

■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（設定日：2002年4月1日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 <b>パッシブ外国債券マザーファンド</b> 外国の公社債
当ファンドの運用方法	■主としてマザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ■外貨建資産に対する対円での為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、市況動向等により弾力的、機動的に対円での為替ヘッジを行う場合があります。 ■対象インデックス（ベンチマーク）との連動性を維持するため、債券先物取引等を利用することがあります。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 <b>パッシブ外国債券マザーファンド</b> ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	■年1回（原則として毎年3月31日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分も含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

# 三井住友・ DC外国債券 インデックスファンド

## 【運用報告書(全体版)】

(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

第 20 期

決算日 2022年3月31日

### 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

## 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1  
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

## 三井住友・DC外国債券インデックスファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

### ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
16期(2018年4月2日)	19,390	0	3.4	445.93	4.1	98.9	56,229
17期(2019年4月1日)	19,878	0	2.5	456.92	2.5	99.0	61,358
18期(2020年3月31日)	20,871	0	5.0	480.58	5.2	98.9	66,845
19期(2021年3月31日)	21,685	0	3.9	501.12	4.3	99.0	72,530
20期(2022年3月31日)	22,158	0	2.2	514.02	2.6	99.1	76,215

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

### ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2021年3月31日	円	%		%	%
4月末	21,685	—	501.12	—	99.0
5月末	21,665	△0.1	502.93	0.4	99.1
6月末	21,944	1.2	510.44	1.9	99.3
7月末	21,900	1.0	508.66	1.5	99.2
8月末	22,047	1.7	513.08	2.4	99.2
9月末	22,043	1.7	512.29	2.2	99.2
10月末	21,888	0.9	508.95	1.6	99.0
11月末	22,359	3.1	518.32	3.4	99.0
12月末	22,108	2.0	512.77	2.3	99.1
2022年1月末	22,238	2.6	516.73	3.1	99.2
2月末	21,851	0.8	507.46	1.3	99.3
(期末) 2022年3月31日	21,454	△1.1	500.36	△0.2	99.3
	22,158	2.2	514.02	2.6	99.1

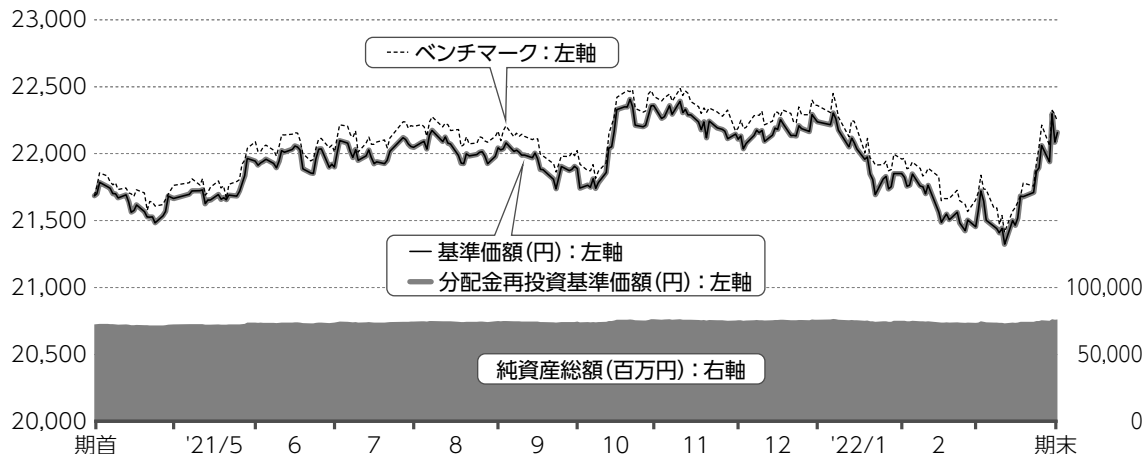
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	21,685円
期末	22,158円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+2.2% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

**基準価額の主な変動要因(2021年4月1日から2022年3月31日まで)**

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

**上昇要因**

- 欧米の中央銀行が金融政策正常化を進める中、日本は緩和政策を堅持したことから、米ドルやユーロなどが対円で上昇したこと

**下落要因**

- インフレ懸念の高まりや利上げなど金融政策正常化を背景に、米欧で金利が上昇(価格は下落)したこと

投資環境について(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

債券市場は米国、ユーロ圏ともに下落しました。為替市場は、米ドル、ユーロなどの主要通貨が対円で上昇しました。

## 債券市場

米国では、期初は景気回復期待が金利上昇要因となる一方で、経済指標が市場予想を下回ったことなどから一進一退となりました。その後、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念から金利が低下する局面もありましたが、インフレ懸念の高まりや将来の利上げなど金融政策正常化観測から金利が上昇しました。期末にかけては、ウクライナ情勢の悪化が金利低下圧力となる局面もありましたが、インフレ抑制の為、F R B (米連邦準備制度理事会) が急速な金融引き締めを行うとの見方が強まり、金利は一段と上昇しました。3月にはF O M C (米連邦公開市場委員会) が開催され、F F レートの0.25%引上げが決定されました。

ユーロ圏では、期初は景気回復期待から金利が上昇しました。その後、感染再拡大による影響への懸念から金利が低下する局面もありましたが、インフレ懸念の高まりや金融政策正常化観測から金利が上昇しました。期末にかけては、ウクライナ情勢の悪化から金利が低下する局面もありましたが、インフレが高進する中、E C B (欧州中央銀行) による金融政策正常化の前倒し観測が強まり、金利は

一段と上昇しました。

## 為替市場

### ●米ドル・円

米ドルが対円で上昇しました。米国の景気回復や利上げなど金融政策正常化の動きが米ドルの上昇要因となりました。

### ●ユーロ・円

ユーロが対円で上昇しました。地政学リスクの高まりがユーロ安要因となる局面もありましたが、ユーロ圏の金融政策正常化の前倒し観測がユーロの上昇要因となりました。

ポートフォリオについて(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

## 当ファンド

期を通じて「パッシブ外国債券マザーファンド」を高位に組み入れました。

## パッシブ外国債券マザーファンド

### ●デュレーション(投資資金の平均回収期間)

各国市場をいくつかの満期セクターに分割し、それぞれのセクター毎にデュレーション、利回り等の債券特性に近くなる銘柄の組み合わせを選択していくことにより、可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行いました。また、インデックス構成銘柄の変更がある毎月末には、インデックス構成銘柄の変更によるデュレーション等の変動にファンド特性値を合わせるべくポートフォリオのリバランス(投資配分比率の調整)を行いました。

### ●国別・通貨別配分

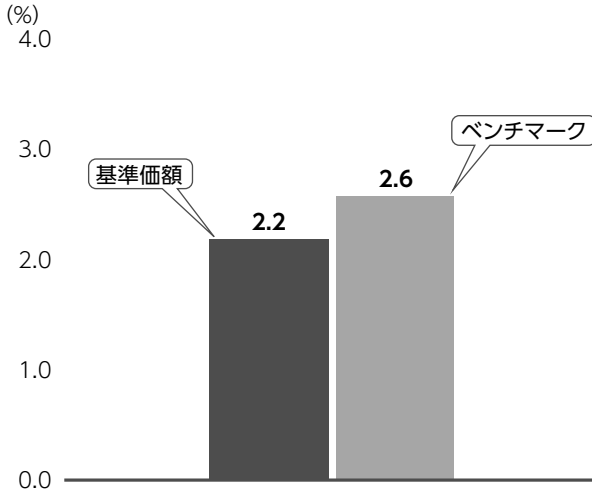
インデックスの配分に極力合わせて、リバランスを行いました。

### ●種別配分

インデックスに準拠し、すべて国債に投資を行いました。

ベンチマークとの差異について(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+2.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+2.6%を0.4%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等の支払や為替の評価要因がマイナスとなったこと  
(当ファンドでは、当日の投資信託協会が採用する仲値を採用する一方で、ベンチマークは前日のロンドン時間午後4時時点のリフィニティブが提供するWM/Reutersの仲値を採用しているため、今期は両者の差異が下方乖離要因として影響しました。)

## 分配金について(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第20期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	13,488

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。  
 ※「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(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

引き続き、「パッシブ外国債券マザーファンド」を高位に組入れて運用を行います。

### パッシブ外国債券マザーファンド

米国では、インフレ懸念が根強く、FRBが金融政策正常化を迅速に進める中で、金利は水準を切り上げていく見通しです。但し、市場の利上げ織り込みが相当程度進行していることから、上昇ペースは緩やかになると予想します。

ユーロ圏では、ウクライナ情勢が懸念されますが、インフレへの警戒感が強まる中、ECBが金融政策正常化に向けてタカ派(インフレ抑制を重視する立場)的な姿勢を続け

ることで、金利は緩やかに水準を切り上げていく見通しです。

米ドル・円は、米国が金融引き締めを加速させる一方で、日本は緩和政策を堅持していることから、米ドル高・円安圧力がかかる見通しです。ユーロ・円は、ウクライナ情勢が懸念されますが、ECBの金融政策正常化や欧州復興基金による投資拡大がユーロの支援材料となり、ユーロが緩やかに水準を切り上げる見通しです。

このような環境下、引き続きベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、債券組入比率を高位に保ち、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行います。債券種別はベンチマークに準拠し、国債に投資していきます。



## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。

## 三井住友・DC外国債券インデックスファンド

### 1万口当たりの費用明細(2021年4月1日から2022年3月31日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
<b>(a) 信託報酬</b>	<b>51円</b>	<b>0.231%</b>	<b>信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数)</b> <b>期中の平均基準価額は21,929円です。</b>
( 投 信 会 社 )	(19)	(0.088)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
( 販 売 会 社 )	(24)	(0.110)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(7)	(0.033)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
<b>(b) 売買委託手数料</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>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</b>
( 株 式 )	(-)	(-)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
<b>(c) 有価証券取引税</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数</b>
( 株 式 )	(-)	(-)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
( 公 社 債 )	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
<b>(d) その他費用</b>	<b>7</b>	<b>0.033</b>	<b>その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数</b>
( 保 管 費 用 )	(6)	(0.027)	保管費用：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付金・資産の移転等に要する費用
( 監 査 費 用 )	(1)	(0.005)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
( そ の 他 )	(0)	(0.001)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
<b>合 計</b>	<b>58</b>	<b>0.264</b>	

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

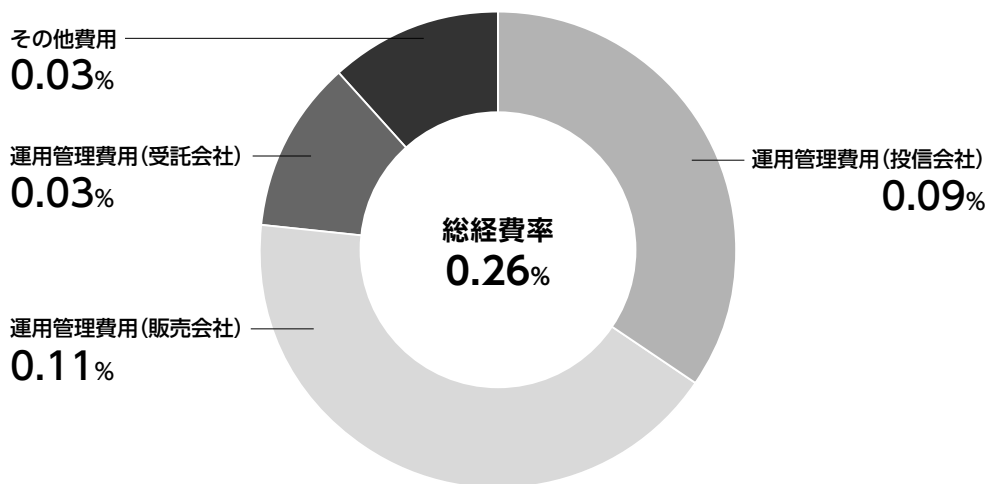
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



## 参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は0.26%です。

## 三井住友・DC外国債券インデックスファンド

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年4月1日から2022年3月31日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
パッシブ外国債券マザーファンド	1,829,815	5,517,609	1,195,399	3,589,648

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月1日から2022年3月31日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年4月1日から2022年3月31日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

### ■ 組入れ資産の明細 (2022年3月31日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
パッシブ外国債券マザーファンド	24,430,893	25,065,309	76,301,307

※パッシブ外国債券マザーファンドの期末の受益権総口数は30,911,495,316口です。

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年3月31日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
パッシブ外国債券マザーファンド	76,301,307	99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	90,202	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	76,391,510	100.0

※パッシブ外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産(93,732,777千円)の投資信託財産総額(94,288,729千円)に対する比率は99.4%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=122.39円、1カナダ・ドル=97.90円、1オーストラリア・ドル=92.00円、1シンガポール・ドル=90.49円、1イギリス・ポンド=160.89円、1イスラエル・シケル=38.512円、1デンマーク・クローネ=18.38円、1ノルウェー・クローネ=14.27円、1スウェーデン・クローナ=13.23円、1メキシコ・ペソ=6.156円、1オフショア・人民元=19.25円、1マレーシア・リングギット=29.122円、1ポーランド・ズロチ=29.452円、1ユーロ=136.70円です。

## 三井住友・DC外国債券インデックスファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月31日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>76,391,510,524円</b>
コール・ローン等	83,991,755
パッシブ外国債券 マザーファンド(評価額)	76,301,307,933
未 収 入 金	6,210,836
<b>(B) 負 債</b>	<b>175,660,274</b>
未 払 解 約 金	87,096,567
未 払 信 託 報 酬	86,503,523
そ の 他 未 払 費 用	2,060,184
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>76,215,850,250</b>
元 本	34,396,126,627
次 期 繰 越 損 益 金	41,819,723,623
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>34,396,126,627口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>22,158円</b>

※当期における期首元本額33,447,173,487円、期中追加設定元本額5,122,605,600円、期中一部解約元本額4,173,652,460円です。

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

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

### ■ 損益の状況

(自2021年4月1日 至2022年3月31日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>△ 27,931円</b>
受 取 利 息	2,403
支 払 利 息	△ 30,334
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>1,675,182,589</b>
売 買 損 益	1,791,734,123
売 買 損 益	△ 116,551,534
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 175,855,785</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)</b>	<b>1,499,298,873</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>11,341,216,943</b>
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>28,979,207,807</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 33,040,481,919)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 4,061,274,112)
<b>(G) 合 計 (D+E+F)</b>	<b>41,819,723,623</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G)</b>	<b>41,819,723,623</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	28,979,207,807
( 配 当 等 相 当 額 )	( 33,056,932,785)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 4,077,724,978)
分 配 準 備 積 立 金	13,337,737,823
繰 越 損 益 金	△ 497,222,007

※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。  
 ※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。  
 ※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し引いた差額分をいいます。  
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,235,984,167円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	33,056,932,785
(d) 分配準備積立金	12,101,753,656
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	46,394,670,608
1万口当たり当期分配対象額	13,488.34
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

### ■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	0円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

# パッシブ外国債券マザーファンド

第22期（2021年3月11日から2022年3月10日まで）

信託期間	無期限（設定日：2000年7月3日）
運用方針	<p>■主として日本を除く世界主要国の公社債に分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、これからの乖離を平均的に抑えていく運用を目指します。</p> <p>■ポートフォリオの見直しは適宜行い、各国の市場動向に対する感応度がベンチマークに近付くように調整を行います。</p> <p>■外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、市況動向等により弾力的、機動的に為替ヘッジを行う場合があります。</p>

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債 組入比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率		
18期(2018年3月12日)	26,210	1.9	443.11	2.3	98.8	76,691
19期(2019年3月11日)	26,751	2.1	453.26	2.3	99.0	79,686
20期(2020年3月10日)	28,225	5.5	474.94	4.8	99.1	87,126
21期(2021年3月10日)	29,507	4.5	500.51	5.4	99.2	93,020
22期(2022年3月10日)	29,455	△0.2	497.73	△0.6	99.2	90,932

※ベンチマークは、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

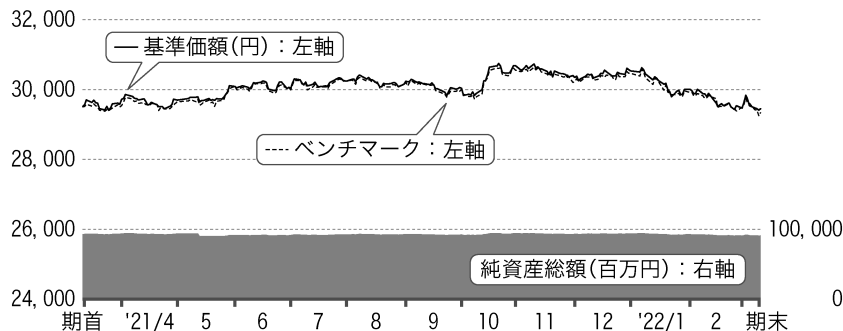
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2021年3月10日	円 29,507	% —	500.51	% —	% 99.2
3月末	29,721	0.7	501.12	0.1	98.9
4月末	29,699	0.7	502.93	0.5	99.1
5月末	30,088	2.0	510.44	2.0	99.3
6月末	30,033	1.8	508.66	1.6	99.1
7月末	30,241	2.5	513.08	2.5	99.1
8月末	30,241	2.5	512.29	2.4	99.1
9月末	30,035	1.8	508.95	1.7	98.9
10月末	30,687	4.0	518.32	3.6	99.0
11月末	30,348	2.9	512.77	2.4	99.1
12月末	30,533	3.5	516.73	3.2	99.2
2022年1月末	30,008	1.7	507.46	1.4	99.2
2月末	29,468	△0.1	500.36	△0.0	99.2
(期 末) 2022年3月10日	29,455	△0.2	497.73	△0.6	99.2

※騰落率は期首比です。

## 1 運用経過

### ▶ 基準価額等の推移について (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

#### 基準価額等の推移



期首	29,507円
期末	29,455円
騰落率	-0.2%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

### ▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

当ファンドは、外国の公社債への分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。

外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

#### 上昇要因

- ・米国の景気回復や将来の利上げ観測など金融政策正常化への期待を背景に、米ドルが対円で上昇したこと

#### 下落要因

- ・インフレ懸念の高まりや将来の利上げなど金融政策正常化観測を背景に、米欧で金利が上昇（価格は下落）したこと



▶ 投資環境について (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

債券市場は米国、ユーロ圏ともに下落しました。為替市場は、米ドルが対円で上昇した一方、ユーロは対円で小幅に下落しました。

**債券市場**

米国では、期初は景気回復期待が金利上昇要因となる一方で、経済指標が市場予想を下回ったことなどから一進一退となりました。その後、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念から金利が低下する局面もありましたが、インフレ懸念の高まりや将来の利上げなど金融政策正常化観測から金利が上昇しました。

期末にかけては、ウクライナ情勢の悪化が金利低下圧力となる局面もありましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げなどの金融政策正常化の動きは変わらないとの見方から、金利は再び上昇しました。

ユーロ圏では、期初は景気回復期待から金利が上昇しました。その後、感染再拡大による影響への懸念から金利が低下する局面もありましたが、インフレ懸念の高まりや金融政策正常化観測から金利が上昇しました。期末にかけては、ウクライナ情勢の悪化から金利が低下する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）による量的緩和縮小などの金融政策正常化の動きは変わらないとの見方から、金利は再び上昇しました。

**為替市場**

● 米ドル・円

米ドルが対円で上昇しました。米国の景気回復や将来の利上げ観測など金融政策正常化観測が米ドルの上昇要因となりました。

● ユーロ・円

ユーロが対円で小幅下落しました。ユーロ圏の将来の金融政策正常化観測はユーロの支援材料となりましたが、感染再拡大による悪影響への懸念や地政学リスクの高まりがユーロ安要因となりました。

▶ ポートフォリオについて (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

**デュレーション**

各国市場をいくつかの満期セクターに分割し、それぞれのセクター毎にデュレーション（投資資金の平均回収期間）、利回り等の債券特性に近くなる銘柄の組み合わせを選択していくことにより、可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行いました。また、インデックス構成銘柄の変更がある毎月末には、インデックス構成銘柄の変更によるデュレーション等の変動にファンド特性値を合わせるべくポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。

**国別・通貨別配分**

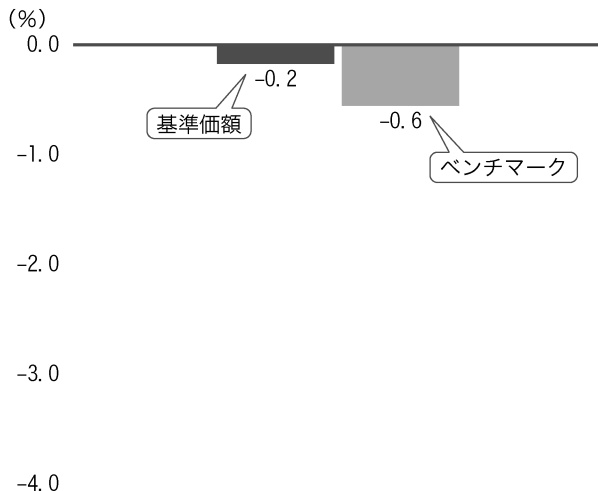
インデックスの配分に極力合わせて、リバランスを行いました。

**種別配分**

インデックスに準拠し、すべて国債に投資を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

**基準価額とベンチマークの騰落率対比**



当ファンドは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-0.2%となり、ベンチマークの騰落率-0.6%を0.4%上方乖離しました。

上方乖離要因

- ・為替の評価要因がプラスとなったこと  
当ファンドでは、当日の投資信託協会が採用する仲値を採用する一方で、ベンチマークは前日のロンドン時間午後4時時点のリフィニティブが提供するWM/Reutersの仲値を採用しているため、今期は両者の差異が上方乖離要因として影響しました。

## 2 今後の運用方針

米国では、インフレ懸念が根強く、FRBが金融政策正常化を進めていく中で、金利は水準を切り上げていく見通しです。

ユーロ圏では、ウクライナ情勢が不透明要因ですが、金融政策正常化が見込まれる中で金利に上昇圧力がかかってくる見通しです。

米ドル・円は、米国における金融政策正常化を背景に、米ドル高・円安圧力がかかる見通しです。

ユーロ・円は、ウクライナ情勢が不透明要因ですが、ECBの金融政策正常化や欧州復興基金による投資拡大がユーロの支援材料となり、ユーロが緩やかに水準を切り上げる見通しです。

このような環境下、引き続きベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、債券組入比率を高位に保ち、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行います。債券種別はベンチマークに準拠し、国債に投資していきます。

### ■ 1万口当たりの費用明細(2021年3月11日から2022年3月10日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用	8円	0.028%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：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付金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保管費用）	(8)	(0.027)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	8	0.028	

期中の平均基準価額は30,068円です。

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。  
※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。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

## パッシブ外国債券マザーファンド

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

#### 公社債

			買 付 額	売 付 額									
外	ア	メ	リ	カ	国	債	証	券	千アメリカ・ドル 110,297	千アメリカ・ドル 89,589			
	カ	ナ	ダ	国	債	証	券	千カナダ・ドル 6,613	千カナダ・ドル 7,185				
	オ	ー	ス	ト	ラ	リ	ア	国	債	証	券	千オーストラリア・ドル 1,089	千オーストラリア・ドル 8,698
	シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	国	債	証	券	千シンガポール・ドル 826	千シンガポール・ドル 1,143	
	イ	ギ	リ	ス	国	債	証	券	千イギリス・ポンド 3,525	千イギリス・ポンド 10,190			
	イ	ス	ラ	エ	ル	国	債	証	券	千イスラエル・シェケル 2,507	千イスラエル・シェケル 3,560		
	デ	ン	マ	ー	ク	国	債	証	券	千デンマーク・クローネ 2,140	千デンマーク・クローネ 5,708		
	ノ	ル	ウ	ェ	ー	国	債	証	券	千ノルウェー・クローネ 1,674	千ノルウェー・クローネ 715		
	ス	ウ	ェ	ー	デ	ン	国	債	証	券	千スウェーデン・クローナ 2,689	千スウェーデン・クローナ 5,752	
	メ	キ	シ	コ	国	債	証	券	千メキシコ・ペソ 10,789	千メキシコ・ペソ 20,759			
中	国	国	債	証	券	千オフショア・人民元 58,566	千オフショア・人民元 -						
マ	レ	ー	シ	ア	国	債	証	券	千マレーシア・リンギット 1,336	千マレーシア・リンギット 855			
ポ	ー	ラ	ン	ド	国	債	証	券	千ポーランド・ズロチ 26,165	千ポーランド・ズロチ 29,945			
ユ	ー	ロ	ク	国	債	証	券	千ユーロ 204	千ユーロ 575				
国	ア	イ	ル	ラ	ン	ド	国	債	証	券	2,009	1,963	
	オ	ラ	ン	ダ	国	債	証	券	1,105	2,593			
	ベ	ル	ギ	ー	国	債	証	券	10,452	12,799			
	フ	ラ	ン	ス	国	債	証	券	9,620	11,372			
	ド	イ	ツ	国	債	証	券	5,510	6,864				
	ス	ペ	イ	ン	国	債	証	券	8,769	12,936			
	イ	タ	リ	ア	国	債	証	券	397	455			
	フ	ィ	ン	ラ	ン	ド	国	債	証	券	951	1,455	
オ	ー	ス	ト	リ	ア	国	債	証	券				

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

## パッシブ外国債券マザーファンド

### ■ 利害関係人との取引状況等(2021年3月11日から2022年3月10日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

### ■ 組入れ資産の明細(2022年3月10日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち88格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 376,790	千アメリカ・ドル 375,968	千円 43,616,155	% 48.0	% -	% 22.0	% 17.0	% 9.0
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 19,740	千カナダ・ドル 20,047	1,815,260	2.0	-	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 16,853	千オーストラリア・ドル 16,947	1,437,012	1.6	-	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 4,300	千シンガポール・ドル 4,515	385,293	0.4	-	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 27,177	千イギリス・ポンド 31,970	4,886,652	5.4	-	4.2	0.8	0.4
イスラエル	千イスラエル・シケル 10,170	千イスラエル・シケル 10,971	390,447	0.4	-	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 18,481	千デンマーク・クローネ 22,120	381,130	0.4	-	0.3	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 18,420	千ノルウェー・クローネ 18,207	236,516	0.3	-	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 19,190	千スウェーデン・クローナ 20,600	246,794	0.3	-	0.1	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 117,450	千メキシコ・ペソ 115,555	640,803	0.7	-	0.4	0.2	0.1
中国	千オフショア・人民元 58,000	千オフショア・人民元 58,502	1,073,682	1.2	-	0.5	0.5	0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 16,720	千マレーシア・リンギット 16,950	469,943	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 15,650	千ポーランド・ズロチ 14,295	383,793	0.4	-	0.2	0.2	0.1

## パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	5,116	5,434	696,982	0.8	—	0.5	0.2	0.0
オ ラ ン ダ	11,490	12,976	1,664,301	1.8	—	1.3	0.3	0.2
ベ ル ギ ー	13,594	15,414	1,977,019	2.2	—	1.6	0.4	0.1
フ ラ ン ス	61,374	68,698	8,811,314	9.7	—	6.1	2.6	0.9
ド イ ツ	44,188	50,235	6,443,249	7.1	—	4.3	1.9	0.9
ス ペ イ ン	35,449	39,588	5,077,650	5.6	—	3.6	1.6	0.4
イ タ リ ア	55,321	61,001	7,824,046	8.6	—	5.1	2.4	1.1
フィンランド	4,040	4,186	536,971	0.6	—	0.4	0.2	0.1
オーストリア	8,726	9,638	1,236,294	1.4	—	0.9	0.3	0.2
合 計	—	—	90,231,318	99.2	—	54.6	30.2	14.4

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

### B 個別銘柄開示 外国(外貨建)公社債

区 分	銘 柄	種 類	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		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	720	800	92,903	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,860	1,868	216,771	2023/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,470	1,491	173,024	2023/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,760	1,792	207,989	2023/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,590	1,702	197,452	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	690	826	95,880	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,050	1,282	148,779	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,950	1,980	229,805	2024/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,930	1,968	228,410	2024/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	990	1,148	133,207	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,580	2,616	303,490	2024/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	1,100	1,321	153,361	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,220	1,362	158,040	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,530	2,558	296,851	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,200	1,205	139,848	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,300	1,424	165,280	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,560	1,572	182,403	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,320	1,330	154,401	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	960	1,054	122,322	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,350	1,355	157,249	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	780	840	97,528	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,640	1,660	192,647	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,120	1,235	143,273	2045/11/15	

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,300	1,286	149,268	2026/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	580	586	68,073	2046/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,930	1,936	224,633	2023/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	550	551	63,994	2023/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,350	1,354	157,188	2023/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,650	1,631	189,291	2026/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,280	1,296	150,359	2046/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,370	1,374	159,404	2023/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,170	1,169	135,635	2023/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,890	1,858	215,592	2026/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	720	717	83,284	2023/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,150	1,147	133,108	2023/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,540	1,488	172,700	2046/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,020	1,017	118,024	2023/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,150	1,150	133,483	2023/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,140	2,149	249,403	2026/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,340	1,351	156,788	2023/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,110	1,204	139,725	2046/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,530	2,557	296,669	2023/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,400	2,440	283,098	2027/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,730	1,748	202,882	2024/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,260	1,399	162,330	2047/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,440	1,452	168,476	2024/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,170	1,176	136,489	2024/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,710	1,724	200,019	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,660	1,698	197,073	2027/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,130	1,257	145,843	2047/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,920	1,930	223,973	2024/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	950	955	110,811	2024/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,200	1,210	140,374	2024/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,600	1,628	188,906	2027/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,430	1,528	177,364	2047/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	880	881	102,319	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	750	756	87,734	2024/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,330	1,345	156,064	2024/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,750	1,873	217,338	2047/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,840	1,872	217,200	2027/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,100	2,116	245,579	2024/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,230	1,244	144,353	2024/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,084	1,104	128,087	2025/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,090	2,187	253,805	2028/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,630	1,832	212,576	2048/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,960	1,987	230,567	2023/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	910	933	108,314	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,060	1,074	124,627	2023/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,400	1,432	166,136	2025/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	470	477	55,418	2023/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,240	1,278	148,301	2025/04/30	

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,886	1,989	230,758	2028/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,820	2,096	243,161	2048/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,650	1,677	194,630	2023/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,460	1,505	174,660	2025/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,270	1,289	149,622	2023/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,310	1,346	156,181	2025/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,550	1,577	182,962	2023/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,470	1,517	176,102	2025/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,350	2,481	287,914	2028/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,690	1,902	220,716	2048/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	950	977	113,385	2025/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	880	895	103,930	2023/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	860	877	101,809	2023/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	940	975	113,223	2025/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	940	959	111,297	2023/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,670	1,734	201,212	2025/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,800	1,933	224,306	2028/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	1,500	1,810	210,020	2048/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,429	165,865	2023/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,340	1,363	158,173	2023/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	990	1,005	116,603	2024/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,760	1,821	211,323	2025/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,320	1,355	157,247	2025/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,390	2,454	284,691	2026/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,140	2,236	259,413	2029/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,160	2,447	283,881	2049/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,280	1,296	150,441	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,270	1,298	150,681	2026/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,550	1,570	182,189	2026/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,900	1,920	222,786	2024/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,030	1,049	121,702	2026/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,000	2,060	239,033	2029/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,590	1,763	204,557	2049/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,750	1,764	204,745	2026/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,090	1,090	126,479	2024/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,160	1,158	134,412	2026/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,630	1,628	188,873	2026/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	730	729	84,660	2024/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,270	1,245	144,506	2029/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,910	1,873	217,389	2049/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	870	850	98,664	2026/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,140	1,125	130,536	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	860	853	99,043	2024/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	590	583	67,638	2026/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,400	3,373	391,317	2024/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,320	1,304	151,326	2026/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,770	1,752	203,347	2029/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	1,916	222,294	2049/11/15	



パッシブ外国債券マザーファンド

区分	銘柄	種類	期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,700	1,679	194,858	2026/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,640	1,625	188,620	2024/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,820	1,766	204,934	2030/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,080	1,933	224,351	2050/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	360	347	40,259	2027/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	930	892	103,581	2025/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	920	864	100,258	2027/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	760	755	87,622	2026/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,070	2,032	235,777	2027/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	380	377	43,787	2023/03/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	880	870	100,947	2023/04/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	860	842	97,710	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,320	2,290	265,671	2025/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,510	1,506	174,798	2024/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,190	2,880	334,219	2030/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,920	1,482	171,943	2050/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,300	1,234	143,201	2025/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	560	456	52,997	2040/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,690	1,572	182,393	2027/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	850	838	97,221	2023/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	700	689	80,020	2023/06/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,750	1,670	193,832	2025/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,650	1,537	178,344	2027/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,020	966	112,177	2025/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,260	1,237	143,567	2023/07/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,420	1,319	153,099	2027/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,150	1,088	126,281	2025/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,250	1,152	133,711	2027/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,580	3,222	373,813	2030/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,040	2,419	280,729	2050/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,870	1,833	212,675	2023/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	810	657	76,260	2040/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	460	426	49,464	2027/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,190	1,124	130,468	2025/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,000	944	109,520	2025/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,837	213,140	2027/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	2,800	2,736	317,467	2023/10/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	3,200	3,132	363,428	2023/09/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	4,310	3,953	458,672	2030/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,380	2,017	234,039	2050/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	4,380	4,096	475,253	2031/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,370	2,138	248,048	2051/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	850	801	92,991	2026/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	3,290	3,075	356,833	2028/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,680	1,588	184,253	2025/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,180	3,004	348,503	2025/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,550	2,369	274,943	2027/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,290	1,197	138,930	2027/12/31	

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,300	2,196	254,834	2028/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	830	702	81,476	2040/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,370	1,260	146,206	2041/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,750	1,656	192,214	2026/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	2,400	2,218	257,322	2027/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,900	1,790	207,709	2025/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,200	3,128	362,890	2023/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,700	1,652	191,708	2024/01/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,390	1,349	156,503	2024/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	3,050	3,019	350,302	2023/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,050	1,019	118,303	2024/03/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,500	1,432	166,238	2026/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,050	1,970	228,547	2028/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,250	4,142	480,598	2031/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	680	648	75,287	2026/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,630	2,664	309,084	2051/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,800	1,728	200,546	2028/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	720	703	81,555	2041/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,000	983	114,070	2023/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,250	3,142	364,511	2024/06/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,110	1,058	122,754	2026/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	800	766	88,877	2026/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,050	1,966	228,103	2028/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,350	2,255	261,653	2028/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,500	2,420	280,755	2024/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,880	3,650	423,530	2031/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,300	2,185	253,575	2028/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,750	2,558	296,768	2051/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,210	1,085	125,889	2041/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	3,300	3,237	375,639	2023/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,200	1,135	131,750	2026/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	1,850	1,745	202,486	2028/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	850	821	95,318	2024/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,840	1,750	203,035	2026/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,800	2,702	313,533	2024/09/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,020	1,933	224,324	2028/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,050	1,958	227,247	2026/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,570	1,538	178,527	2023/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	290	281	32,638	2024/10/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,730	1,565	181,637	2051/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,810	3,621	420,119	2031/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,780	1,718	199,381	2026/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	860	835	96,876	2026/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,520	2,430	281,975	2028/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,430	1,338	155,291	2041/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	1,200	1,173	136,134	2024/12/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,350	1,312	152,243	2028/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,520	2,483	288,062	2024/01/31	

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,510	1,480	171,725	2025/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,120	2,057	238,649	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,340	2,257	261,845	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	910	904	104,883	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,570	1,551	179,979	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	560	553	64,244	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,830	1,779	206,400	2024/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,380	1,336	155,002	2024/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	300	320	37,135	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	2,000	2,315	268,563	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,050	1,288	149,426	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	740	894	103,780	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	390	517	60,089	2030/05/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	570	732	84,929	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	290	380	44,132	2036/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.0000	310	430	49,994	2037/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	290	381	44,248	2038/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	330	440	51,077	2038/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	350	417	48,397	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	370	481	55,908	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	590	791	91,840	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	700	924	107,268	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	610	828	96,130	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	390	514	59,718	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	720	891	103,430	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	900	1,165	135,160	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	320	440	51,113	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	360	473	54,948	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,120	1,362	158,028	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	470	524	60,850	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	390	435	50,478	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	950	1,039	120,632	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	370	388	45,120	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,510	1,585	183,988	2042/11/15
	小 計			376,790	375,968	43,616,155	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	420	533	48,351	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	340	467	42,352	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	210	286	25,954	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	370	473	42,849	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	710	877	79,448	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	750	751	68,029	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	580	592	53,633	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	651	664	60,184	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	450	499	45,238	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	764	760	68,845	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	474	458	41,498	2027/06/01

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	711	714	64,653	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,186	1,137	103,013	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	938	946	85,686	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	350	356	32,263	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	560	579	52,482	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	646	655	59,337	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	590	589	53,384	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,350	1,294	117,204	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	390	386	34,994	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,120	1,078	97,625	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,100	982	89,009	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	840	795	72,048	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	920	896	81,192	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,180	1,144	103,622	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	570	561	50,809	2023/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	320	285	25,895	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	390	384	34,779	2023/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	480	463	41,936	2031/12/01
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	380	429	38,932	2064/12/01
	小 計			19,740	20,047	1,815,260	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	5.5000	千オーストラリア・ドル 780	千オーストラリア・ドル 821	69,616	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7500	570	644	54,676	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	620	639	54,188	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	711	760	64,470	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	621	752	63,765	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	900	941	79,793	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	849	926	78,576	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	610	701	59,448	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	349	360	30,532	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	370	382	32,466	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	370	398	33,819	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	570	573	48,628	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	560	572	48,581	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	570	590	50,068	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	820	850	72,101	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	700	713	60,462	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	613	611	51,836	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	760	710	60,203	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	870	839	71,150	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	690	623	52,864	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	950	853	72,387	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	580	450	38,233	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	700	659	55,909	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	860	763	64,703	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	450	420	35,691	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	410	387	32,837	2032/11/21
	小 計			16,853	16,947	1,437,012	—

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 330	千シンガポール・ドル 357	30,490	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	290	301	25,695	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	370	399	34,072	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	180	199	17,020	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	350	357	30,475	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	230	263	22,481	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	320	342	29,244	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	330	339	28,938	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	350	388	33,180	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	270	275	23,483	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	250	255	21,808	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	310	325	27,761	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	220	223	19,030	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	130	135	11,569	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	210	197	16,844	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	80	78	6,695	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	80	76	6,500	2051/10/01
	小 計			4,300	4,515	385,293	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 740	千イギリス・ポンド 960	146,824	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	650	818	125,059	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	600	663	101,406	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	637	843	128,970	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	660	957	146,388	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	660	1,107	169,325	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	730	1,102	168,588	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	580	671	102,691	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	575	856	130,912	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	740	943	144,239	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	660	1,034	158,148	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	530	735	112,458	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	575	761	116,343	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	690	1,161	177,566	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	480	676	103,330	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	720	1,077	164,731	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	890	1,140	174,276	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	2.2500	1,100	1,113	170,187	2023/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	670	1,099	168,070	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	440	454	69,412	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	680	910	139,144	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	430	439	67,173	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	570	740	113,166	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	910	917	140,245	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	800	768	117,407	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	590	595	90,961	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.7500	520	536	82,043	2057/07/22

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	UK GILT	国債証券	1.2500	660	657	100,565	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	0.7500	730	724	110,693	2023/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	250	254	38,927	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	522	79,795	2071/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	840	833	127,351	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	390	396	60,551	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	290	288	44,121	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	290	279	42,740	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	660	645	98,618	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	510	467	71,424	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	720	663	101,488	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	130	89	13,659	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	300	230	35,265	2050/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	660	630	96,396	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	140	130	19,929	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.1250	300	292	44,731	2024/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	330	288	44,063	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	970	865	132,229	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.8750	50	41	6,390	2046/01/31
	UK GILT	国債証券	1.2500	130	117	17,933	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	110	103	15,824	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.5000	40	38	5,906	2053/07/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	180	171	26,138	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	170	149	22,827	2073/10/22
	小 計			27,177	31,970	4,886,652	—
イ ス ラ エ ル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.7500	550	559	19,915	2025/08/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	1,910	2,193	78,070	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,220	2,244	79,876	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	2,070	2,526	89,903	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	1,820	1,894	67,410	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	300	262	9,359	2037/05/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.1500	1,300	1,290	45,910	2023/07/31
	小 計			10,170	10,971	390,447	—
デ ン マ ー ク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	5,400	8,914	153,590	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5000	1,560	1,612	27,789	2023/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	1,544	1,647	28,394	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	3,067	3,125	53,847	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	4,060	4,120	70,996	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	1,010	903	15,564	2052/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	1,070	1,021	17,597	2031/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	770	774	13,350	2024/11/15
	小 計			18,481	22,120	381,130	—
ノ ル ウ ェ ー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	3,390	3,414	44,358	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	2,370	2,426	31,517	2024/03/14

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,930	1,918	24,916	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,110	1,089	14,151	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,670	1,648	21,409	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	2,160	2,153	27,975	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,840	1,795	23,327	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	1,970	1,857	24,133	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,000	925	12,023	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.1250	980	977	12,703	2032/05/18
	小 計			18,420	18,207	236,516	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,900	2,732	32,730	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,880	3,977	47,645	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,200	1,392	16,684	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	3,040	3,253	38,976	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	3,160	3,237	38,780	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,950	1,978	23,704	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	2,410	2,446	29,303	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	1,650	1,583	18,969	2031/05/12
	小 計			19,190	20,600	246,794	—
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	10,100	10,085	55,928	2023/12/07
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	11,880	12,442	68,997	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	12,870	12,487	69,249	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	10.0000	5,770	6,503	36,065	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	10,890	10,993	60,966	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	7,460	7,403	41,055	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	11,110	10,655	59,086	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	8,110	7,391	40,987	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	3,610	3,427	19,005	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	11,720	10,787	59,818	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	7,130	6,661	36,942	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	10,610	10,588	58,719	2024/09/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	6.7500	6,190	6,127	33,981	2023/03/09
	小 計			117,450	115,555	640,803	—
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	14,000	14,059	258,029	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	12,000	12,036	220,910	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5600	8,000	8,038	147,529	2023/10/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	11,000	11,059	202,969	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	5,000	5,239	96,157	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	8,000	8,068	148,085	2031/05/27
	小 計			58,000	58,502	1,073,682	—
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	640	644	17,871	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	340	359	9,967	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	530	554	15,372	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	810	839	23,282	2031/06/30

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	450	462	12,820	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	420	427	11,840	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	950	946	26,253	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	610	616	17,093	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	810	835	23,177	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	470	508	14,089	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,570	1,619	44,903	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	460	467	12,951	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	530	541	15,014	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	640	667	18,514	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	860	871	24,173	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	250	268	7,435	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	800	756	20,983	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.7570	650	662	18,380	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.4780	110	111	3,100	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.0590	140	144	4,005	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8820	340	349	9,685	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9060	40	41	1,140	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9000	620	636	17,647	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8990	500	513	14,231	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	2.6320	700	642	17,818	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.6420	260	276	7,670	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8280	950	935	25,925	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.7620	220	236	6,557	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.8930	150	162	4,495	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.7570	900	849	23,539	2040/05/22
	小 計			16,720	16,950	469,943	—
ポ ー ラ ン ド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,350	2,473	66,396	2029/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,949	79,185	2023/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,595	42,822	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,260	1,112	29,859	2027/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	820	779	20,928	2024/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	360	311	8,364	2029/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	700	654	17,568	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,050	1,801	48,377	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	770	581	15,599	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,350	1,890	50,763	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	190	146	3,927	2032/04/25
	小 計			15,650	14,295	383,793	—
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	436	509	65,392	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.9000	240	251	32,194	2023/03/20
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	400	431	55,296	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	590	681	87,380	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	410	480	61,693	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	510	531	68,171	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	326	41,888	2037/05/15



パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	220	229	29,434	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	200	208	26,780	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	170	181	23,269	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	240	251	32,274	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	180	188	24,201	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.4000	260	242	31,056	2035/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	270	270	34,727	2027/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	320	310	39,771	2030/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	200	185	23,828	2031/10/18
	IRISH GOVT	国債証券	0.5500	170	152	19,619	2041/04/22
	オ ラ ン ダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	480	633	81,301
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	4.0000	670	1,004	128,780	2037/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	3.7500	730	1,175	150,801	2042/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	2.5000	590	719	92,313	2033/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	1.7500	720	743	95,335	2023/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	2.0000	580	613	78,630	2024/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	2.7500	740	1,130	145,007	2047/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.2500	690	701	90,016	2025/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.5000	750	771	98,939	2026/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.7500	810	842	108,114	2027/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.0000	640	645	82,819	2024/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.7500	580	604	77,571	2028/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.2500	500	501	64,355	2029/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.5000	400	399	51,196	2040/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.0000	570	556	71,392	2030/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.0000	380	380	48,842	2027/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.0000	420	353	45,367	2052/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT		国債証券	0.0000	510	494	63,368	2031/07/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	300	274	35,233	2038/01/15	
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	230	227	29,118	2029/01/15	
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	201	25,794	2032/07/15	
ベ ル ギ ー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	638	847	108,751	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	720	1,089	139,762	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	660	1,017	130,472	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	370	440	56,450	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	360	479	61,558	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	540	559	71,719	2023/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	570	609	78,126	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	430	654	83,885	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	350	440	56,480	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	700	723	92,787	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	810	844	108,335	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	310	353	45,401	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	752	786	100,830	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	470	504	64,722	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2000	370	374	47,996	2023/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	230	285	36,610	2066/06/22
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	671	696	89,393	2027/06/22	

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	400	408	52,417	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	220	273	35,068	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	230	245	31,489	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	703	730	93,645	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	530	563	72,301	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	600	625	80,236	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	350	382	49,112	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	460	447	57,397	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	290	257	32,971	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	120	119	15,296	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	230	162	20,878	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	350	329	42,318	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4000	160	160	20,599	2053/06/22
フ ラ ンス	FRANCE OAT.	国債証券	8.5000	820	904	115,983	2023/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	1,200	1,472	188,839	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	1,400	1,922	246,561	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	1,200	1,842	236,325	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	1,110	1,669	214,138	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	900	1,584	203,253	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,130	1,680	215,549	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.2500	1,800	1,941	249,028	2023/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	1,440	2,331	299,012	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	680	1,246	159,837	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	2,019	2,318	297,401	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	2,080	2,393	306,949	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	1,020	1,477	189,553	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,660	1,708	219,103	2023/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	1,700	1,799	230,812	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,600	1,690	216,804	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	2,060	2,417	310,070	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,620	1,657	212,589	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,443	1,502	192,732	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	1,990	2,171	278,578	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,522	1,557	199,760	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,510	1,592	204,229	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	520	596	76,506	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	1,700	1,719	220,569	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,080	1,234	158,289	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,460	1,530	196,349	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	1,100	1,320	169,414	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	840	845	108,461	2023/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	1,800	1,863	238,973	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,520	1,607	206,130	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	2,110	2,182	279,984	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,410	1,421	182,318	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	1,280	1,383	177,470	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,810	1,837	235,632	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,530	1,540	197,550	2025/03/25

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,540	1,498	192,254	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	920	813	104,311	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,490	1,494	191,690	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,870	1,795	230,252	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	940	866	111,185	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,130	1,139	146,213	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	350	239	30,701	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	390	346	44,475	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,680	1,588	203,772	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	480	478	61,418	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	260	243	31,240	2032/05/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	0.7500	260	226	29,031	2053/05/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	400	450	57,763	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	790	1,069	137,221	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	560	747	95,908	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	540	704	90,381	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	730	1,088	139,623	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	1,140	1,688	216,559	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,040	1,619	207,735	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,108	1,715	220,086	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	737	1,232	158,132	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	849	1,525	195,694	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	750	1,191	152,841	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,046	1,551	199,030	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.0000	1,000	1,038	133,205	2023/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	1,260	1,292	165,744	2023/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	910	949	121,807	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	820	856	109,907	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,190	1,813	232,575	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	915	939	120,533	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	550	569	73,064	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,020	1,066	136,844	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	1,660	1,710	219,352	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,060	1,070	137,335	2026/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,240	1,266	162,428	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	761	787	100,948	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,120	1,378	176,813	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	1,250	1,293	165,954	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	960	978	125,566	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	990	1,008	129,374	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	850	849	108,953	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	930	836	107,288	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	750	747	95,821	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	620	595	76,427	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,050	1,042	133,742	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	770	774	99,385	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	500	498	63,927	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	550	544	69,791	2031/02/15

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	550	524	67,235	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	440	399	51,193	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	810	811	104,117	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	750	738	94,754	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	330	325	41,773	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	270	238	30,602	2052/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	370	362	46,523	2032/02/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	0.0000	50	50	6,462	2023/06/16
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	0.0000	660	666	85,427	2023/09/15
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	802	808	103,642	2023/04/14
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	900	909	116,644	2023/10/13
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	880	889	114,036	2024/04/05
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	1,610	1,628	208,834	2024/10/18
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	1,010	1,021	131,023	2025/04/11
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	1,010	1,021	131,006	2025/10/10
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	500	505	64,782	2026/04/10
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	830	837	107,417	2026/10/09
ス ペ イ ン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	850	1,161	149,029	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	710	667	85,582	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,070	1,566	200,915	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	820	1,139	146,098	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	710	1,107	141,987	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	900	987	126,696	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	830	1,276	163,681	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	989	1,140	146,288	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	970	1,209	155,110	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	630	815	104,644	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	600	1,006	129,129	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	930	1,010	129,591	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	910	979	125,681	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	890	934	119,885	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	880	944	121,168	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	1,071	1,167	149,729	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	945	1,010	129,653	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.4000	860	927	118,972	2023/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	690	859	110,196	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	640	871	111,804	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	1,010	1,057	135,581	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	900	949	121,747	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	590	664	85,279	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	995	1,048	134,505	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	990	1,041	133,632	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	560	674	86,528	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.3500	490	495	63,489	2023/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	989	1,039	133,353	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	970	1,022	131,149	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	790	841	107,951	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	440	444	56,954	2024/07/30

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.6000	780	772	99,142	2029/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	680	664	85,208	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	770	783	100,541	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	700	575	73,767	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	890	890	114,229	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	480	482	61,880	2023/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	1,020	1,051	134,851	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	350	347	44,509	2026/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	1,040	1,043	133,821	2024/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.1000	730	674	86,515	2031/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	210	162	20,838	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	540	523	67,118	2028/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	360	329	42,275	2037/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	780	740	94,987	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	80	71	9,223	2042/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	180	172	22,142	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9000	240	238	30,577	2052/10/31
イ タ リ ア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	9.0000	570	655	84,123	2023/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	563	732	93,960	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	980	1,282	164,476	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,110	1,365	175,134	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,020	1,076	138,135	2023/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	820	831	106,654	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	550	481	61,723	2037/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.2500	970	1,259	161,513	2029/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	1,240	1,724	221,192	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	820	1,157	148,506	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	810	1,103	141,513	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	1,050	1,334	171,172	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	890	1,280	164,286	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,040	1,113	142,851	2023/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	870	990	127,073	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	870	1,265	162,302	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,050	1,213	155,655	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,089	139,685	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	820	1,195	153,382	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	930	1,012	129,843	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	1,200	1,402	179,823	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	730	774	99,346	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	620	739	94,817	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	800	828	106,295	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	1,040	1,046	134,264	2032/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	970	1,023	131,336	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,126	1,171	150,277	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	600	655	84,102	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	640	648	83,220	2023/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	690	722	92,720	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	600	614	78,875	2026/12/01

パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6500	570	577	74,114	2023/10/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	510	526	67,533	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	760	819	105,056	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	740	791	101,523	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	972	1,009	129,504	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	570	701	89,956	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	680	721	92,558	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,010	1,041	133,588	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	540	614	78,775	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,310	1,387	177,974	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	390	395	50,684	2023/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	910	941	120,697	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	540	599	76,903	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	770	801	102,855	2023/10/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	670	719	92,254	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	580	682	87,506	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	600	786	100,877	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	880	991	127,133	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7500	460	476	61,162	2024/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	570	605	77,629	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	560	648	83,158	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3500	840	839	107,728	2030/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	750	750	96,292	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	800	803	103,010	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	730	702	90,119	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	540	514	65,957	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	550	562	72,082	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	710	718	92,213	2023/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	510	533	68,480	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	650	651	83,580	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	670	668	85,749	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8000	350	332	42,684	2041/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	440	382	49,106	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	640	640	82,125	2024/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	800	757	97,125	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	760	696	89,282	2031/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.2500	630	601	77,133	2028/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	290	255	32,740	2045/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	480	479	61,467	2024/04/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	220	191	24,571	2072/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	660	636	81,608	2028/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	550	517	66,421	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	200	200	25,653	2024/01/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	450	436	55,959	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	220	208	26,785	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	80	74	9,575	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	220	209	26,872	2052/09/01
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	260	296	38,018	2025/07/04

## パッシブ外国債券マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	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	
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	250	290	37,208	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	210	281	36,060	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	240	245	31,489	2023/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	220	231	29,641	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	290	295	37,951	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.8750	200	207	26,556	2025/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	204	26,210	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	170	171	21,958	2023/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	180	202	26,001	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	153	19,646	2027/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.1250	160	167	21,435	2034/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	130	131	16,917	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	280	282	36,272	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	300	302	38,758	2024/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	120	108	13,929	2036/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	220	196	25,175	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	180	172	22,133	2030/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	130	103	13,231	2052/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	150	143	18,374	2031/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	436	580	74,411	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	540	799	102,578	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	360	433	55,630	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	180	335	42,981	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	310	453	58,119	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.7500	440	456	58,514	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	480	575	73,832	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	430	453	58,133	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	460	482	61,901	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	550	568	72,904	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	290	325	41,761	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	290	292	37,466	2023/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	320	327	41,943	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	300	309	39,723	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	500	505	64,779	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	260	262	33,671	2024/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	300	288	37,063	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	570	573	73,552	2023/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	220	204	26,262	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.1000	40	51	6,638	2117/09/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	380	411	52,774	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	130	92	11,815	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	200	168	21,554	2040/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	650	617	79,164	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7000	90	71	9,114	2071/04/20
	小 計			239,298	267,174	34,267,830	—
	合 計			—	—	90,231,318	—

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

## パッシブ外国債券マザーファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年3月10日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 90,231,318	% 99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	788,264	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	91,019,582	100.0

※期末における外貨建資産(90,957,017千円)の投資信託財産総額(91,019,582千円)に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=116.01円、1カナダ・ドル=90.55円、1オーストラリア・ドル=84.79円、1シンガポール・ドル=85.33円、1イギリス・ポンド=152.85円、1イスラエル・シェケル=35.587円、1デンマーク・クローネ=17.23円、1ノルウェー・クローネ=12.99円、1スウェーデン・クローナ=11.98円、1メキシコ・ペソ=5.545円、1オフショア・人民元=18.352円、1マレーシア・リンギット=27.725円、1ポーランド・ズロチ=26.847円、1ユーロ=128.26円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月10日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	91,126,479,745円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	171,690,930
公 社 債 ( 評 価 額 )	90,231,318,194
未 収 入 金	193,539,912
未 収 利 息	507,575,299
前 払 費 用	22,355,410
(B) 負 債	193,603,830
未 払 金	107,118,578
未 払 解 約 金	86,482,909
そ の 他 未 払 費 用	2,343
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	90,932,875,915
元 本	30,871,719,132
次 期 繰 越 損 益 金	60,061,156,783
(D) 受 益 権 総 口 数	30,871,719,132口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	29,455円

※当期における期首元本額31,525,342,499円、期中追加設定元本額2,134,055,932円、期中一部解約元本額2,787,679,299円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンド 25,023,400,830円  
SMAM・年金パッシブ外国債券ファンド<非課税適格機関投資家限定> 5,847,302,047円  
SMAM・外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) 1,016,255円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

### ■ 損益の状況

(自2021年3月11日 至2022年3月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,729,993,070円
受 取 利 息	1,730,076,819
支 払 利 息	△ 83,749
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,863,971,085
売 買 損 益	3,263,325,597
売 買 損 益	△ 5,127,296,682
(C) そ の 他 費 用 等	△ 25,672,579
(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )	△ 159,650,594
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	61,495,636,260
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 5,566,200,235
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,291,371,352
(H) 合 計 ( D + E + F + G )	60,061,156,783
次 期 繰 越 損 益 金 ( H )	60,061,156,783

※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。

※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し引いた差額分をいいます。

※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し引いた差額分をいいます。

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

該当事項はございません。