

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	
信託期間	信託期間は2003年3月27日から無期限です。	
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。	
主要運用対象	外国債券オープン (毎月決算型)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券 インデックス マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券オープン (毎月決算型)	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	外国債券 インデックス マザーファンド	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	原則として、毎月19日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。 分配金額については、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。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

外国債券オープン (毎月決算型)

運用報告書(全体版)

第252期(決算日 2024年4月19日)	第255期(決算日 2024年7月19日)
第253期(決算日 2024年5月20日)	第256期(決算日 2024年8月19日)
第254期(決算日 2024年6月19日)	第257期(決算日 2024年9月19日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容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
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		債券組 入率	債券先 物率	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			
第39	第228期(2022年 4月19日)	円 8,289	円 10	% 2.3	514.142	% 2.3	% 97.8	% 1.3	百万円 4,136
	第229期(2022年 5月19日)	8,128	10	△1.8	508.607	△1.1	97.8	1.3	4,051
	第230期(2022年 6月20日)	8,258	10	1.7	515.570	1.4	98.2	0.9	4,099
	第231期(2022年 7月19日)	8,472	10	2.7	531.761	3.1	98.6	0.6	4,173
	第232期(2022年 8月19日)	8,375	10	△1.0	523.280	△1.6	98.1	1.0	4,100
第40	第233期(2022年 9月20日)	8,413	10	0.6	529.190	1.1	98.5	1.0	4,083
	第234期(2022年10月19日)	8,394	10	△0.1	528.988	△0.0	98.0	1.1	4,060
	第235期(2022年11月21日)	8,214	10	△2.0	518.332	△2.0	97.9	1.0	3,946
	第236期(2022年12月19日)	8,118	10	△1.0	515.903	△0.5	98.0	1.1	3,889
	第237期(2023年 1月19日)	7,812	10	△3.6	496.701	△3.7	98.4	0.8	3,730
第41	第238期(2023年 2月20日)	7,904	10	1.3	501.920	1.1	97.9	1.1	3,761
	第239期(2023年 3月20日)	7,962	10	0.9	504.300	0.5	98.8	0.4	3,772
	第240期(2023年 4月19日)	8,028	10	1.0	511.906	1.5	98.7	0.3	3,788
	第241期(2023年 5月19日)	8,183	10	2.1	524.337	2.4	94.2	0.5	3,843
	第242期(2023年 6月19日)	8,430	10	3.1	538.688	2.7	98.7	0.5	3,925
第42	第243期(2023年 7月19日)	8,356	10	△0.8	535.816	△0.5	98.6	0.6	3,851
	第244期(2023年 8月21日)	8,432	10	1.0	542.463	1.2	98.7	0.3	3,868
	第245期(2023年 9月19日)	8,478	10	0.7	546.522	0.7	98.4	0.6	3,867
	第246期(2023年10月19日)	8,351	10	△1.4	539.800	△1.2	98.3	0.6	3,778
	第247期(2023年11月20日)	8,714	10	4.5	562.616	4.2	98.5	0.5	3,927
第43	第248期(2023年12月19日)	8,589	10	△1.3	559.191	△0.6	98.5	0.5	3,834
	第249期(2024年 1月19日)	8,799	10	2.6	571.887	2.3	98.1	0.8	3,892
	第250期(2024年 2月19日)	8,841	10	0.6	576.721	0.8	97.7	1.1	3,897
	第251期(2024年 3月19日)	8,834	10	0.0	576.945	0.0	98.4	0.5	3,884
	第252期(2024年 4月19日)	8,979	10	1.8	587.633	1.9	97.9	0.7	3,900
第43	第253期(2024年 5月20日)	9,211	10	2.7	602.003	2.4	98.3	0.4	3,979
	第254期(2024年 6月19日)	9,347	10	1.6	614.212	2.0	98.1	0.6	4,025
	第255期(2024年 7月19日)	9,413	10	0.8	617.527	0.5	98.4	0.5	4,030
	第256期(2024年 8月19日)	9,018	10	△4.1	593.858	△3.8	98.0	0.8	3,847
	第257期(2024年 9月19日)	8,878	10	△1.4	580.812	△2.2	98.3	0.6	3,788

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

参考指数は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基準価額		参考指数		債券組 比率	債券 先物 比率	債券 物率 比率
		円	騰落率	騰落率	騰落率			
第252期	(期首)2024年3月19日	8,834	—	576.945	—	98.4	0.5	0.5
	(期末)2024年4月19日	8,989	1.8	587.633	1.9	97.9	0.7	0.7
第253期	(期首)2024年4月19日	8,979	—	587.633	—	97.9	0.7	0.7
	(期末)2024年5月20日	9,221	2.7	602.003	2.4	98.3	0.4	0.4
第254期	(期首)2024年5月20日	9,211	—	602.003	—	98.3	0.4	0.4
	(期末)2024年6月19日	9,357	1.6	614.212	2.0	98.1	0.6	0.6
第255期	(期首)2024年6月19日	9,347	—	614.212	—	98.1	0.6	0.6
	(期末)2024年7月19日	9,423	0.8	617.527	0.5	98.4	0.5	0.5
第256期	(期首)2024年7月19日	9,413	—	617.527	—	98.4	0.5	0.5
	(期末)2024年8月19日	9,028	△4.1	593.858	△3.8	98.0	0.8	0.8
第257期	(期首)2024年8月19日	9,018	—	593.858	—	98.0	0.8	0.8
	(期末)2024年9月19日	8,888	△1.4	580.812	△2.2	98.3	0.6	0.6

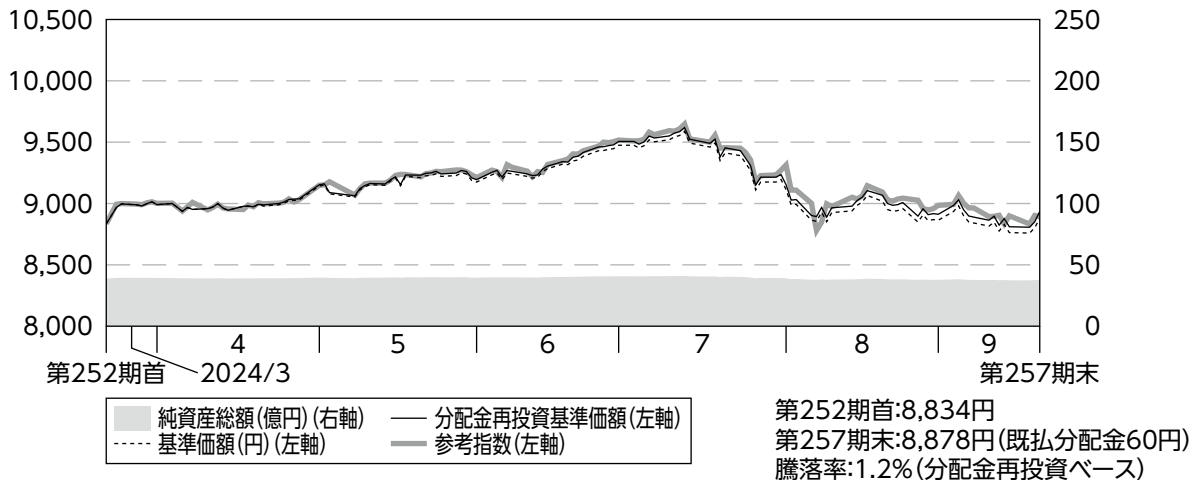
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

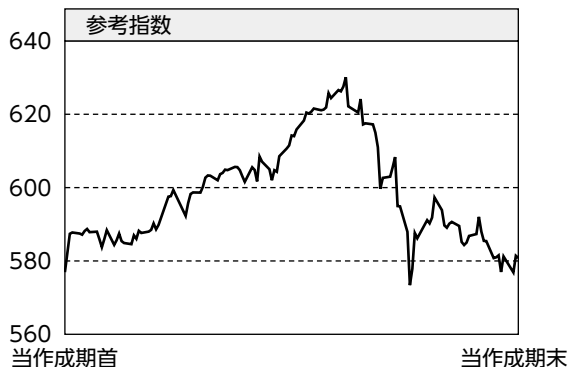


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及び参考指数は、2024年3月19日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債に投資した結果、当作成期の基準価額は上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、当作成期を通じて低下(債券価格は上昇)しました。2024年4月にかけて、米経済指標が堅調な景気を示す中、消費者物価指標が根強いインフレを意識させる内容であったことなどから、利回りは上昇しました。2024年7月以降は雇用関連指標が労働市場の減速を示したほか、物価指標の鈍化が続いたことから、FRB(米連邦準備理事会)による利下げ観測が高まり、利回りは低下しました。

外国為替市場では、2024年7月にかけて、日本と欧米の主要な中央銀行の金融政策の違いと金利差拡大を背景に、主要通貨は対円で概ね上昇しました。その後当作成期末にかけては、日銀が利上げ継続姿勢を維持する一方、根強い米国の利下げ観測などにより、対円で下落に転じました。当作成期を通じてみると、主要通貨は対円で概ね下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2)ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

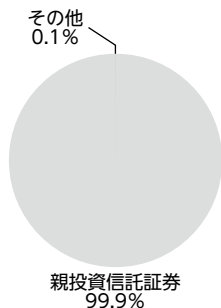
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

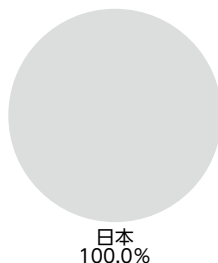
	当作成期末
	2024年9月19日
外国債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

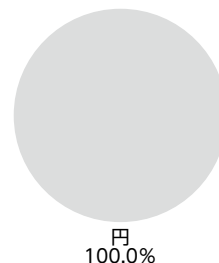
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

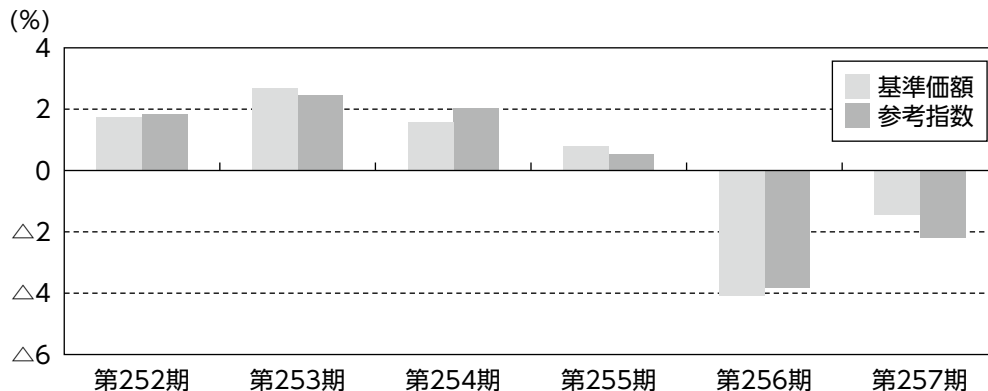


(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)と参考指数の騰落率の対比です。



分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
	2024年3月20日～ 2024年4月19日	2024年4月20日～ 2024年5月20日	2024年5月21日～ 2024年6月19日	2024年6月20日～ 2024年7月19日	2024年7月20日～ 2024年8月19日	2024年8月20日～ 2024年9月19日
当期分配金 (円)	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率) (%)	(0.111)	(0.108)	(0.107)	(0.106)	(0.111)	(0.113)
当期の収益 (円)	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	330	339	430	495	498	500

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2024年3月20日~2024年9月19日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	46円	0.499%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,127円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(20)	(0.222)	
(販売会社)	(23)	(0.250)	
(受託会社)	(3)	(0.028)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	2	0.018	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(1)	(0.015)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	48	0.517	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

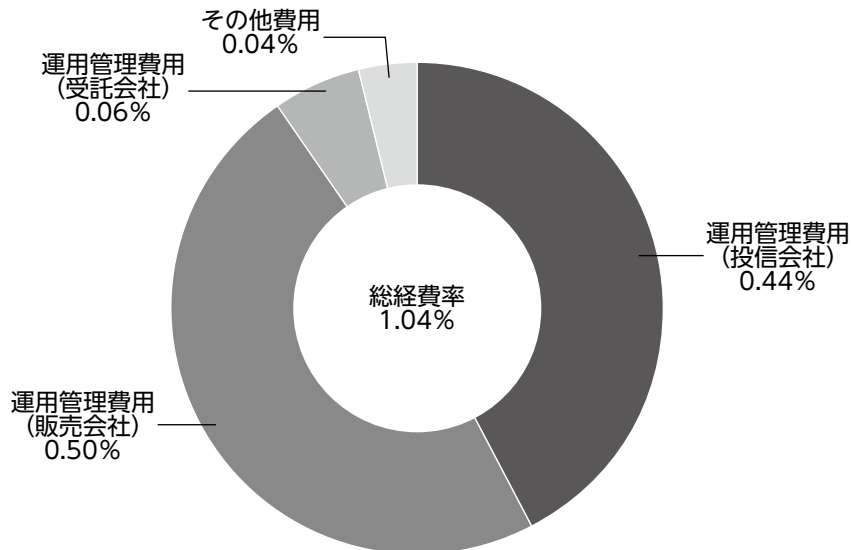
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.04%です。



(注1)各費用は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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 2,049	千円 7,415	千口 47,515	千円 171,286

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.020700	百万円 0.020700	% 100.0	百万円 0.020700	百万円 0.020700	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	478	100	20.9	477	99	20.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 先 物 取 引	百万円 41,964	百万円 18,710	% 44.6	百万円 41,441	百万円 16,231	% 39.2
為 替 直 物 取 引	37,853	15,575	41.1	8,784	6,677	76.0
金 銭 信 託	21	21	100.0	21	21	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	415,320	86,989	20.9	414,485	86,167	20.8

<平均保有割合 1.1%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	前 作 成 期 末			当 作 成 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 1,116,773	千口 1,071,307	千円 3,786,214	千口 1,071,307	千口 1,071,307	千円 3,786,214

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、101,029,959千口です。

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	千円 3,786,214	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,818	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	3,796,032	100.0

(注1)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(352,673,131千円)の投資信託財産総額(359,325,546千円)に対する比率は98.1%です。

(注2)外貨建資産は、当作成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。

1米ドル=143.64円	1カナダドル=105.35円	1メキシコペソ=7.4506円
1ユーロ=159.27円	1イギリスポンド=189.27円	1スウェーデンクローナ=14.04円
1ノルウェークローネ=13.51円	1デンマーククローネ=21.35円	1ポーランドズロチ=37.2736円
1オーストラリアドル=96.91円	1ニュージーランドドル=88.96円	1シンガポールドル=110.61円
1マレーシアリンギット=33.6946円	1オフショア人民元=20.2165円	1イスラエルシェケル=37.9385円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	第252期末 2024年4月19日現在	第253期末 2024年5月20日現在	第254期末 2024年6月19日現在	第255期末 2024年7月19日現在	第256期末 2024年8月19日現在	第257期末 2024年9月19日現在
(A)資 産	3,908,210,295円	3,986,756,160円	4,033,147,538円	4,039,354,014円	3,855,693,589円	3,796,032,241円
コール・ローン等	5,274,101	5,214,206	5,297,511	9,739,659	5,209,667	5,083,405
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,898,589,341	3,977,220,560	4,023,346,980	4,029,614,337	3,846,288,217	3,786,214,535
未 収 入 金	4,346,844	4,321,385	4,503,038	—	4,195,674	4,734,272
未 収 利 息	9	9	9	18	31	29
(B)負 債	7,652,909	7,669,996	7,775,853	9,331,374	8,467,694	7,896,817
未払収益分配金	4,344,202	4,320,058	4,306,643	4,281,440	4,266,232	4,266,747
未払解約金	145	19,715	211,247	1,725,729	917,651	431,555
未払信託報酬	3,290,294	3,311,831	3,239,978	3,305,850	3,265,680	3,180,856
その他未払費用	18,268	18,392	17,985	18,355	18,131	17,659
(C)純資産総額(A-B)	3,900,557,386	3,979,086,164	4,025,371,685	4,030,022,640	3,847,225,895	3,788,135,424
元 本	4,344,202,452	4,320,058,862	4,306,643,206	4,281,440,584	4,266,232,470	4,266,747,357
次期繰越損益金	△443,645,066	△340,972,698	△281,271,521	△251,417,944	△419,006,575	△478,611,933
(D)受 益 権 総 口 数	4,344,202,452口	4,320,058,862口	4,306,643,206口	4,281,440,584口	4,266,232,470口	4,266,747,357口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,979円	9,211円	9,347円	9,413円	9,018円	8,878円

■損益の状況

項 目	第 252 期 自 2024年3月20日 至 2024年4月19日	第 253 期 自 2024年4月20日 至 2024年5月20日	第 254 期 自 2024年5月21日 至 2024年6月19日	第 255 期 自 2024年6月20日 至 2024年7月19日	第 256 期 自 2024年7月20日 至 2024年8月19日	第 257 期 自 2024年8月20日 至 2024年9月19日
(A) 配 当 等 收 益	201円	211円	196円	235円	555円	645円
受 取 利 息	201	211	196	235	555	645
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	70,348,496	107,807,500	66,184,315	35,645,433	△160,851,581	△52,042,245
売 買 益	71,188,748	108,133,061	66,217,762	36,052,220	774,079	63,585
売 買 損	△840,252	△325,561	△33,447	△406,787	△161,625,660	△52,105,830
(C) 信 託 報 酬 等	△3,308,562	△3,330,223	△3,257,963	△3,324,205	△3,283,811	△3,198,515
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	67,040,135	104,477,488	62,926,548	32,321,463	△164,134,837	△55,240,115
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△118,246,412	△55,177,846	44,809,879	102,550,202	130,012,416	△38,343,155
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△388,094,587	△385,952,282	△384,701,305	△382,008,169	△380,617,922	△380,761,916
(配当等相当額)	(82,490,793)	(82,089,189)	(81,899,439)	(81,718,864)	(81,563,821)	(81,734,734)
(売買損益相当額)	(△470,585,380)	(△468,041,471)	(△466,600,744)	(△463,727,033)	(△462,181,743)	(△462,496,650)
(G) 計 (D+E+F)	△439,300,864	△336,652,640	△276,964,878	△247,136,504	△414,740,343	△474,345,186
(H) 收 益 分 配 金	△4,344,202	△4,320,058	△4,306,643	△4,281,440	△4,266,232	△4,266,747
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△443,645,066	△340,972,698	△281,271,521	△251,417,944	△419,006,575	△478,611,933
追 加 信 託 差 損 益 金	△388,094,587	△385,952,282	△384,701,305	△382,008,169	△380,617,922	△380,761,916
(配当等相当額)	(82,493,170)	(82,090,319)	(81,900,644)	(81,723,776)	(81,566,527)	(81,736,271)
(売買損益相当額)	(△470,587,757)	(△468,042,601)	(△466,601,949)	(△463,731,945)	(△462,184,449)	(△462,498,187)
分 配 準 備 積 立 金	61,035,186	64,758,242	103,429,784	130,590,225	130,977,280	131,616,818
繰 越 損 益 金	△116,585,665	△19,778,658	—	—	△169,365,933	△229,466,835

(注1) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 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) (F) 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。

<注記事項>

※当ファンドの第252期首元本額は4,396,927,736円、第252～257期中追加設定元本額は35,503,790円、第252～257期中一部解約元本額は165,684,169円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 252 期	第 253 期	第 254 期	第 255 期	第 256 期	第 257 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	8,075,247円	8,422,542円	8,137,464円	7,924,977円	5,231,096円	5,045,113円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	—円	—円	35,091,401円	24,396,486円	—円	—円
(C) 収益調整金額	82,493,170円	82,090,319円	81,900,644円	81,723,776円	81,566,527円	81,736,271円
(D) 分配準備積立金額	57,304,141円	60,655,758円	64,507,562円	102,550,202円	130,012,416円	130,838,452円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	147,872,558円	151,168,619円	189,637,071円	216,595,441円	216,810,039円	217,619,836円
(F) 期末残存口数	4,344,202,452口	4,320,058,862口	4,306,643,206口	4,281,440,584口	4,266,232,470口	4,266,747,357口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	340円	349円	440円	505円	508円	510円
(H) 分配金額(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円
(I) 収益分配金総額(F×H/10,000)	4,344,202円	4,320,058円	4,306,643円	4,281,440円	4,266,232円	4,266,747円

分配金のお知らせ

	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
1万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、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)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
第20期(2020年5月29日)	円 29,017	% 6.0	481,049	% 5.9	% 97.3	% 2.1	百万円 276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1	304,255
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9	306,130
第23期(2023年5月29日)	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4	0.8	269,104
第24期(2024年5月29日)	36,514	15.0	604,736	15.1	98.1	0.8	348,177

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	騰落	率	騰落	率		
(当期首) 2023年 5月29日	円 31,760	% —	525,385	% —	% 98.4	% 0.8
5月末	31,812	0.2	527,860	0.5	98.1	0.9
6月末	33,081	4.2	548,017	4.3	98.1	1.0
7月末	32,368	1.9	534,743	1.8	98.1	0.8
8月末	33,251	4.7	550,428	4.8	98.3	0.6
9月末	32,760	3.1	542,874	3.3	97.5	1.3
10月末	32,721	3.0	541,404	3.0	97.8	0.9
11月末	33,866	6.6	563,373	7.2	98.0	0.8
12月末	33,905	6.8	559,659	6.5	98.2	0.7
2024年 1月末	34,506	8.6	573,726	9.2	97.5	1.2
2月末	34,953	10.1	580,855	10.6	98.2	0.7
3月末	35,389	11.4	587,851	11.9	98.5	0.5
4月末	36,058	13.5	597,531	13.7	97.7	1.0
(当期末) 2024年 5月29日	36,514	15.0	604,736	15.1	98.1	0.8

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

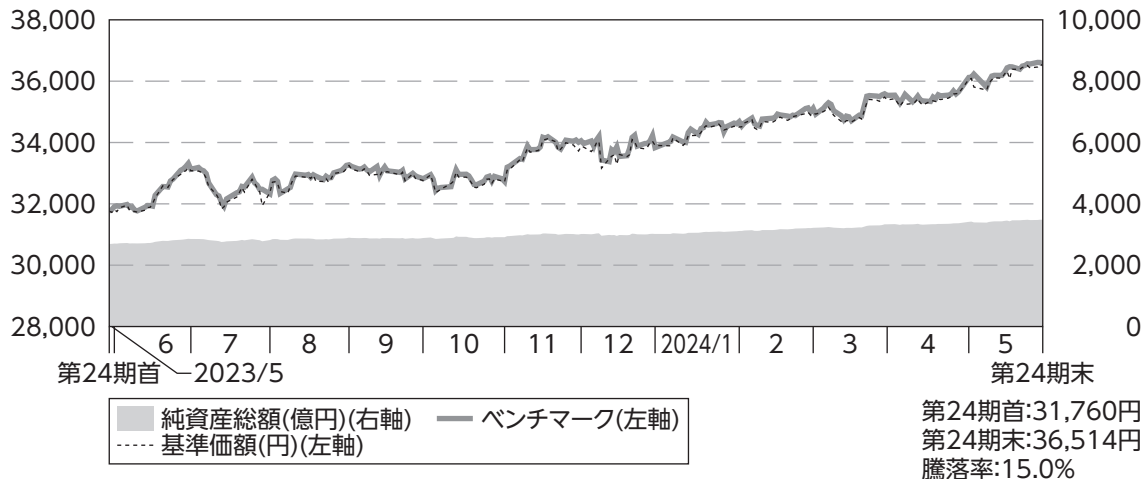
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

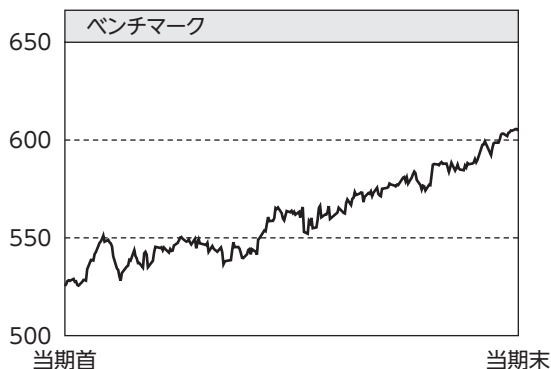


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月中旬にかけて、主要中央銀行の金融引き締め長期化観測などを背景に上昇（債券価格は下落）しました。12月下旬にかけて、主要国の長期金利は、主要先進国のインフレ鈍化を示す指標を受けて、主要中央銀行の利下げ観測が高まったことから低下（債券価格は上昇）しました。2024年1月以降は米国の堅調な経済指標などを背景に、FRB（米連邦準備理事会）による早期利下げ観測が後退し、期末にかけて主要国の長期金利は上昇しました。

外国為替市場では、日本と主要国の中央銀行の金融政策の違いを背景に、主要国通貨は対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

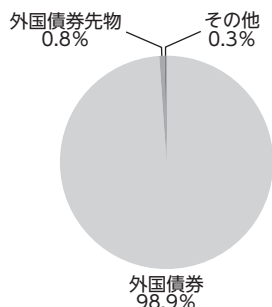
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.7%
2	T 4.375% 08/31/28	アメリカ	0.6%
3	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	0.6%
4	T 3.375% 05/15/33	アメリカ	0.6%
5	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	0.5%
6	T 3% 07/15/25	アメリカ	0.5%

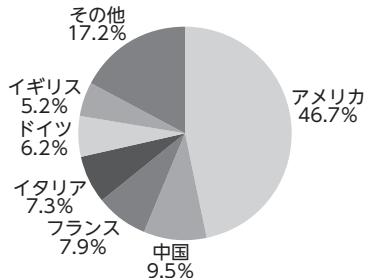
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.5%
8	T 3.5% 02/15/33	アメリカ	0.5%
9	T 1.125% 08/31/28	アメリカ	0.5%
10	T 1.625% 05/15/26	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		891	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

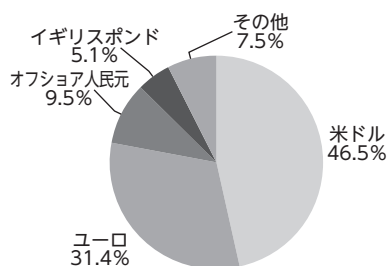
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

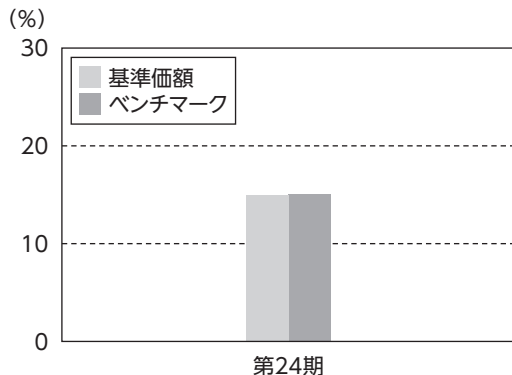


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主なマイナス要因は、カストディーコスト等です。

今後の運用方針

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、そ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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年5月30日~2024年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	11	0.031	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(11)	(0.031)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	11	0.032	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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(33,722円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 292,754	千米ドル 193,959
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 21,830	千カナダドル 13,302
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 85,309	千メキシコペソ 76,751
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 35,326	千ユーロ 26,304
	イ タ リ ア	国 債 証 券	30,709	23,662
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	36,630	25,432
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,661	2,726
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,100	16,336
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,986	3,805
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	4,478	3,278
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,231	748
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	1,052	1,637
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 25,632	千イギリスポンド 9,141
	国	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 4,049
ノ ル ウ ェ ー		国 債 証 券	千ノルウェークローネ 10,315	千ノルウェークローネ 6,250
デ ン マ ー ク		国 債 証 券	千デンマーククローネ 5,534	千デンマーククローネ 8,753
ポ ー ラ ン ド		国 債 証 券	千ポーランドズロチ 15,687	千ポーランドズロチ 9,443
オ ー ス ト ラ リ ア		国 債 証 券	千オーストラリアドル 5,840	千オーストラリアドル 6,809
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド		国 債 証 券	千ニュージーランドドル 2,920	千ニュージーランドドル 1,692
シ ン ガ ポ ー ル		国 債 証 券	千シンガポールドル 2,177	千シンガポールドル 1,160
マ レ ー シ ア		国 債 証 券	千マレーシアリンギット 8,378	千マレーシアリンギット 5,877
中 国 オ フ シ ョ ア		国 債 証 券	千オフショア人民元 998,443	千オフショア人民元 216,726
イ ス ラ エ ル		国 債 証 券	千イスラエルシェケル 10,351	千イスラエルシェケル 3,085

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 36,966	百万円 36,581	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 48,609	百万円 300	% 0.6	百万円 12,405	百万円 25	% 0.2
金 銭 信 託	49	49	100.0	49	49	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	635,410	54,942	8.6	635,095	54,871	8.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 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
ア メ リ カ	千米ドル 1,160,890	千米ドル 1,016,740	千円 160,034,924	% 46.0	% —	% 19.2	% 17.2	% 9.5
カ ナ ダ	千カナダドル 65,620	千カナダドル 60,226	6,941,656	2.0	—	1.1	0.4	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 349,130	千メキシコペソ 312,515	2,929,453	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 132,080	千ユーロ 122,691	20,954,455	6.0	—	3.3	1.8	0.8
イ タ リ ア	153,190	145,291	24,814,279	7.1	—	4.1	1.9	1.0
フ ラ ン ス	174,490	159,085	27,170,192	7.8	—	4.3	2.4	1.1
オ ラ ン ダ	32,800	29,764	5,083,513	1.5	—	0.9	0.4	0.1
ス ペ イ ン	104,360	97,245	16,608,555	4.8	—	2.7	1.4	0.7
ベ ル ギ ー	38,480	35,333	6,034,528	1.7	—	1.2	0.4	0.2
オ ー ス ト リ ア	26,040	23,202	3,962,832	1.1	—	0.7	0.4	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	12,100	10,440	1,783,078	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ア イ ル ラ ン ド	11,620	10,091	1,723,570	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 107,290	千イギリスポンド 87,875	17,643,544	5.1	—	3.5	1.2	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 46,670	千スウェーデンクローナ 44,960	668,118	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 40,570	千ノルウェークローネ 37,432	560,360	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 41,820	千デンマーククローネ 39,037	893,560	0.3	—	0.2	0.0	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 49,230	千ポーランドズロチ 45,369	1,822,191	0.5	—	0.2	0.3	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 47,940	千オーストラリアドル 42,856	4,479,809	1.3	—	0.9	0.3	0.1
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 9,860	千ニューージーランドドル 8,592	829,602	0.2	—	0.2	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 12,860	千シンガポールドル 12,108	1,412,615	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 49,630	千マレーシアリンギット 50,659	1,697,340	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 1,449,280	千オフショア人民元 1,501,067	32,513,721	9.3	—	4.3	3.2	1.9
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 30,790	千イスラエルシェケル 26,872	1,147,950	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	341,709,856	98.1	—	48.7	32.3	17.2

(注1) 邦貨換算金額は、当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比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

当		期				末
銘柄	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 (千円)		
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	640	536	91,622	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	350	334	57,092	2027/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	610	432	73,908	2047/4/15	
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	570	508	86,778	2032/9/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	470	431	73,771	2042/7/4	
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	400	379	64,841	2038/4/15	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	546	93,286	2028/7/4	
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	240	239	40,855	2029/4/15	
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	230	218	37,352	2055/4/15	
RFGB 3% 09/15/33	3.0	580	578	98,789	2033/9/15	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	640	644	110,050	2025/7/4	
(アイルランド)						
国債証券						
IRISH 0% 10/18/31	—	1,070	871	148,818	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	670	619	105,758	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	780	663	113,303	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	380	310	52,950	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	690	525	89,824	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	360	239	40,883	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	770	715	122,175	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,000	961	164,219	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	980	902	154,214	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	430	377	64,455	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	470	428	73,180	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	665	96,602	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	740	633	108,270	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	980	811	138,614	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	930	908	155,172	2030/5/15	
IRISH 2.6% 10/18/34	2.6	200	193	33,084	2034/10/18	
IRISH 3% 10/18/43	3.0	370	363	62,042	2043/10/18	
ユーロ計				108,135,005		
(イギリス)						
国債証券						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,260	1,172	235,492	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	1,510	1,300	261,202	2028/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,710	2,063	414,364	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	2,980	2,706	543,398	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,930	1,528	306,832	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	2,180	1,843	370,109	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	2,150	622	124,970	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,400	1,341	269,440	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,250	1,517	304,729	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	1,450	568	114,152	2050/10/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,530	743	149,326	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	3,400	2,538	509,633	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,410	1,191	239,167	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	3,700	2,936	589,526	2032/1/31	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	2,050	1,308	262,675	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	1,050	370	74,398	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,250	1,138	228,679	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	2,420	1,151	231,233	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,030	1,222	245,405	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,504	302,049	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,700	938	188,362	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	1,140	566	113,680	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,070	962	193,200	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,340	681	136,887	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,550	691	138,923	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,080	619	124,286	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,740	897	180,198	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,890	1,384	278,027	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,380	2,298	461,424	2025/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,420	876	176,019	2065/7/22	

当		期				末
銘柄	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 (千円)		
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,010	1,643	329,991	2044/1/22	
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	3,960	3,685	739,989	2033/1/31	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,820	1,534	308,077	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,470	1,172	235,491	2068/7/22	
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	2,350	2,306	463,137	2025/10/22	
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	1,930	1,787	358,868	2038/1/29	
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	650	636	127,875	2027/3/7	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,150	979	196,377	2052/7/22	
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	2,910	2,464	494,843	2053/10/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,250	1,108	222,631	2060/1/22	
UKT 4% 10/22/63	4.0	1,190	1,050	210,838	2063/10/22	
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	3,340	3,306	663,885	2027/1/29	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,890	1,868	375,190	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,320	1,330	267,079	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,270	1,228	246,575	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,800	1,797	360,950	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,450	1,392	279,610	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,770	1,659	333,119	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,610	1,499	301,019	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,700	1,574	316,102	2055/12/7	
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	430	405	81,474	2054/7/31	
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	2,690	2,707	543,689	2028/6/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,390	1,412	283,689	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,440	2,397	481,394	2042/12/7	
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	1,780	1,829	367,314	2034/1/31	
UKT 4.75% 10/22/43	4.75	1,030	1,039	208,623	2043/10/22	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,710	1,770	355,516	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,400	1,436	288,379	2038/12/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	2,010	2,159	433,644	2028/12/7	
小計				17,643,544		
(スウェーデン)						
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	4,470	3,838	57,039	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,780	6,344	94,284	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,440	5,915	87,901	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,580	7,274	108,103	2026/11/12	
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	4,360	4,139	61,513	2033/11/11	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	5,510	5,463	81,194	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,560	7,507	111,559	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	3,970	4,476	66,523	2039/3/30	
小計				668,118		
(ノルウェー)						
国債証券						
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	4,780	4,045	60,554	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	5,200	4,544	68,034	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,520	4,341	64,991	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,630	4,391	65,734	2027/2/17	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	4,100	3,728	55,823	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,650	4,367	65,385	2028/4/26	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,730	3,329	49,837	2032/5/18	
NGB 3% 08/15/33	3.0	4,630	4,383	65,618	2033/8/15	
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	1,860	1,843	27,591	2042/10/6	
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	2,470	2,457	36,789	2034/4/13	
小計				560,360		
(デンマーク)						
国債証券						
DGB 0% 11/15/31	—	6,540	5,449	124,734	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	5,570	2,903	66,472	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	4,430	4,118	94,269	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	5,570	5,003	114,525	2029/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	6,560	6,439	147,397	2025/11/15	

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
CGB 2.22% 09/25/25	2.22	27,270	27,439	594,340	2025/9/25
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	30,220	30,445	659,464	2025/11/25
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	47,100	47,501	1,028,897	2026/5/15
CGB 2.33% 12/15/25	2.33	35,250	35,551	770,050	2025/12/15
CGB 2.37% 01/15/29	2.37	19,460	19,695	426,614	2029/1/15
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	43,880	44,350	960,646	2027/1/20
CGB 2.39% 11/15/26	2.39	42,750	43,212	936,000	2026/11/15
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	42,610	43,079	933,119	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	17,700	17,919	388,152	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	29,300	29,607	641,318	2026/2/15
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	20,000	20,295	439,616	2027/4/15
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	26,500	26,897	582,602	2028/9/25
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	26,760	27,144	587,954	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	58,370	59,265	1,283,722	2033/8/25
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	30,500	31,034	672,224	2030/12/25
CGB 2.55% 10/15/28	2.55	27,250	27,763	601,371	2028/10/15
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	32,050	32,693	708,155	2032/9/1
CGB 2.6% 09/15/30	2.6	30,500	31,122	674,134	2030/9/15
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	23,550	24,005	519,965	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	36,400	37,203	805,851	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,940	21,414	463,853	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	38,220	38,962	843,946	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	34,280	35,225	762,999	2033/5/25
CGB 2.67% 11/25/33	2.67	13,600	13,991	303,056	2033/11/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	33,530	34,376	744,609	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	32,900	33,463	724,834	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	19,420	19,940	431,927	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	14,500	14,964	324,146	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	25,490	26,242	568,424	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	10,700	11,038	239,102	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	30,300	31,271	677,360	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	23,080	23,800	515,526	2029/3/24
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	42,000	43,344	938,864	2030/3/25
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	4,600	4,765	103,230	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	31,030	31,843	689,732	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	11,300	11,791	255,417	2033/2/25
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	24,210	25,230	546,503	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	29,200	30,219	654,576	2028/10/14
CGB 3% 10/15/53	3.0	9,330	10,173	220,358	2053/10/15
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	12,590	13,057	282,824	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	21,690	22,799	493,839	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	53,270	54,246	1,175,007	2025/10/22
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	18,800	19,222	416,368	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,970	9,871	213,820	2052/10/25
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	18,160	20,430	442,536	2053/4/15
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,318	158,522	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	14,110	14,776	320,064	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	13,750	15,664	339,294	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	20,930	23,942	518,600	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	8,350	9,840	213,145	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	13,540	16,414	355,536	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	19,620	24,060	521,164	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	17,280	21,238	460,035	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	15,720	19,919	431,468	2048/10/22
小 計				32,513,721	
(イスラエル) 国債証券		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	1,510	1,412	60,347	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,340	99,987	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	3,530	2,869	122,585	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	2,510	1,933	82,605	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,630	1,733	74,041	2037/5/31

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	3,450	3,342	142,780	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	2,030	1,896	81,004	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,700	2,452	104,764	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	1,420	882	37,712	2052/11/29
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	2,040	1,960	83,763	2029/2/28
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,570	2,027	86,608	2047/3/31
ILGOV 4% 03/30/35	4.0	760	697	29,796	2035/3/30
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,880	1,929	82,407	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,340	1,393	59,544	2026/10/30
小 計				1,147,950	
合 計				341,709,856	

(注)邦貨換算金額は、当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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 EURO-SCHATZ	233	—
US 5YR NOTE	581	—
EURO-BOBL FU	357	—
EURO-BUND	732	—
国 US 10YR NOTE	393	—
US LONG BOND	437	—

(注)外貨建資産は、当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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 341,709,856	% 98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,549,470	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	348,259,326	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(345,942,267千円)の投資信託財産総額(348,259,326千円)に対する比率は99.3%です。

(注2) 外貨建資産は、当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。

1米ドル=157.40円	1カナダドル=115.26円	1メキシコペソ=9.3738円
1ユーロ=170.79円	1イギリスポンド=200.78円	1スウェーデンクローナ=14.86円
1ノルウェークローネ=14.97円	1デンマーククローネ=22.89円	1ポーランドズロチ=40.1636円
1オーストラリアドル=104.53円	1ニュージーランドドル=96.55円	1シンガポールドル=116.66円
1マレーシアリンギット=33.5047円	1オフショア人民元=21.6604円	1イスラエルシケル=42.718円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2024年5月29日現在
(A)資 産	351,498,601,487円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,660,217,418
公 社 債(評価額)	341,709,856,193
未 収 入 金	3,263,204,057
未 収 利 息	2,424,799,648
前 払 費 用	230,496,609
差 入 委 託 証 拠 金	210,027,562
(B)負 債	3,321,508,325
未 払 金	3,248,793,989
未 払 解 約 金	72,714,336
(C)純 資 産 総 額(A-B)	348,177,093,162
元 本	95,353,277,023
次 期 繰 越 損 益 金	252,823,816,139
(D)受 益 権 総 口 数	95,353,277,023口
1万口当たり基準価額(C/D)	36,514円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配 当 等 収 益	7,947,505,082円
受 取 利 息	7,940,856,817
そ の 他 収 益 金	7,417,313
支 払 利 息	△769,048
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	35,138,557,401
売 買 益	40,604,453,431
売 買 損	△5,465,896,030
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△61,588,552
取 引 益	154,376,069
取 引 損	△215,964,621
(D)そ の 他 費 用	△99,911,907
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	42,924,562,024
(F)前 期 繰 越 損 益 金	184,374,116,405
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	40,923,721,636
(H)解 約 差 損 益 金	△15,398,583,926
(I) 計 (E+F+G+H)	252,823,816,139
次 期 繰 越 損 益 金(I)	252,823,816,139

(注1) (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) (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し引いた差額分をいいます。

(注3) (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し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は84,730,057,526円、期中追加設定元本額は17,092,076,647円、期中一部解約元本額は6,468,857,150円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

世界経済インデックスファンド	22,541,012,138円
DC世界経済インデックスファンド	14,536,796,234円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	13,022,433,668円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,753,793,834円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,496,265,072円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,365,641,307円
DC外国債券インデックス・オープン	2,223,840,466円
DCマイセレクション25	1,862,937,665円
DCマイセレクション50	1,810,010,441円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,500,288,290円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	1,483,293,615円
DCマイセレクション75	1,453,138,215円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,230,031,587円
グローバル経済コア	1,141,655,780円
DCマイセレクションS25	1,127,386,111円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,091,440,911円
DCマイセレクションS50	999,896,473円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	953,359,726円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	781,681,031円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	780,431,853円
外国債券ファンド・シリーズ1	763,941,046円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	758,264,536円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	713,734,962円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	631,478,687円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	629,965,197円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	617,206,666円
DCマイセレクションS75	582,796,607円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	489,015,401円
SMT 世界経済インデックス・オープン	428,498,249円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	356,741,086円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	330,367,435円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	309,732,561円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	269,315,338円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,720,149円
SMT インデックスバランス・オープン	178,327,693円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	163,828,094円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	142,122,851円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	128,647,735円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	125,953,518円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,346,180円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,173,528円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	90,970,944円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	65,742,230円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	61,897,125円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,337,815円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,436,368円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	50,767,118円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	50,453,080円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	46,572,182円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	45,240,512円

10資産分散投資ファンド	35,744,317円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	26,173,354円
グローバル10資産バランスファンド	25,281,452円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	23,039,454円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	22,855,843円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	13,644,183円
DCターゲット・イヤーフンド2025	11,211,126円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,302,961円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,394,096円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,888,696円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,041,844円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	997,055円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2040	22,496円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2055	22,344円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2035	22,342円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2045	22,232円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2050	22,232円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2060	21,744円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2065	21,683円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	16,457円

お知らせ

該当事項はありません。