラエルシェケル=42.7301円、1南アフリカランド=8.62円です。

ゴールドマン・サックス毎月分配債券ファンド

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第263期末	第264期末	第265期末	第266期末	第267期末	第268期末
	2024年7月16日	2024年8月15日	2024年9月17日	2024年10月15日	2024年11月15日	2024年12月16日
(A) 資産	27,945,811,081円	26,482,497,451円	25,606,238,020円	26,427,631,771円	26,809,096,556円	26,267,505,230円
グローバル・アグリゲート(除く日本)マザーファンド(評価額)	27,931,042,966	26,471,265,722	25,583,347,313	26,409,818,402	26,787,358,071	26,229,935,623
未収入金	14,768,115	11,231,729	22,890,707	17,813,369	21,738,485	37,569,607
(B) 負債	69,980,081	66,058,231	79,242,142	69,926,313	76,535,381	91,748,458
未払収益分配金	29,153,115	28,968,916	28,768,392	28,625,677	28,371,645	28,094,231
未払解約金	14,768,115	11,231,729	22,890,707	17,813,369	21,738,485	37,569,607
未払信託報酬	25,692,544	25,491,013	27,192,006	23,116,905	25,972,597	25,637,801
その他未払費用	366,307	366,573	391,037	370,362	452,654	446,819
(C) 純資産総額(A-B)	27,875,831,000	26,416,439,220	25,526,995,878	26,357,705,458	26,732,561,175	26,175,756,772
元本	29,153,115,517	28,968,916,261	28,768,392,535	28,625,677,889	28,371,645,859	28,094,231,002
次期繰越損益金	△1,277,284,517	△2,552,477,041	△3,241,396,657	△2,267,972,431	△1,639,084,684	△1,918,474,230
(D) 受益権総口数	29,153,115,517口	28,968,916,261口	28,768,392,535口	28,625,677,889口	28,371,645,859口	28,094,231,002口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,562円	9,119円	8,873円	9,208円	9,422円	9,317円

(注) 当作成期首元本額は29,366,699,604円、当作成期間（第263期～第268期）中において、追加設定元本額は92,827,545円、同解約元本額は1,365,296,147円です。

■損益の状況

項目	第263期	第264期	第265期	第266期	第267期	第268期
	自2024年6月18日 至2024年7月16日	自2024年7月17日 至2024年8月15日	自2024年8月16日 至2024年9月17日	自2024年9月18日 至2024年10月15日	自2024年10月16日 至2024年11月15日	自2024年11月16日 至2024年12月16日
(A) 有価証券売買損益	484,651,585円	△1,228,202,317円	△650,182,375円	1,009,376,687円	663,450,343円	△241,125,119円
売買益	489,805,793	6,673,959	2,342,088	1,013,048,867	667,353,088	4,846,187
売買損	△5,154,208	△1,234,876,276	△652,524,463	△3,672,180	△3,902,745	△245,971,306
(B) 信託報酬等	△26,058,851	△25,857,586	△27,583,043	△23,487,267	△26,425,251	△26,084,620
(C) 当期損益金(A+B)	458,592,734	△1,254,059,903	△677,765,418	985,889,420	637,025,092	△267,209,739
(D) 前期繰越損益金	1,853,845,161	2,267,533,769	977,131,981	269,156,971	1,214,749,645	1,804,856,090
(E) 追加信託差損益金	△3,560,569,297	△3,536,981,991	△3,511,994,828	△3,494,393,145	△3,462,487,776	△3,428,026,350
(配当等相当額)	(146,856,951)	(147,313,821)	(147,682,070)	(147,854,673)	(148,103,219)	(147,642,553)
(売買損益相当額)	(△3,707,426,248)	(△3,684,295,812)	(△3,659,676,898)	(△3,642,247,818)	(△3,610,590,995)	(△3,575,668,903)
(F) 計(C+D+E)	△1,248,131,402	△2,523,508,125	△3,212,628,265	△2,239,346,754	△1,610,713,039	△1,890,379,999
(G) 収益分配金	△29,153,115	△28,968,916	△28,768,392	△28,625,677	△28,371,645	△28,094,231
次期繰越損益金(F+G)	△1,277,284,517	△2,552,477,041	△3,241,396,657	△2,267,972,431	△1,639,084,684	△1,918,474,230
追加信託差損益金	△3,560,569,297	△3,536,981,991	△3,511,994,828	△3,494,393,145	△3,462,487,776	△3,428,026,350
(配当等相当額)	(146,917,756)	(147,387,970)	(147,736,698)	(147,886,264)	(148,138,879)	(147,696,454)
(売買損益相当額)	(△3,707,487,053)	(△3,684,369,961)	(△3,659,731,526)	(△3,642,279,409)	(△3,610,626,655)	(△3,575,722,804)
分配準備積立金	2,283,284,780	2,318,454,999	2,329,758,994	2,381,446,240	2,418,315,834	2,422,022,336
繰越損益金	-	△1,333,950,049	△2,059,160,823	△1,155,025,526	△594,912,742	△912,470,216

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 収益分配金の計算過程において、マザーファンドの配当等収益を繰入れております。

■分配金のお知らせ

決算期	第263期	第264期	第265期	第266期	第267期	第268期
1万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

- ◇分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。
- ◇分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ◇税率は、個人の受益者については原則20.315%（所得税15.315%、地方税5%）です。ただし、外国税額控除の適用となった場合には、軽減される場合があります。
- ◇税法が改正された場合等には、上記内容が変更になる場合もあります。

■分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項目	第263期	第264期	第265期	第266期	第267期	第268期
	2024年6月18日 ～2024年7月16日	2024年7月17日 ～2024年8月15日	2024年8月16日 ～2024年9月17日	2024年9月18日 ～2024年10月15日	2024年10月16日 ～2024年11月15日	2024年11月16日 ～2024年12月16日
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.104	0.110	0.113	0.108	0.106	0.107
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	833	851	861	883	904	914

(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（税引前）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（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの收益率とは異なります。

グローバル・アグリゲート (除く日本)マザーファンド

親投資信託

第22期(決算日2024年6月17日)

作成対象期間:2023年6月16日～2024年6月17日

■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	親投資信託
信託期間	原則として無期限
運用方針	日本を除く世界各国の投資適格債券への分散投資を通じて、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。
主要投資対象	日本を除く世界各国の国債、政府関係機関債、社債、モーゲージ証券、アセットバック証券等
組入制限	①外貨建資産への組入れについては制限を設けません。 ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。法令・諸規則に基づき、親投資信託(マザーファンド)の期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期騰中落率			債券組入率	債券先物率	純資産額
			ベンチマーク	期騰中落率			
18期(2020年6月15日)	円 23,331	% 6.5	21,173	% 5.4	% 103.0	% 7.1	百万円 35,685
19期(2021年6月15日)	25,740	10.3	22,692	7.2	102.0	16.6	37,817
20期(2022年6月15日)	25,913	0.7	23,198	2.2	97.8	16.6	32,839
21期(2023年6月15日)	27,386	5.7	24,457	5.4	97.5	23.7	33,892
22期(2024年6月17日)	32,104	17.2	28,297	15.7	98.5	25.6	31,712

(注1) ベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、円ベース））は、2002年6月28日を10,000として指数化しております。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

■当期中の基準価額と市況推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入率	債券先物率
(期首) 2023年6月15日	円 27,386	% —	24,457	% —	% 97.5	% 23.7
6月末	28,238	3.1	25,111	2.7	98.7	26.8
7月末	27,772	1.4	24,873	1.7	97.8	28.6
8月末	28,515	4.1	25,197	3.0	96.3	28.2
9月末	28,282	3.3	25,079	2.5	100.6	26.2
10月末	28,015	2.3	25,206	3.1	98.3	25.5
11月末	29,144	6.4	25,858	5.7	96.6	22.4
12月末	29,205	6.6	25,649	4.9	96.6	26.6
2024年1月末	29,917	9.2	26,321	7.6	97.7	26.6
2月末	30,287	10.6	26,635	8.9	98.9	29.8
3月末	30,737	12.2	27,137	11.0	98.5	32.5
4月末	31,274	14.2	27,582	12.8	97.7	25.0
5月末	31,558	15.2	27,989	14.4	95.4	31.2
(期末) 2024年6月17日	32,104	17.2	28,297	15.7	98.5	25.6

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) ベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、円ベース））は、2002年6月28日を10,000として指数化しております。

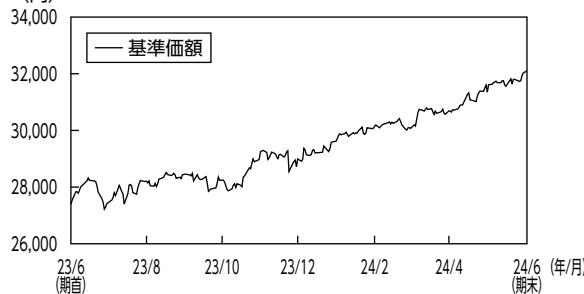
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

■運用経過

◆基準価額の推移について

(2023年6月16日～2024年6月17日)

(円)



◆基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の27,386円から4,718円上昇し、期末には32,104円となりました。

上昇要因

主要投資対象通貨である米ドルやユーロが対円で上昇したことや、保有する債券からの利息収入などが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米国の国債利回りが上昇（価格は下落）したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境について

<外国債券市場>

当期は、米国10年国債利回りが上昇（価格は下落）した一方で、ドイツ10年国債利回りが低下（価格は上昇）しました。

米国では、期の序盤は事前予想を上回る経済指標が発表され、景気回復への期待が高まつたことなどから利回りは上昇しました。また、F R B（米連邦準備制度理事会）高官による利上げの長期化を示唆する発言なども利回り上昇要因となりました。期の中盤にかけては、インフレに対する懸念が後退し2024年以降の利下げ期待が意識され、利回りが低下する展開となりました。期の終盤にかけては、事前予想を上回るインフレ関連指標が発表されたことなどを背景に、利下げ開始時期が後ずれするとの見方が広がり米国10年国債利回りは上昇基調に転じ、結局前期末対比で上昇した水準で期末を迎えました。一方でユーロ圏では、欧州経済の先行きに対する悲観的な見方が強まつたことや、E C B（欧州中央銀行）の利下げ観測が高まるなかドイツ10年国債利回りが前期末対比で低下する展開となりました。なお、E C Bは2024年6月6日に開催した理事会で主要政策金利の0.25%引き下げを決定しました。

非国債セクターについて、社債市場では2023年10月に中東情勢が緊迫化した局面などでスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大しましたが、発表された決算内容から良好な企業ファンダメンタルズが確認されたこと、利回りを求める投資家の需要が継続したことなどを背景に、前期末対比ではスプレッドが縮小する展開となりました。

<外国為替市場>

当期は、米ドルやユーロなどが対円で上昇しました。

米ドルは、米国の政策金利の高止まりが長期化し、金融緩和を継続する日銀との政策の違いが意識されたことに加え、米国で発表された経済指標が好調だったことなどから対円で上昇する展開となりました。急速に円安が進んだ2024年4月から5月にかけて、日本政府・日銀が円買いドル売り介入を行つたことで、一旦は円高米ドル安に触れましたが、傾向は変わらず、期末にかけては再び円安基調となりました。

ユーロについても、日本との金利差が意識され、円を売つてユーロを買う傾向が高まり、前期末比で円安ユーロ高となる水準で期末を迎えました。

◆ポートフォリオについて

債券

期首においては、デュレーション戦略における英国や欧州（ドイツ）の金利デュレーションの長期化ポジション、国別配分戦略における米国やオーストラリアのオーバーウェイトに対するカナダや欧州（ドイツ）のアンダーウェイト、セクター配分戦略における社債のオーバーウェイトなどが、主要なポジションとなっていました。期末においては、デュレーション戦略における米国の金利デュレーションの長期化ポジション、国別配分戦略における英国やカナダのオーバーウェイトに対する欧州（ドイツ）のアンダーウェイト、セクター配分戦略における証券化商品や社債のオーバーウェイトなどが、主要なポジションとなっています。

通貨

期首においては、米ドルやユーロなどをオーバーウェイトとする一方で、日本円やスウェーデン・クローナなどをアンダーウェイトとしていました。期末においては、米ドルやユーロなどをオーバーウェイトとする一方で、ニュージーランド・ドルやスイス・フランなどをアンダーウェイトとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当期の本ファンドのパフォーマンスは+17.2%となり、ベンチマーク（+15.7%）を上回りました。

当期は、証券化商品戦略などがマイナス寄与となったものの、セクター配分戦略や通貨配分戦略、社債の個別銘柄選択などがプラス寄与となりました。セクター配分戦略においては、社債やCLO（ローン担保証券）、CMB S（商業用不動産担保証券）のオーバーウェイトが主なプラス要因となりました。社債の個別銘柄戦略では、BBB格を選好していたことなどが奏功しました。また、国別配分戦略においては英国のオーバーウェイトに対する欧州（ドイツ）のアンダーウェイトなどがプラスに寄与しました。一方で、証券化商品戦略においては、CMB Sの個別銘柄選択などが主なマイナス要因となりました。

◆今後の運用方針について

今後も日本を除く世界各国の投資適格債券への分散投資を通じて、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

当社の投資戦略に関して、金利戦略では各国の金融政策の乖離などを投資テーマとし、引き続き機動的にポジションを動かす方針です。セクター配分戦略では社債、証券化商品などをオーバーウェイトとしています。通貨配分戦略では、米ドルなどをオーバーウェイトとする一方、スイス・フランなどをアンダーウェイトとしています。景気が想定以上に悪化するリスク・シナリオも検討しつつ、リターンとリスクのバランスを重視し選択的・柔軟な運用を行うことで、市場の不確実性も勘案したポートフォリオ運営を行う方針です。

（上記見通しは2024年6月17日現在のものであり、今後見通しは変更されることもあります。）

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要	
	2023年6月16日～2024年6月17日			
	金額	比率		
売買委託手数料 (先物・オプション)	4円 (4)	0.014% (0.014)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数	
その他費用 (保管費用) (その他)	7 (3) (3)	0.023 (0.011) (0.012)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 信託事務処理等に要するその他の諸費用	
合計	11	0.037		
期中の平均基準価額は29,412円です。				

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

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

■ 売買及び取引の状況（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

(1) 公社債

		買付額	売付額
外 アメリカ	国債証券	千米ドル 127,210	千米ドル 129,026
	地方債証券	—	(215)
	特殊債券	4,870	(22,826 4,377)
	社債券(投資法人債券を含む)	51,296	(34,578 5,668)
ユ ニ テ ー ス 国 口	ドイツ	千ユーロ 1,659	千ユーロ 1,683
	イタリア	国債証券 —	3,875
		社債券(投資法人債券を含む) 120	691
	フランス	国債証券 3,538	10,338
		社債券(投資法人債券を含む) 2,082	2,978
	オランダ	社債券(投資法人債券を含む) 2,698	2,947
	スペイン	社債券(投資法人債券を含む) 1,092	1,324
	ベルギー	社債券(投資法人債券を含む) 463	264
	オーストリア	社債券(投資法人債券を含む) 203	206
	ルクセンブルク	社債券(投資法人債券を含む) 182	(491 575)
	フィンランド	社債券(投資法人債券を含む) 197	226
	アイルランド	社債券(投資法人債券を含む) 888	(1,120 297)
	その他	社債券(投資法人債券を含む) 3,294	(3,959 450)

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

			買付額	売付額
外 国	イギリス	国債証券	千英ポンド	千英ポンド
		社債券(投資法人債券を含む)	1,444	(6,373 2,196)
外 国	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 1,647	千ポーランドズロチ —
		国債証券	千インドネシアルピア 5,307,311	千インドネシアルピア 8,433,045
外 国	中国オフショア	国債証券	千オフショア人民元 26,134	千オフショア人民元 28,241

(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) その他には、ユーロ参加国以外の国に属する発行体が発行するユーロ建の公社債が含まれます。

(2) 先物取引の銘柄別取引状況

		新規買付額	買建		新規売付額	決済額	売建
			百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
外 国	債券先物取引	米国国債先物ウルトラ10年	492	490	6,833	6,982	
		米国国債先物10年	25,847	23,676	607	607	
		米国国債先物2年	8,308	9,884	4,397	3,598	
		米国国債先物20年	7,605	6,204	328	330	
		米国国債先物30年	5,778	6,972	2,194	1,789	
		米国国債先物5年	28,726	30,032	—	—	
		カナダ国債先物10年	1,123	676	1,187	1,490	
		オーストラリア国債先物10年	3,981	4,378	21	21	
		オーストラリア国債先物3年	4,320	4,213	153	213	
		英國国債先物10年	2,404	1,820	487	489	
		ドイツ国債先物5年	9,454	9,351	444	441	
		イタリア国債先物10年	1,624	1,048	—	—	
		ドイツ国債先物10年	2,424	2,745	5,838	5,126	
		ドイツ国債先物30年	1,451	1,625	22	21	
		フランス国債先物10年	3,841	4,306	—	—	
		ドイツ国債先物2年	8,742	8,026	—	—	
		S O F R 先物3ヶ月	3,817	4,140	—	—	
		S O N I A 先物3ヶ月	15,852	17,254	—	4,089	
		ユーロ金利先物3ヶ月	—	—	19,180	16,084	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 外国の取引金額は、各月中の取引額を当該月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(3) スワップ及び先渡取引契約金額

種 類	当 取 引 契 約 金 額	期
		百 万 円
直 物 為 替 先 渡 取 引		2,045

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 外国の取引契約金額は、各月中の取引における想定元本金額を当該月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■主要な売買銘柄（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

公社債

買		当 期	
銘	柄	付	売
US TREASURY N/B 0.625%	30/5/15	千円 826,865	FRENCH DISCOUNT T-BILL 0% 23/7/19 1,506,048
US TREASURY N/B 4%	28/6/30	819,943	FREDDIE MAC 6.75% 31/3/15 861,200
US TREASURY N/B 3.75%	30/6/30	816,197	US TREASURY N/B 0.625% 30/5/15 851,864
US TREASURY N/B 4%	31/1/31	782,738	US TREASURY N/B 4% 28/6/30 820,707
US TREASURY N/B 4.625%	30/9/30	777,097	US TREASURY N/B 3.75% 30/6/30 814,809
US TREASURY N/B 4%	29/1/31	775,670	US TREASURY N/B 4% 31/1/31 784,562
US TREASURY N/B 4.125%	30/8/31	773,718	US TREASURY N/B 4.625% 30/9/30 780,012
US TREASURY N/B 4.625%	28/9/30	772,164	US TREASURY N/B 4% 29/1/31 776,252
US TREASURY N/B 4.375%	28/8/31	771,078	US TREASURY N/B 3.75% 30/12/31 775,325
US TREASURY N/B 4.375%	30/11/30	766,605	US TREASURY N/B 4.375% 28/8/31 771,755

(注) 金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

■利害関係人との取引状況等（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細（2024年6月17日現在）

(1) 公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区分	当期						期末		
	額面金額	評価額	邦貨換算金額	組入比率	うちB級以下組入比率	残存期間別組入比率	5年以上	2年以上	2年末満
アメリカ	千米ドル 128,719	千米ドル 123,848	千円 19,509,913	61.5%	1.2%	47.3%	13.2%	—	1.1%
カナダ	千カナダドル 3,750	千カナダドル 3,868	443,677	1.4	—	1.4	—	—	—
メキシコ	千メキシコペソ 12,806	千メキシコペソ 12,544	106,767	0.3	—	0.3	—	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	—	—	—	—	—	—	—
ドイツ	1,300	1,303	219,855	0.7	0.1	0.5	0.2	—	—
イタリア	1,465	1,141	192,430	0.6	0.1	0.6	—	—	—
フランス	6,006	5,931	1,000,215	3.2	0.1	2.9	0.3	—	—
オランダ	2,646	2,604	439,199	1.4	—	0.8	0.4	0.1	—
スペイン	5,256	4,987	841,042	2.7	—	1.2	1.5	—	—
ベルギー	1,702	1,540	259,745	0.8	—	0.8	0.1	—	—
オーストリア	1,260	1,195	201,688	0.6	—	0.1	0.3	0.3	0.3
ルクセンブルク	1,150	1,091	184,082	0.6	—	0.1	0.3	0.2	—
フィンランド	835	789	133,089	0.4	—	0.4	—	—	—
アイルランド	2,406	2,220	374,514	1.2	0.1	1.1	0.1	—	—
ポルトガル	930	894	150,781	0.5	—	—	0.5	—	—
その他	10,639	10,249	1,728,456	5.5	—	3.8	1.1	0.6	—
イギリス	千英ポンド 6,798	千英ポンド 6,152	1,229,771	3.9	0.1	1.4	0.6	1.9	—
スイス	千スイスフラン 660	千スイスフラン 592	104,832	0.3	—	0.3	—	—	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 4,860	千スウェーデンクローナ 4,702	70,402	0.2	—	0.2	—	—	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,520	千デンマーククローネ 1,881	42,520	0.1	—	0.1	—	—	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,590	千ポーランドズロチ 1,620	62,414	0.2	—	0.2	—	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 2,860	千マレーシアリンギット 2,849	95,040	0.3	—	0.3	—	—	—
タイ	千タイバーツ 30,800	千タイバーツ 33,063	141,843	0.4	—	0.4	—	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 11,122,000	千インドネシアルピア 11,367,377	109,126	0.3	—	0.3	—	—	—
韓国	千韓国ウォン 5,734,610	千韓国ウォン 5,361,300	612,796	1.9	—	0.2	1.7	—	—
イスラエル	千イスラエルシェケル 1,000	千イスラエルシェケル 771	32,674	0.1	—	0.1	—	—	—
中国オフショア	千オフショア人民元 127,720	千オフショア人民元 135,473	2,934,078	9.3	—	4.8	3.6	0.9	—
合計	—	—	31,220,962	98.5	1.7	69.7	23.7	5.1	—

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) その他には、ユーロ参加国以外の国に属する発行体が発行するユーロ建の公社債が含まれます。

B 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債

種類	銘柄名	利率	額面金額	当期末		償還年月日
				評価額	外貨建金額	
国債証券	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル		千円
	HUNGARY 3.125%	3.125	560	354	55,797	2051/9/21
	HUNGARY 5.5%	5.5	200	194	30,619	2034/6/16
	HUNGARY 6.125%	6.125	200	203	32,126	2028/5/22
	INDONESIA REP 3.85%	3.85	280	269	42,454	2027/7/18
	ROMANIA 3%	3.0	100	92	14,615	2027/2/27
	ROMANIA 6.125%	6.125	200	190	30,039	2044/1/22
	ROMANIA 6.375%	6.375	90	90	14,177	2034/1/30
	SAUDI INTL BOND 4.5%	4.5	200	164	25,884	2060/4/22
	UNITED MEXICAN 3.75%	3.75	200	122	19,297	2071/4/19
	UNITED MEXICAN 3.771%	3.771	560	350	55,135	2061/5/24
	UNITED MEXICAN 4.75%	4.75	200	186	29,359	2032/4/27
	CALIFORNIA ST 7.625%	7.625	3,000	3,641	573,640	2040/3/1
	ILLINOIS ST 6.725% SINK	6.725	2,369	2,510	395,448	2035/4/1
	AFRICAN EXPORT 2.634%	2.634	200	187	29,508	2026/5/17
地方債証券	AFRICAN EXPORT 3.798%	3.798	200	171	27,007	2031/5/17
	CAS 2021-R01 1M2	6.87374	146	147	23,205	2041/10/25
	CAS 2021-R03 1M2	6.97374	133	133	21,089	2041/12/25
	CAS 2023-R03 2M2	9.22374	100	107	16,984	2043/4/25
	CAS 2023-R05 1M2	8.42374	100	105	16,606	2043/6/25
	CAS 2023-R08 1M2	7.82374	205	212	33,404	2043/10/25
	CAS 2024-R02 1M2	7.12374	475	477	75,240	2044/2/25
	CAS 2024-R04 1M2	6.97374	150	150	23,673	2044/5/25
	EXP-IMP BK KOREA 5%	5.0	200	202	31,833	2028/1/11
	FG A46278	5.0	29	30	4,726	2035/7/1
	FG A83883	5.0	9	9	1,549	2034/11/1
	FG A85726	5.0	49	49	7,860	2039/4/1
	FG A87812	5.0	41	41	6,537	2039/8/1
	FG C01492	5.0	26	26	4,162	2033/2/1
	FG G08341	5.0	57	58	9,170	2039/4/1
	FGLMC G01981	5.0	1	1	275	2035/12/1
	FGTW D96866	5.5	1	1	259	2025/11/1
	FHMS KF153 AS	6.00742	276	275	43,399	2033/2/25
	FHR 2338 ZC	6.5	81	83	13,080	2031/7/15
	FHR 2343 ZU	6.5	164	167	26,395	2031/8/15
	FHR 2755 ZA	5.0	190	190	29,987	2034/2/15
	FHR 3001 PD	4.5	7	7	1,179	2025/7/15
特殊債券(除く金融債)	FN 934943	4.5	4	4	716	2039/9/1
	FN AA4666	4.5	3	3	486	2039/5/1
	FN AA7452	4.5	4	4	768	2039/5/1
	FN AA8266	4.5	5	5	916	2039/6/1
	FN AC1579	4.5	24	23	3,756	2039/8/1
	FN AI8842	4.5	17	16	2,653	2041/8/1
	FN AL9105	4.5	114	111	17,562	2046/10/1
	FN A02310	3.0	17	16	2,543	2042/12/1
	FN AP8670	3.0	5	4	713	2043/1/1
	FN AQ0667	3.0	10	9	1,476	2042/11/1
	FN AQ2101	3.0	9	8	1,386	2042/12/1

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		利	率	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
特殊債券(除く金融債)	FN AQ2895	3.0		28	25	4,039
	FN A04055	3.0		58	52	8,315
	FN A05701	3.0		14	12	2,022
	FN A06570	3.0		12	11	1,805
	FN A07146	3.0		47	42	6,713
	FN A07310	3.0		34	31	4,898
	FN A07988	3.0		5	5	832
	FN A08330	3.0		24	22	3,493
	FN A08656	3.0		31	28	4,535
	FN A09120	3.0		11	10	1,605
	FN A09317	3.0		94	85	13,428
	FN A09691	3.0		28	25	3,999
	FN A09855	3.0		6	6	954
	FN AR1389	3.0		19	17	2,763
	FN AR2041	3.0		17	16	2,548
	FN AR3419	3.0		7	6	1,064
	FN AR3468	3.0		5	4	770
	FN AR3489	3.0		10	9	1,557
	FN AR3942	3.0		12	11	1,792
	FN AR6313	3.0		24	21	3,449
	FN AR9653	3.0		39	35	5,569
	FN AT0654	3.0		135	121	19,206
	FN AT1751	3.0		106	95	15,112
	FN AY3890	4.5		7	7	1,224
	FN BM3280	4.5		449	437	68,980
	FN BM5538	5.0		273	272	42,909
	FN CA2364	4.5		243	236	37,331
	FN CB4692	5.5		1,406	1,413	222,649
	FN FM7418	2.5		2,074	1,735	273,469
	FN FM8691	2.5		815	683	107,693
	FN MA4492	2.0		4,327	3,428	540,152
	FNCL AC2861	4.5		9	8	1,407
	FNR 1998-59 Z	6.5		11	11	1,795
	FNR 2005-45 BE	4.5		1	1	216
	FNR 2012-111 B	7.0		39	41	6,609
	FNR 2012-153 B	7.0		151	162	25,594
	FR RA5801	2.5		791	662	104,402
	FR SD7531	3.0		1,178	1,034	162,930
	G2 81179	3.75		241	237	37,362
	G2 MA5138	4.5		95	92	14,603
	G2 MA5193	4.5		216	210	33,216
	G2 MA5400	5.0		56	56	8,835
	G2 MA5467	4.5		92	90	14,220
	G2 MA5468	5.0		97	97	15,313
	G2 MA5530	5.0		320	318	50,130
	G2 MA5597	5.0		261	259	40,899
	G2 MA5652	4.5		305	296	46,657
	G2 MA5653	5.0		152	151	23,845
	G2 MA5711	4.5		792	768	120,997
	G2 MA5712	5.0		342	339	53,417

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
特殊債券(除く金融債)	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
	G2 MA5817	4.0	137	129	20,424	2049／3／20
	G2 MA5818	4.5	101	98	15,519	2049／3／20
	G2 MA5819	5.0	178	177	27,969	2049／3／20
	G2 MA6221	4.5	191	186	29,311	2049／10／20
	G2 MA6544	4.5	191	185	29,213	2050／3／20
	G2 MA7534	2.5	765	651	102,579	2051／8／20
	G2 MA7649	2.5	2,388	2,030	319,894	2051／10／20
	G2AR 80031	4.625	3	3	488	2027／1／20
	G2AR 80032	4.625	2	2	384	2027／1／20
	G2AR 80044	4.625	1	1	226	2027／2／20
	G2AR 80059	3.875	8	8	1,308	2027／4／20
	G2AR 80060	3.875	8	8	1,303	2027／4／20
	G2AR 80070	3.875	1	1	205	2027／5／20
	G2AR 80082	3.875	3	3	562	2027／6／20
	G2AR 80133	3.75	1	1	169	2027／11／20
	G2AR 80141	3.75	3	3	487	2027／12／20
	G2AR 80154	4.625	7	7	1,168	2028／1／20
	G2AR 80168	4.625	2	2	419	2028／2／20
	G2AR 80178	4.625	2	2	366	2028／3／20
	G2AR 80296	3.625	16	15	2,502	2029／7／20
	G2AR 80309	3.625	6	6	945	2029／8／20
	G2AR 80317	3.625	1	1	244	2029／9／20
	G2AR 80329	3.75	4	4	700	2029／10／20
	G2AR 80331	3.75	2	2	455	2029／10／20
	G2AR 80344	3.75	3	3	592	2029／11／20
	G2AR 80346	3.75	6	5	940	2029／11／20
	G2AR 80354	3.75	1	1	273	2029／12／20
	G2AR 80356	3.75	0.127	0.125	19	2029／12／20
	G2AR 80364	4.625	3	3	515	2030／1／20
	G2AR 80376	4.625	0.847	0.837	131	2030／2／20
	G2AR 80385	4.625	6	6	954	2030／3／20
	G2AR 80393	3.875	2	2	323	2030／4／20
	G2AR 80395	3.875	6	6	1,052	2030／4／20
	G2AR 80406	3.875	1	1	169	2030／5／20
	G2AR 80408	3.875	12	12	2,020	2030／5／20
	G2AR 80409	4.0	10	10	1,716	2030／5／20
	G2AR 80413	3.875	2	2	405	2030／6／20
	G2AR 80428	4.0	21	21	3,406	2030／7／20
	G2AR 80455	4.0	4	4	632	2030／9／20
	G2AR 80460	3.75	6	6	978	2030／10／20
	G2AR 8466	4.0	0.032	0.032	5	2024／7／20
	G2AR 8482	3.625	0.167	0.167	26	2024／8／20
	G2AR 8484	4.0	0.114	0.114	17	2024／8／20
	G2AR 8502	3.625	0.062	0.062	9	2024／9／20
	G2AR 8503	3.625	0.085	0.084	13	2024／9／20
	G2AR 8547	4.0	0.403	0.4	63	2024／11／20
	G2AR 8565	4.0	0.195	0.194	30	2024／12／20
	G2AR 8567	4.5	0.584	0.581	91	2024／12／20
	G2AR 8580	4.625	0.395	0.393	61	2025／1／20
	G2AR 8595	4.625	0.409	0.406	64	2025／2／20

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
特殊債券(除く金融債)	(アメリカ) G2AR 8631 G2AR 8663 G2AR 8815 G2AR 8913 IO FNR 2004-47 EI IO FNR 2004-62 DI PHEAA 2016-1A A SNVA 2023-GRID1 1A STACR 2021-DNA5 M2 STACR 2022-DNA1 M1A STACR 2022-DNA3 M1A STACR 2024-DNA2 M1 STACR 2024-HQA1 A1 STACR 2024-HQA1 M1 STACR 2024-HQA1 M2	% 4.0 4.0 4.625 3.625 — — 6.58822 5.75 6.97374 6.32374 7.32374 6.52374 6.57374 6.57374 7.32374 2.778 1.542 3.0 2.875 5.3 5.375 5.6 5.2 4.2 5.15 5.25 6.60111 5.25 1.458 2.55 2.95 1.95 3.85 1.95 3.95 9.269 5.778559 5.552 5.716 5.202 2.972 4.571 2.279 5.674 6.23601 6.48501 6.57274 4.0 6.22757 6.16	千米ドル 1 2 1 0.073 40 14 610 96 66 193 67 650 541 210 100 350 600 275 600 450 542 106 654 250 450 542 107 654 233 251 575 319 85 163 175 400 175 199 1,025 1,225 195 301 475 328 200 189 150 800 100 400 800	千米ドル 1 2 1 0.071 0.197 0.038 611 97 66 193 68 651 542 211 100 277 553 250 575 450 548 107 654 233 251 582 319 85 134 140 387 65 290 211 249 408 167 1,074 1,227 166 286 439 328 1,074 1,227 166 286 45,150 33,341 39,341 64,409 26,440 31,500 169,188 193,311 26,233 45,150 69,243 51,806 29,851 21,712 126,647 13,210 65,572 135,510	千円 306 349 268 11 31 6 96,259 15,422 10,498 30,527 10,782 102,624 85,441 33,290 15,861 43,720 87,159 39,535 90,595 71,010 86,445 16,941 103,172 36,814 39,575 91,718 50,409 13,524 21,214 22,147 61,006 10,309 45,804 33,341 39,341 64,409 2031/4/30 2034/4/5 2028/10/29 2026/1/15 2028/2/1 2032/12/6 2034/5/29 2029/2/15 2033/3/1 2028/3/2 2030/3/2 2031/4/30 2034/4/5 2028/8/1 2032/3/1 2026/1/30 2024/7/1 2037/1/20 2036/12/20 2028/3/14 2057/6/15 2029/4/25 2033/2/4 2033/4/27 2027/11/24 2028/3/12 2037/3/15 2037/3/15 2033/4/18 2029/3/15 2029/6/15 2056/12/15	
普通社債券(含む投資法人債券)	3650R 2021-PF1 AS ABN AMRO BANK NV VAR AERCAP IRELAND 3% AIR LEASE CORP 2.875% AIR LEASE CORP 5.3% ALCON FINANCE 5.375% ALLEGION US HLDG 5.6% AMERICAN TOWER CORP 5.2% AMGEN INC 4.2% AMGEN INC 5.15% AMGEN INC 5.25% AMMC 2012-11A A1R2 AMPHENOL CORP 5.25% AOMT 2021-6 A1 AT&T INC 2.55% AUST & NZ BANKING VAR AUTONATION INC 1.95% AUTONATION INC 3.85% AVIATION CAPITAL 1.95% AVOLON HOLDINGS 3.95% BABSN 2024-1A D BAFC 2006-I 1A1 BANCO SANTANDER SA VAR BANK 2024-BNK47 A5 BANK OF AMERICA CORP VAR BANK OF AMERICA CORP VAR BANK OF AMERICA CORP VAR BARCLAYS PLC VAR BARCLAYS PLC VAR BBCMS 2018-TALL A BBCMS 2018-TALL B BCC 2020-1A A1R BMARK 2024-V6 D BMARK 2024-V7 A3 BMO 2023-C7 A5					

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
普通社債券(含む投資法人債券)	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
	BMO 2024-C8 A5	5.59801	900	932	146,821	2057/3/15
	BNP PARIBAS VAR	1.323	275	256	40,464	2027/1/13
	BNP PARIBAS VAR	4.625	244	217	34,227	—
	BOBA 2023-1A AR	6.74456	1,000	1,005	158,347	2036/4/20
	BOEING CO 3.25%	3.25	125	96	15,176	2035/2/1
	BOEING CO 3.625%	3.625	50	33	5,205	2048/3/1
	BOEING CO 3.85%	3.85	45	30	4,820	2048/11/1
	BOEING CO 5.15%	5.15	475	458	72,256	2030/5/1
	BOEING CO 6.298%	6.298	120	122	19,248	2029/5/1
	BOEING CO 6.528%	6.528	121	125	19,703	2034/5/1
	BPCE SA VAR	1.652	475	448	70,698	2026/10/6
	BRAVO 2024-NQMI A1	5.943	615	614	96,780	2063/12/1
	BRISTOL-MYERS 5.2%	5.2	217	219	34,556	2034/2/22
	BROADCOM INC 3.137%	3.137	1,092	887	139,745	2035/11/15
	BX 2021-ARIA C	7.07748	200	196	31,003	2036/10/15
	BX 2022-CLS A	5.76	600	596	93,923	2027/10/13
	BX 2022-PSB A	7.76777	359	359	56,709	2039/8/15
	BX 2024-BIO A	6.95877	725	723	113,923	2041/2/15
	BX 2024-XL4 A	6.7588	738	736	116,006	2039/2/15
	BX 2024-XL5 A	6.70842	359	358	56,438	2039/3/15
	CAMPBELL SOUP CO 5.2%	5.2	600	603	95,106	2029/3/21
	CARDINAL HEALTH 5.125%	5.125	118	118	18,620	2029/2/15
	CARRIER GLOBAL CORP 5.9%	5.9	150	157	24,877	2034/3/15
	CBRE SERVICES INC 5.95%	5.95	250	256	40,456	2034/8/15
	CEDF 2016-5A AIR	6.67868	5,299	5,308	836,319	2031/7/17
	CELANESE US HLDS 6.33%	6.33	350	361	56,974	2029/7/15
	CGCMT 2017-P8 D	3.0	200	155	24,474	2050/9/15
	CIFC 2023-3A A	6.91644	500	504	79,461	2037/1/20
	CITIGROUP INC VAR	3.668	300	286	45,137	2028/7/24
	CITIGROUP INC VAR	5.174	175	174	27,525	2030/2/13
	CITIGROUP INC VAR	3.785	376	337	53,200	2033/3/17
	CK HUTCH INTNTL 21.2.5%	2.5	200	170	26,888	2031/4/15
	COCA-COLA CONSOL 5.45%	5.45	100	102	16,068	2034/6/1
	COLT 2024-INV1 A1	5.903	573	572	90,245	2068/12/25
	COLT 2024-INV1 A2	6.328	119	119	18,863	2068/12/25
	COMET 2022-A3 A	4.95	600	597	94,073	2027/10/15
	COMM 2024-WCL1 A	7.141	600	598	94,287	2034/7/15
	CONSTELLATION ST 5.158%	5.158	193	194	30,608	2029/2/16
	COSTAR GROUP INC 2.8%	2.8	325	276	43,514	2030/7/15
	CREDIT AGRICOLE LDN VAR	1.907	250	240	37,911	2026/6/16
	CREDIT AGRICOLE SA VAR	1.247	550	512	80,779	2027/1/26
	CREDIT SUISSE GROUP VAR	3.091	475	408	64,425	2032/5/14
	CRNPT 2020-9A AR	6.78017	1,400	1,403	221,041	2034/7/14
	CSAIL 2021-C20 A3	2.8048	500	430	67,868	2054/3/15
	CSMC 2021-NQMB A1	1.841	82	72	11,381	2066/10/25
	CVS HEALTH CORP 4.78%	4.78	116	105	16,615	2038/3/25
	CWHEL 2006-HW 2A1A	5.58125	553	474	74,795	2036/11/15
	DANSKE BANK A/S VAR	4.298	325	315	49,659	2028/4/1
	DCENT 2023-A1 A	4.31	600	590	93,048	2028/3/15
	DELL INT LLC / EMC 5.3%	5.3	150	151	23,852	2029/10/1

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
普通社債券(含む投資法人債券)	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
	DELL INT LLC / EMC 5.75%	5.75	550	569	89,657	2033/2/1
	DELL INT LLC / EMC 6.2%	6.2	25	26	4,150	2030/7/15
	DELL INT LLC / EMC 8.1%	8.1	150	181	28,534	2036/7/15
	DEUTSCHE BANK NY VAR	2.129	150	142	22,426	2026/11/24
	DIAMONDBACK ENER 5.4%	5.4	157	157	24,748	2034/4/18
	DIAMONDBACK ENERGY 6.25%	6.25	182	192	30,327	2033/3/15
	DISCOVERY COMMUN 3.95%	3.95	375	352	55,569	2028/3/20
	DROCK 2023-1 A	4.72	1,100	1,091	171,953	2029/2/15
	DROCK 2023-2 A	6.22371	1,150	1,157	182,311	2028/8/15
	ENBRIDGE INC 5.7%	5.7	225	229	36,091	2033/3/8
	ENBRIDGE INC 6%	6.0	125	129	20,383	2028/11/15
	ENEL FINANCE AM 2.875%	2.875	350	235	37,110	2041/7/12
	ENERGY TRANSFER LP 6.1%	6.1	275	284	44,818	2028/12/1
	ENERGY TRANSFER LP 6.4%	6.4	175	184	29,136	2030/12/1
	ENERGY TRANSFER OP 5.25%	5.25	150	150	23,664	2029/4/15
	EXPEDIA GROUP INC 3.25%	3.25	600	543	85,636	2030/2/15
	FORD MOTOR CRED 5.8%	5.8	250	250	39,465	2027/3/5
	FORD MOTOR CRED 5.85%	5.85	508	509	80,194	2027/5/17
	GALAXY PIPELINE 2.16%	2.16	162	138	21,830	2034/3/31
	GCSL 2024-7AA A	—	425	425	66,985	2037/7/25
	GE HEALTHCARE TECH5.905%	5.905	316	330	52,010	2032/11/22
	GENERAL MOTORS FINL 4.3%	4.3	2	1	301	2029/4/6
	GFORT 2023-1 A1	5.34	600	599	94,456	2028/6/15
	GLENCORE FUNDING 4.875%	4.875	200	197	31,053	2029/3/12
	GLM 2019-6A AR	6.64456	500	500	78,890	2035/4/20
	GLM 2024-19A A	6.82143	900	905	142,657	2037/4/20
	GWT 2024-WOLF A	6.85877	325	324	51,149	2039/3/15
	GWT 2024-WOLF B	7.40777	375	374	59,036	2039/3/15
	GWT 2024-WOLF D	8.20677	150	150	23,673	2039/3/15
	HCA INC 3.375%	3.375	125	115	18,184	2029/3/15
	HCA INC 5.45%	5.45	450	453	71,362	2031/4/1
	HLSY 2023-7A A	7.57456	1,300	1,317	207,604	2036/7/20
	HUMANA INC 5.375%	5.375	184	184	29,085	2031/4/15
	HUNTINGTON BANKS VAR	6.208	200	205	32,313	2029/8/21
	HYATT HOTELS CORP 5.5%	5.5	225	222	34,987	2034/6/30
	HYUNDAI CAP AMER 1.65%	1.65	1,175	1,081	170,406	2026/9/17
	HYUNDAI CAP AMER 5.7%	5.7	75	76	12,048	2030/6/26
	ICG 2017-1A ARR	6.75648	800	801	126,306	2034/7/28
	IMM 2004-8 1A	6.15936	12	11	1,801	2034/10/25
	ING GROEP NV VAR	5.75	225	216	34,040	—
	INGERSOLL RAND 5.314%	5.314	75	75	11,967	2031/6/15
	INGERSOLL RAND INC 5.45%	5.45	75	76	12,014	2034/6/15
	INGERSOLL RAND INC 5.7%	5.7	75	77	12,191	2033/8/14
	INTERNATIONAL FL 1.23%	1.23	250	236	37,216	2025/10/1
	INTERNATIONAL FL 1.832%	1.832	100	89	14,066	2027/10/15
	INTERNATIONAL FL 2.3%	2.3	225	188	29,742	2030/11/1
	INVCO 2021-2A A	6.71017	700	700	110,425	2034/7/15
	JM SMUCKER CO 5.9%	5.9	500	517	81,580	2028/11/15
	JPMCC 2022-OPO A	3.0242	350	314	49,469	2039/1/5
	JPMMT 2021-6 A3	2.5	386	311	49,073	2051/10/25

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
普通社債券(含む投資法人債券)	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
	JPMMT 2021-LTV2 A1	2.5195	475	389	61,379	2052/5/25
	JPMMT 2024-1 A2	6.0	746	745	117,505	2054/6/25
	JPMORGAN CHASE & CO VAR	5.581	700	714	112,534	2030/4/22
	KILROY REALTY LP 6.25%	6.25	75	72	11,491	2036/1/15
	L3HARRIS TECH INC 4.4%	4.4	25	24	3,838	2028/6/15
	L3HARRIS TECH INC 5.25%	5.25	225	225	35,551	2031/6/1
	L3HARRIS TECH INC 5.4%	5.4	150	151	23,820	2033/7/31
	LOWE'S COS INC 4.25%	4.25	275	221	34,928	2052/4/1
	MACQUARIE GROUP LTD VAR	1.34	200	187	29,505	2027/1/12
	MACQUARIE GROUP LTD VAR	3.763	190	180	28,376	2028/11/28
	MARRIOTT INTL 4.875%	4.875	47	46	7,346	2029/5/15
	MARRIOTT INTL 4.9%	4.9	75	74	11,732	2029/4/15
	MEXICO CITY ARPT 3.875%	3.875	270	253	39,861	2028/4/30
	MEXICO CITY ARPT 5.5%	5.5	200	165	26,130	2047/7/31
	MFRA 2023-NQM4 A1	6.105	877	875	137,982	2068/12/25
	MFRA 2023-NQM4 A2	6.531	161	162	25,538	2068/12/25
	MICRON TECHNOLOGY 6.75%	6.75	50	53	8,442	2029/11/1
	MORGAN STANLEY VAR	5.164	1,400	1,399	220,538	2029/4/20
	MORGAN STANLEY VAR	5.173	300	300	47,333	2030/1/16
	MSBAM 2015-C26 D	3.06	150	121	19,062	2048/10/15
	MSC 2019-L3 B	3.649526	250	220	34,786	2052/11/15
	MSC 2021-L5 A4	2.728	500	428	67,437	2054/5/15
	MUZ88 2024-5A A1	—	400	400	63,012	2037/7/15
	MVEW 2019-2A A1R	7.00192	375	375	59,113	2037/7/15
	NATWEST GROUP PLC VAR	8.0	200	200	31,652	—
	NETFLIX INC 5.375%	5.375	375	380	59,936	2029/11/15
	NEUB 2024-54A D	8.80643	475	478	75,360	2038/4/23
	NNN REIT INC 5.6%	5.6	150	151	23,919	2033/10/15
	NXP BV/NXP FDG 5%	5.0	448	441	69,502	2033/1/15
	OAKCL 2024-25A A	6.85391	775	781	123,056	2037/4/20
	OBX 2024-NQM1 A1	5.928	690	689	108,670	2063/11/25
	OCCIDENTAL PETE 8.5%	8.5	325	348	54,956	2027/7/15
	ORACLE CORP 2.875%	2.875	500	436	68,739	2031/3/25
	ORACLE CORP 5.55%	5.55	225	218	34,422	2053/2/6
	ORACLE CORP 6.25%	6.25	275	293	46,311	2032/11/9
	ORACLE CORP 6.9%	6.9	100	114	18,033	2052/11/9
	OTIS WORLDWIDE 5.25%	5.25	75	75	11,935	2028/8/16
	PENSKE TRUCK LE 5.25%	5.25	175	174	27,495	2029/7/1
	PHILIP MORRIS IN 5.625%	5.625	200	205	32,334	2029/11/17
	POSCO 5.75%	5.75	250	254	40,059	2028/1/17
	PROSUS NV 3.832%	3.832	280	183	28,918	2051/2/8
	PRPM 2023-NQM3 A1	6.221	487	486	76,701	2068/11/25
	PRPM 2023-NQM3 A2	6.677	185	185	29,268	2068/11/25
	PT PERTAMINA 2.3%	2.3	200	167	26,326	2031/2/9
	PT PERTAMINA 3.1%	3.1	200	178	28,168	2030/1/21
	PUTNM 2021-1A A	6.79017	600	601	94,677	2034/10/15
	QATAR PETROLEUM 3.125%	3.125	270	203	32,032	2041/7/12
	QUEST DIAGNOSTICS 6.4%	6.4	129	139	22,012	2033/11/30
	REALTY INCOME CORP 3.4%	3.4	350	320	50,493	2030/1/15
	RELIANCE INDUSTR 3.625%	3.625	250	181	28,650	2052/1/12

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
普通社債券(含む投資法人債券)	(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
	ROGERS COMMUNIC 5%	5.0	370	367	57,900	2029/2/15
	ROYALTY PHARMA PLC 5.4%	5.4	200	197	31,146	2034/9/2
	RTX CORP 5.75%	5.75	250	257	40,624	2029/1/15
	RWE FINANCE US 5.875%	5.875	311	314	49,608	2034/4/16
	SA GLOBAL SUKUK 2.694%	2.694	1,670	1,439	226,737	2031/6/17
	SANTANDER UN GRO VAR	1.532	500	475	74,928	2026/8/21
	SDART 2023-6 A2	6.08	288	289	45,552	2027/5/17
	SHACK 2019-14A A1R	6.78617	3,250	3,254	512,680	2034/7/20
	SINK GALAXY PIPELI 2.94%	2.94	384	307	48,386	2040/9/30
	SLG 2021-OVA A	2.5854	450	372	58,675	2041/7/15
	SNDPT 2014-1RA A	6.73854	1,553	1,555	245,097	2031/7/18
	SOCIETE GENERALE VAR	1.488	850	795	125,259	2026/12/14
	SOCIETE GENERALE VAR	6.446	225	229	36,212	2029/1/10
	SOLVENTUM CORP 5.4%	5.4	250	250	39,488	2029/3/1
	SOLVENTUM CORP 5.45%	5.45	225	225	35,520	2027/2/25
	STANDARD CHARTERED PLC	1.456	725	678	106,874	2027/1/14
	STEEL DYNAMICS 1.65%	1.65	325	290	45,794	2027/10/15
	SUMITOMO TR&BK 5.5%	5.5	325	330	52,136	2028/3/9
	SYNGENTA FINANCE 4.892%	4.892	400	396	62,437	2025/4/24
	T-MOBILE USA INC 2.7%	2.7	150	126	19,951	2032/3/15
	T-MOBILE USA INC 3.375%	3.375	622	577	90,934	2029/4/15
	T-MOBILE USA INC 3.75%	3.75	328	316	49,781	2027/4/15
	T-MOBILE USA INC 4.75%	4.75	100	98	15,580	2028/2/1
	T-MOBILE USA INC 5.2%	5.2	550	549	86,631	2033/1/15
	TAKE-TWO INTERAC 5.4%	5.4	100	101	15,934	2029/6/12
	TRUIST FINANCIAL VAR	6.047	100	100	15,887	2027/6/8
	TYSN 2023-CRNR A	6.79907	500	521	82,077	2033/12/10
	UBS GROUP AG VAR	3.875	258	237	37,399	—
	US BANCORP VAR	5.775	300	305	48,169	2029/6/12
	US BANCORP VAR	5.384	250	251	39,616	2030/1/23
	VERALTO CORP 5.35%	5.35	425	429	67,690	2028/9/18
	VERUS 2021-8 A1	1.824	71	63	9,928	2066/11/25
	VERUS 2023-8 A1	6.25912	362	364	57,409	2068/12/25
	VERUS 2023-8 A2	6.6642	204	205	32,348	2068/12/25
	VERUS 2024-1 A1	5.712	812	809	127,555	2069/1/25
	VERUS 2024-1 A2	5.915	478	475	74,831	2069/1/25
	VOYA 2019-2A AR	6.52456	725	725	114,263	2032/7/20
	WARNERMEDIA HLDG 3.755%	3.755	375	356	56,104	2027/3/15
	WARNERMEDIA HLDG 4.054%	4.054	100	92	14,648	2029/3/15
	WELF 2019-XA A1R	6.75617	1,493	1,494	235,459	2032/7/20
	WELLS FARGO CO VAR	5.198	275	275	43,340	2030/1/23
	WFCM 2022-C62 A4	4.0	300	277	43,717	2055/4/15
	WFCM 2024-1CHI A	5.30749	500	492	77,526	2035/7/15
	WFCM 2024-1CHI B	5.74309	300	295	46,516	2035/7/15
	WFMB 2019-3 A1	3.5	18	16	2,559	2049/7/25
	WILLIAMS COMPANIES 2.6%	2.6	150	127	20,125	2031/3/15
	WORKDAY INC 3.7%	3.7	50	47	7,424	2029/4/1
	ZURICH FINANCE VAR	3.0	306	251	39,600	2051/4/19
	小計	—	—	—	19,509,913	—

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期期末				
		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	
国債証券 地方債証券	(カナダ) CANADA-GOV'T 2.75%	% 2.75	千カナダドル 750	千カナダドル 687	千円 78,823	2048/12/1
	BRITISH COLUMBIA 4.95%	4.95	1,900	2,061	236,435	2040/6/18
	ONTARIO PROVINCE 4.65%	4.65	400	420	48,228	2041/6/2
	QUEBEC PROVINCE 4.25%	4.25	700	699	80,189	2043/12/1
	小計	—	—	—	443,677	—
国債証券	(メキシコ) MEX BONOS DESARR 10%	10.0	千メキシコペソ 11,564	千メキシコペソ 11,459	97,527	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR 8.5%	8.5	1,241	1,085	9,240	2038/11/18
	小計	—	—	—	106,767	—
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…ドイツ) COMMERZBANK AG VAR	4.875	千ユーロ 200	千ユーロ 198	33,522	2034/10/16
	DEUTSCHE BANK AG VAR	5.0	400	412	69,587	2030/9/5
	DEUTSCHE BANK AG VAR	1.75	100	87	14,833	2030/11/19
	MUNICH RE VAR	4.25	300	297	50,207	2044/5/26
	VOLKSWAGEN BANK 4.375%	4.375	300	306	51,705	2028/5/3
国債証券 普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…イタリア) BUONI POLIENNALI 2.15%	2.15	880	578	97,515	2052/9/1
	BUONI POLIENNALI DE 2.8%	2.8	80	57	9,777	2067/3/1
	A2A SPA 4.375%	4.375	150	153	25,951	2034/2/3
	AUTOSTRADE PER L 4.75%	4.75	125	128	21,735	2031/1/24
	ENEL SPA VAR	3.375	105	101	17,098	—
	ENI SPA VAR	2.625	125	120	20,352	—
国債証券 特殊債券(除く金融債) 普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…フランス) FRANCE (GOVT OF) 2%	2.0	90	68	11,538	2048/5/25
	FRANCE (GOVT OF) 3.5%	3.5	3,450	3,552	599,145	2033/11/25
	FRANCE O.A.T. 3.25%	3.25	110	106	17,966	2045/5/25
	FRANCAISE DEVELOP 0.125%	0.125	700	557	94,048	2031/9/29
	ALD SA 3.875%	3.875	200	200	33,859	2027/2/22
	AXA SA VAR	6.375	225	225	37,989	—
	BANQ FED CRD MUT 4.125%	4.125	100	102	17,206	2029/3/13
	BANQ FED CRD MUT 4.375%	4.375	200	195	32,982	2034/1/11
	BNP PARIBAS VAR	3.875	100	100	16,971	2029/2/23
	BPCE SA 1.75%	1.75	100	95	16,052	2027/4/26
	BPCE SA VAR	5.125	100	101	17,154	2035/1/25
	ELEC DE FRANCE VAR	5.0	200	197	33,370	—
	SOCIETE GENERALE VAR	4.25	100	99	16,811	2030/12/6
	SOGECA CAP SA VAR	6.5	100	107	18,201	2044/5/16
	TOTALENERGIES SE VAR	3.369	100	97	16,401	—
	TOTALENERGIES SE VAR	2.0	131	121	20,514	—
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…オランダ) AMER MED SYST EU 3.375%	3.375	196	194	32,838	2029/3/8
	BRENTAG FINANCE 3.75%	3.75	100	99	16,860	2028/4/24
	CNI INDUSTRIAL NV 3.75%	3.75	220	218	36,922	2031/6/11
	IMCD NV 4.875%	4.875	175	180	30,385	2028/9/18
	KONINKLIJKE PHIL 3.75%	3.75	175	174	29,467	2032/5/31
	SARTORIUS FIN 4.375%	4.375	200	205	34,719	2029/9/14
	SARTORIUS FIN 4.5%	4.5	100	103	17,530	2032/9/14
	SWISSCOM FINANCE 3.5%	3.5	340	342	57,796	2031/11/29
	SWISSCOM FINANCE 3.625%	3.625	140	140	23,694	2036/11/29
	VOLKSWAGEN INTL FIN VAR	3.5	400	391	66,046	—

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…オランダ) WINTERSHALL DEA 0.84% WINTERSHALL DEA 1.332%	% 0.84 1.332	千ユーロ 200 400	千ユーロ 191 359	千円 32,362 60,575	2025/9/25 2028/9/25
国債証券	(ユーロ…スペイン) BONOS Y OBLIG D EST 2.9% BONOS Y OBLIG EST 1.25% SPANISH GOV'T 0.85% SPANISH GOV'T 2.55% SPANISH GOV'T 3.45% SPANISH GOV'T 5.9% BANCO SANTANDER 1.625% BANCO SANTANDER 3.875% CAIXABANK SA VAR CAIXABANK SA VAR CELLNEX FINANCE 3.625% FCC AQUALIA SA 2.629%	2.9 1.25 0.85 2.55 3.45 5.9 1.625 3.875 0.375 5.375 3.625 2.629	430 100 500 380 600 1,480 400 300 300 100 300 366	374 89 361 363 544 1,563 344 300 285 107 298 353	63,226 15,160 60,997 61,257 91,753 263,663 58,106 50,703 48,107 18,081 50,409 59,574	2046/10/31 2030/10/31 2037/7/30 2032/10/31 2066/7/30 2026/7/30 2030/10/22 2029/4/22 2026/11/18 2030/11/14 2029/1/24 2027/6/8
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…ベルギー) BELGIUM KINGDOM 0.35% REGION WALLONNE 2.875% AB INBEV SA/NV SA/ 3.45% SOLVAY SA 3.875%	0.35 2.875 3.45 3.875	400 1,100 102 100	327 1,010 102 100	55,205 170,385 17,254 16,899	2032/6/22 2038/1/14 2031/9/22 2028/4/3
国債証券	(ユーロ…オーストリア) REP OF AUSTRIA 2.1% RAIFFEISEN BANK INTL VAR RAIFFEISEN BK IN 5.75% VOLKS BANK WIEN AG 0.875%	2.1 6.0 5.75 0.875	260 100 400 500	197 103 422 472	33,257 17,523 71,267 79,640	2117/9/20 2028/9/15 2028/1/27 2026/3/23
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…ルクセンブルク) BLACKSTONE PROP 1.75% BLACKSTONE PROP 3.625% LOGICOR FINANCING 0.75% LOGICOR FINANCING 1.625%	1.75 3.625 0.75 1.625	100 100 450 500	88 95 448 459	14,874 16,108 75,660 77,439	2029/3/12 2029/10/29 2024/7/15 2027/7/15
国債証券	(ユーロ…フィンランド) FINNISH GOVERNMENT 1.5% NESTE OYJ 3.875% TEOLLISUUDEN VOI 4.75%	1.5 3.875 4.75	510 200 125	457 202 129	77,182 34,112 21,794	2032/9/15 2031/5/21 2030/6/1
普通社債券(含む投資法人債券)	(ユーロ…アイルランド) IRISH GOVERNMENT 0.35% IRISH TSY 0.2% 2030 0.2% AIB GROUP PLC VAR AIB GROUP PLC VAR AIB GROUP PLC VAR EATON CAPITAL 3.601% GLENCORE FIN DAC 1.25% PERMANENT TSB GROUP VAR PERMANENT TSB GROUP VAR	0.35 0.2 4.625 2.875 5.25 3.601 1.25 6.625 4.25	360 370 300 250 200 225 450 111 140	295 316 309 241 214 227 360 117 138	49,855 53,336 52,129 40,781 36,166 38,312 60,748 19,772 23,411	2032/10/18 2030/10/18 2029/7/23 2031/5/30 2031/10/23 2031/5/21 2033/3/1 2028/4/25 2030/7/10
国債証券	(ユーロ…ポルトガル) OBRIGACOES DO TESO 1.95%	1.95	930	894	150,781	2029/6/15
国債証券	(ユーロ…その他) INDONESIA REP 2.15% ROMANIA 2% ROMANIA 3.375%	2.15 2.0 3.375	180 70 140	179 54 92	30,267 9,207 15,648	2024/7/18 2032/1/28 2050/1/28

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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	
特殊債券(除く金融債)	(ユーロ…その他)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	EURO STABILITY MECHA 1%	1.0	450	437	73,801	2025/9/23
普通社債券(含む投資法人債券)	EUROPEAN INV'T BK 2.25%	2.25	1,250	1,212	204,412	2030/3/15
	EUROPEAN UNION 1%	1.0	1,850	1,600	269,834	2032/7/6
	EUROPEAN UNION 3.375%	3.375	1,110	1,149	193,854	2032/4/4
	ASSA ABLOY AB 3.875%	3.875	200	205	34,658	2030/9/13
	AT&T INC 1.8%	1.8	124	94	15,859	2039/9/14
	BARCLAYS PLC VAR	4.918	200	208	35,083	2030/8/8
	BAT INT'L FINANCE 2.25%	2.25	100	91	15,385	2030/1/16
	BECTON DICKINSON 3.828%	3.828	175	176	29,792	2032/6/7
	BOOKING HOLD'S INC 3.5%	3.5	100	100	16,926	2029/3/1
	BOOKING HOLDINGS 4.75%	4.75	250	270	45,646	2034/11/15
	BP CAPITAL PLC 1.594%	1.594	100	93	15,710	2028/7/3
	CARGILL INC 3.875%	3.875	300	308	51,947	2030/4/24
	COMPASS GROUP PLC 3.25%	3.25	132	130	22,064	2031/2/6
	CREDIT SUISSE AG VAR	1.0	100	94	15,914	2027/6/24
	CREDIT SUISSE GROUP VAR	3.25	100	99	16,744	2026/4/2
	CREDIT SUISSE GROUP VAR	7.75	325	367	61,911	2029/3/1
	FIDELITY NAT'L INF 0.625%	0.625	300	287	48,411	2025/12/3
	GEN MOTORS FIN 0.85%	0.85	135	128	21,719	2026/2/26
	GENERAL MILLS INC 3.65%	3.65	154	154	26,131	2030/10/23
	MEDTRONIC INC 3.65%	3.65	225	227	38,414	2029/10/15
	MOLSON COORS 3.8%	3.8	325	328	55,356	2032/6/15
	MONDI FINANCE PLC 3.75%	3.75	120	121	20,422	2032/5/31
	MOTABILITY OPS 4%	4.0	250	254	42,834	2030/1/17
	NATIONAL GRID PLC 0.163%	0.163	450	398	67,145	2028/1/20
	ORIX CORP 4.477%	4.477	200	206	34,749	2028/6/1
	PANDORA A/S 3.875%	3.875	150	150	25,356	2030/5/31
	PROSUS NV 2.031%	2.031	100	80	13,607	2032/8/3
	SSE PLC 4%	4.0	200	205	34,591	2031/9/5
	UBS GROUP AG VAR	0.25	650	617	104,102	2026/11/3
	VIRGIN MONEY UK PLC VAR	4.0	124	124	20,940	2028/3/18
小計		—	—	—	5,725,100	—
国債証券	(イギリス)		千英ポンド	千英ポンド		
	ISLE OF MAN 1.625%	1.625	175	87	17,456	2051/9/14
	UK TREASURY 3.5%	3.5	330	273	54,674	2068/7/22
	UK TREASURY 4.25%	4.25	911	878	175,631	2046/12/7
	UK TSY 1.75% 2057 1.75%	1.75	140	75	15,060	2057/7/22
地方債証券	UNITED KINGDOM GILT 1.5%	1.5	400	206	41,370	2053/7/31
	PROVINCE OF QUEBEC 2.25%	2.25	260	246	49,186	2026/9/15
特殊債券(除く金融債)	AGENCE FRANCAISE 1.25%	1.25	800	769	153,890	2025/6/18
	DEXIA CREDIT LOCAL 1.25%	1.25	1,300	1,245	249,022	2025/7/21
普通社債券(含む投資法人債券)	NORDIC INVESTMENT 1.125%	1.125	960	924	184,679	2025/6/18
	BARCLAYS PLC VAR	7.125	200	197	39,522	—
	BAT INT'L FINANCE 2.25%	2.25	330	293	58,569	2028/6/26
	E.ON INT'L FIN BV 6.375%	6.375	156	167	33,458	2032/6/7
	ELEC DE FRANCE 5.875%	5.875	250	256	51,266	2031/7/18
	TESCO CORP TREAS 1.875%	1.875	136	120	24,056	2028/11/2
	THAMES WATER UTIL FIN 4%	4.0	150	134	26,892	2025/6/19
小計		—	—	—	1,229,771	—

グローバル・アグリゲート（除く日本）マザーファンド

種類	銘柄名	当期末				
		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					
国債証券	(スイス) SWITZERLAND 0%	% —	千スイスフラン 660	千スイスフラン 592	千円 104,832	2039/7/24
国債証券	(スウェーデン) SWEDISH GOVERNMENT 1.75%	1.75	千スウェーデンクローナ 4,860	千スウェーデンクローナ 4,702	70,402	2033/11/11
国債証券	(デンマーク) KINGDOM OF DENMA 4.5%	4.5	千デンマーククローネ 1,520	千デンマーククローネ 1,881	42,520	2039/11/15
国債証券	(ポーランド) POLAND GOVT BOND 6%	6.0	千ポーランドズロチ 1,590	千ポーランドズロチ 1,620	62,414	2033/10/25
国債証券	(マレーシア) MALAYSIA GOVERN M 3.844% MALAYSIA GOVT 3.828%	3.844 3.828	千マレーシアリングット 2,130 730	千マレーシアリングット 2,123 726	70,816 24,224	2033/4/15 2034/7/5
	小計	—	—	—	95,040	—
国債証券	(タイ) THAILAND 3.775%	3.775	千タイバーツ 30,800	千タイバーツ 33,063	141,843	2032/6/25
国債証券	(インドネシア) INDONESIA GOV 7.5% INDONESIA GOV 8.75% INDONESIA GOV T 6.375% INDONESIA GOV T 6.375% INDONESIA GOV T 6.5%	7.5 8.75 6.375 6.375 6.5	千インドネシアルピア 2,579,000 4,001,000 3,008,000 584,000 950,000	千インドネシアルピア 2,662,688 4,345,205 2,889,463 550,420 919,600	25,561 41,713 27,738 5,284 8,828	2035/6/15 2031/5/15 2032/4/15 2037/7/15 2031/2/15
	小計	—	—	—	109,126	—
国債証券	(韓国) KOREA TREASURY BON1.875% KOREA TRSY BD 2.375%	— —	千韓国ウォン 5,141,850 592,760	千韓国ウォン 4,806,285 555,015	549,358 63,438	2029/6/10 2031/12/10
	小計	—	—	—	612,796	—
国債証券	(イスラエル) ISRAEL FIXED BOND 1.3%	1.3	千イスラエルシェケル 1,000	千イスラエルシェケル 771	32,674	2032/4/30
国債証券	(中国オフショア) CHINA GOVERNMENT BOND 3% CHINA GOVT BOND 2.35% CHINA GOVT BOND 2.6% CHINA GOVT BOND 2.8% CHINA GOVT BOND 2.85% CHINA GOVT BOND 2.91% CHINA GOVT BOND 3.02% CHINA GOVT BOND 3.25% CHINA GOVT BOND 3.25% CHINA GOVT BOND 3.27% CHINA GOVT BOND 3.39% CHINA GOVT BOND 3.88% CHINA GOVT BOND 4.08% INTL BK RECON&DEV 3.25%	3.0 2.35 2.6 2.8 2.85 2.91 3.02 3.25 3.25 3.27 3.39 3.88 4.08 3.25	千オフショア人民元 2,140 3,380 6,140 14,630 41,600 7,140 11,380 6,840 2,100 11,100 2,220 9,600 3,450 6,000	千オフショア人民元 2,357 3,395 6,286 15,210 42,741 7,394 11,992 7,048 2,217 11,891 2,565 11,934 4,401 6,035	51,049 73,548 136,156 329,428 925,693 160,159 259,742 152,655 48,018 257,548 55,571 258,477 95,317 130,711	2053/10/15 2034/2/25 2032/9/1 2032/11/15 2027/6/4 2028/10/14 2031/5/27 2026/6/6 2028/11/22 2030/11/19 2050/3/16 2049/7/22 2048/10/22 2025/4/28
特殊債券(除く金融債)	小計	—	—	—	2,934,078	—
	合計	—	—	—	31,220,962	—

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

(注2) その他には、ユーロ参加国以外の国に属する発行体が発行するユーロ建の公社債が含まれます。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

	銘 柄 別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国	ド イ ツ 国 債 先 物 5年	1,401	—
	イ タ リ ア 国 債 先 物 10年	629	—
	ド イ ツ 国 債 先 物 10年	—	740
	ド イ ツ 国 債 先 物 30年	22	—
	米 国 国 債 先 物 ウ ル ト ラ 10年	—	1,012
	米 国 国 債 先 物 10年	3,352	—
	米 国 国 債 先 物 2年	—	805
	米 国 国 債 先 物 20年	1,441	—
	米 国 国 債 先 物 30年	—	426
	米 国 国 債 先 物 5年	843	—
	英 国 国 債 先 物 10年	691	—
	カ ナ ダ 国 債 先 物 10年	463	—
	フ ラ ン ス 国 債 先 物 10年	230	—
	オ ー ス ト ラ リ ア 国 債 先 物 10年	360	—
	オ ー ス ト ラ リ ア 国 債 先 物 3年	154	—
	ド イ ツ 国 債 先 物 2年	1,517	—
	ユ ー ロ 金 利 先 物 3ヶ 月	—	3,275
	S O N I A 先 物 3ヶ 月	2,865	—

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

(注2) —印は組入れなし。

(3) スワップ及び先渡取引残高

種 類	取 引 契 約 残 高			
	当 期 末	想 定 元 本	額	百 万 円
直 物 為 替 先 渡 取 引				323

■投資信託財産の構成

2024年6月17日現在

項 目	当 期		末
	評 価	額	比 率
公 社 債		千円 31,220,962	% 93.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		2,366,282	7.0
投 資 信 託 財 产 總 額		33,587,244	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(31,078,181千円)の投資信託財産総額(33,587,244千円)に対する比率は92.5%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したもので。なお決算日における邦貨換算レートは1オフショア人民元=21.658円、1米ドル=157.53円、1カナダドル=114.69円、1メキシコペソ=8.5109円、1ユーロ=168.64円、1英ポンド=199.87円、1スイスフラン=176.84円、1スウェーデンクローナ=14.97円、1ノルウェーコローネ=14.77円、1デンマーククローネ=22.60円、1チェコクロナ=6.8164円、1ハンガリーフォリント=0.423416円、1ポーランドズロチ=38.5195円、1オーストラリアドル=104.17円、1ニュージーランドドル=96.66円、1マレーシアリンギット=33.3525円、1タイバーツ=4.29円、1インドネシアルピア=0.0096円、1韓国ウォン=0.1143円、1イスラエルシェケル=42.3507円、1南アフリカランド=8.58円です。

■特定資産の価格等の調査

調査を行った者の氏名又は名称

PwC Japan有限責任監査法人

調査の結果及び方法の概要

調査依頼を行った取引は2023年6月16日から2024年6月17日までの間で外国貸付債権信託受益証券に属する取引が97件、直物為替先渡取引の取引が54件でした。該当取引について、「投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）」第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、相手方の名称、その他の当該取引の内容に関して、PwC Japan有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2024年6月17日
(A)資産	71,136,713,658円
コール・ローン等	542,323,696
公社債(評価額)	31,220,962,852
未収入金	38,893,290,642
未収利息	278,735,226
前払費用	17,411,770
差入委託証拠金	183,989,472
(B)負債	39,424,369,845
前受金	26,618
未払金	39,393,798,065
未払解約金	30,545,162
(C)純資産総額(A-B)	31,712,343,813
元本	9,878,101,474
次期繰越損益金	21,834,242,339
(D)受益権総口数	9,878,101,474口
1万口当たり基準価額(C/D)	32,104円

■損益の状況

項 目	当 期
	自2023年6月16日 至2024年6月17日
(A)配当等収益	1,357,788,790円
受取利息	1,353,686,893
その他収益金	4,424,506
支払利息	△ 322,609
(B)有価証券売買損益	4,018,351,538
売買益	5,504,434,172
売買損	△ 1,486,082,634
(C)先物取引等取引損益	213,639,811
取引益	916,063,399
取引損	△ 1,129,703,210
(D)その他の費用等	7,507,979
(E)当期損益金(A+B+C+D)	5,154,992,538
(F)前期繰越損益金	21,516,625,652
(G)追加信託差損益金	531,559,536
(H)解約差損益金	△ 5,368,935,387
(I)計(E+F+G+H)	21,834,242,339
次期繰越損益金(I)	21,834,242,339

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

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

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

(注4) 期首元本額は12,375,740,275円、当作成期間中において、追加設定元本額は271,713,288円、同解約元本額は2,769,352,089円です。

(注5) 元本の内訳 ゴールドマン・サックス毎月分配債券ファンド（愛称 妖精物語）8,629,995,568円

グローバル債券コア・ファンド（適格機関投資家専用）1,148,680,449円

外国債券ファンドVA 99,425,457円