

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	信託期間は2013年12月27日から無期限です。	
運用方針	主として、「外国債券インデックス マザーファンド」の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、円ヘッジ円ベース)と概ね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	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)	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	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)	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	年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。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(評価益を含みます。)等の全額とします。	

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)

運用報告書(全体版)

第19期(決算日 2023年4月20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期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物率比	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第15期(2021年 4月20日)	11,514	0	△3.9	414.682	△3.6	96.0	1.8	3,549
第16期(2021年10月20日)	11,465	0	△0.4	414.172	△0.1	101.8	0.7	4,036
第17期(2022年 4月20日)	10,488	0	△8.5	379.607	△8.3	102.5	1.4	4,069
第18期(2022年10月20日)	9,493	0	△9.5	344.476	△9.3	101.1	1.2	3,985
第19期(2023年 4月20日)	9,558	0	0.7	348.288	1.1	100.6	0.4	4,168

(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		債券組入比率	債券先物率比
		騰落率		騰落率		
(当期首) 2022年10月20日	円 9,493	% —		% —	% 101.1	% 1.2
10月末	9,630	1.4	349.594	1.5	100.0	1.8
11月末	9,762	2.8	354.668	3.0	93.2	1.2
12月末	9,570	0.8	347.736	0.9	95.0	1.6
2023年 1月末	9,711	2.3	353.362	2.6	98.3	1.5
2月末	9,475	△0.2	344.925	0.1	101.3	1.4
3月末	9,637	1.5	350.963	1.9	97.6	0.7
(当期末) 2023年 4月20日	9,558	0.7	348.288	1.1	100.6	0.4

(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。

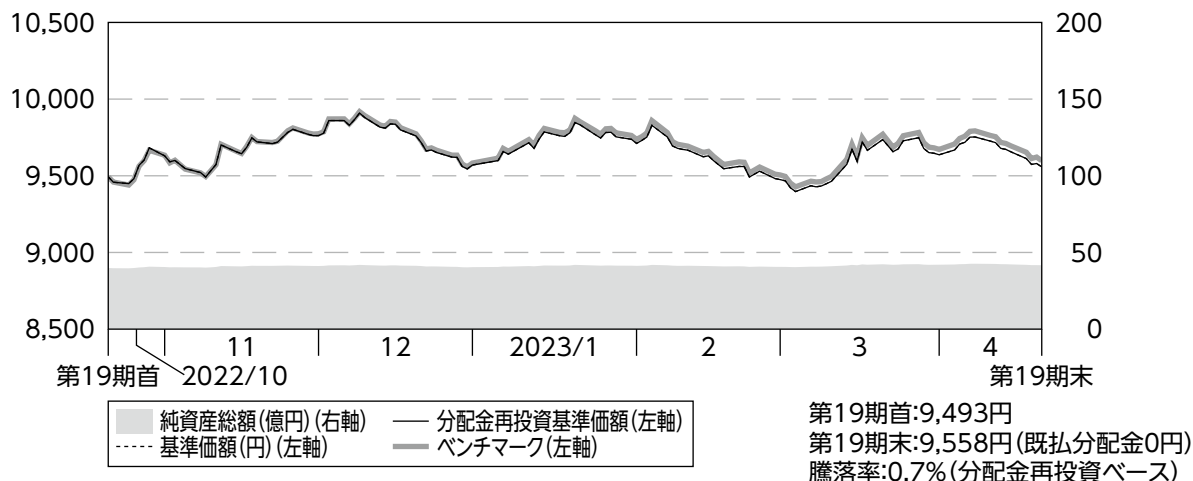
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ円ベース)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。「円ヘッジ円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

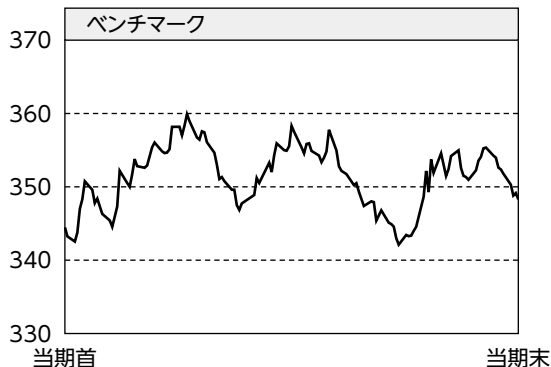


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年10月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。2023年2月下旬にかけて、主要国の中央銀行による利上げ長期化観測がある一方、世界的な景気減速も懸念され、主要国の長期金利はレンジ内で上下動したため、基準価額は一進一退の展開が続きました。その後は、米地銀の破綻によって金融システムへの不安が高まり、早期の利上げ停止や利下げ転換への思惑などから長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しましたが、期末にかけては過度なリスク回避姿勢が後退したことから長期金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、主要中央銀行の利上げ長期化観測がある一方、利上げ継続による景気後退も懸念され、2023年2月下旬にかけて一進一退の展開となりました。その後は、米地銀の破綻によって金融システムへの不安が高まり、主要中央銀行の早期の利上げ停止や利下げ転換への思惑などから主要国の長期金利は低下しましたが、期末にかけては過度なリスク回避姿勢が後退したことから上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

「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、実質組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行うことで、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ円ベース)に連動することを目指しました。

【「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。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため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。

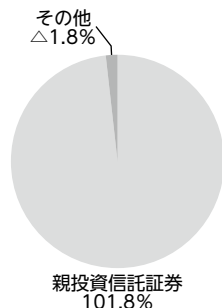
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

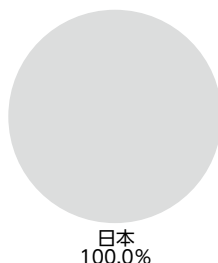
	当期末
	2023年4月20日
外国債券インデックス マザーファンド	101.8%
その他	△1.8%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

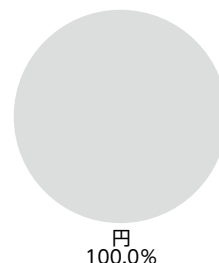
○資産別配分



○国別配分



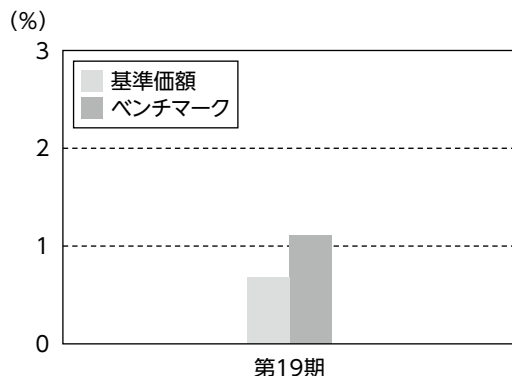
○通貨別配分



(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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)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要因は、信託報酬等です。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送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19期	
	2022年10月21日~2023年4月20日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,376

(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

「外国債券インデックス マザーファンド」の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、円ヘッジ円ベース)をベンチマークとし、その動きと概ね連動する投資成果を目標として運用を行います。

実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行います。資産規模によっては全ての通貨に対してヘッジができない場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年10月21日~2023年4月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	26円	0.274%	(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9,630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)	(10)	(0.104)	
(販売会社)	(14)	(0.148)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(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	0.019	(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)	(2)	(0.017)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	28	0.293	

(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。

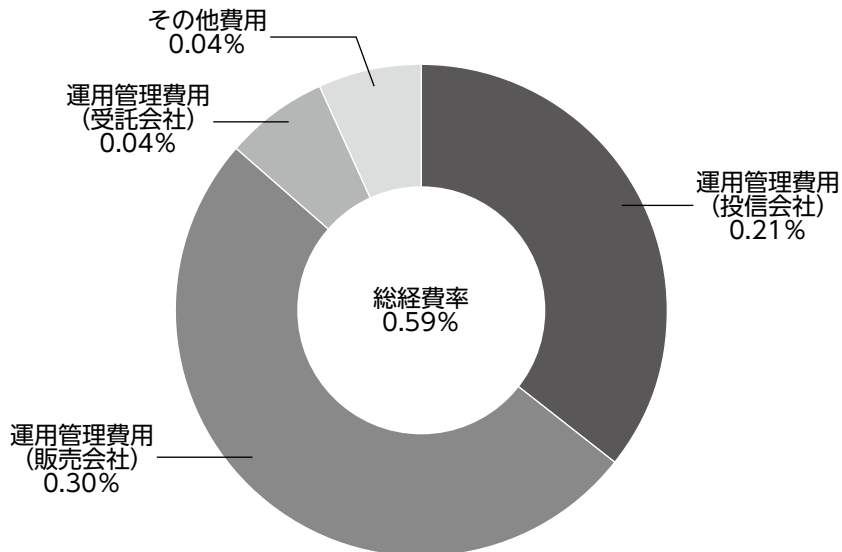
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.59%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 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 221,231	千円 679,025	千口 145,540	千円 450,315

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	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 24,489	百万円 88	% 0.4	百万円 24,765	百万円 87	% 0.4
金 銭 信 託	0.001506	0.001506	100.0	0.001506	0.001506	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,017	301	10.0	3,015	300	10.0

(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 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 直 物 取 引	百万円 20,558	百万円 41	% 0.2	百万円 29,517	百万円 121	% 0.4
金 銭 信 託	0.427490	0.427490	100.0	0.427490	0.427490	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	408,046	34,476	8.4	411,055	34,825	8.5

<平均保有割合 1.4%>

(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>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	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 1,294,131	千口 1,369,822	千円 4,244,944

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、90,993,437千口です。

* 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 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	4,244,944	99.2
コール・ローン等、その他	35,291	0.8
投資信託財産総額	4,280,235	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、当期末における外貨建純資産(281,945,646千円)の投資信託財産総額(282,397,866千円)に対する比率は99.8%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=134.92円	1カナダドル=100.21円	1メキシコペソ=7.4736円
1ユーロ=147.82円	1イギリスポンド=167.69円	1スウェーデンクローナ=13.02円
1ノルウェークローネ=12.74円	1デンマーククローネ=19.83円	1ポーランドズロチ=31.9891円
1オーストラリアドル=90.50円	1ニュージーランドドル=83.16円	1シンガポールドル=101.10円
1マレーシアリンギット=30.4333円	1オフショア人民元=19.5685円	1イスラエルシェケル=37.0024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 2023年4月20日現在
(A)資 産	8,497,542,910円
コール・ローン等	32,143,950
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,244,944,352
未 収 入 金	4,220,454,608
(B)負 債	4,329,275,589
未 払 金	4,304,462,132
未 払 解 約 金	13,388,209
未 払 信 託 報 酬	11,312,175
未 払 利 息	10
そ の 他 未 払 費 用	113,063
(C)純 資 産 総 額(A-B)	4,168,267,321
元 本	4,361,099,925
次 期 繰 越 損 益 金	△192,832,604
(D)受 益 権 総 口 数	4,361,099,925口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,558円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年10月21日 至 2023年 4月20日
(A)配 当 等 収 益	△4,486円
受 取 利 息	55
支 払 利 息	△4,541
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	30,056,890
売 買 益	553,720,025
売 買 損	△523,663,135
(C)信 託 報 酬 等	△11,425,238
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	18,627,166
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△635,824,305
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	424,364,535
(配 当 等 相 当 額)	(806,456,522)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△382,091,987)
(G) 計 (D+E+F)	△192,832,604
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△192,832,604
追 加 信 託 差 損 益 金	424,364,535
(配 当 等 相 当 額)	(806,689,974)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△382,325,439)
分 配 準 備 積 立 金	229,888,130
繰 越 損 益 金	△847,085,269

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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>

※当ファンドの期首元本額は4,198,398,987円、期中追加設定元本額は649,970,599円、期中一部解約元本額は487,269,661円です。

※分配金の計算過程

項	目	当	期
(A)	配当等収益額(費用控除後)		31,524,980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
(C)	収益調整金額		806,689,974円
(D)	分配準備積立金額		198,363,150円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		1,036,578,104円
(F)	期末残存口数		4,361,099,925口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		2,376円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

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22期（決算日 2022年5月30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
	期騰落率	中率	期騰落率	中率			
第18期(2018年5月29日)	円 26,619	% △0.1	441.246	% 0.2	% 98.0	% 0.8	百万円 243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	2.1	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

(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	中率	騰落率	中率		
(当期首) 2021年 5月31日	円 30,717	% －	510.445	% －	% 98.1	% 1.1
6月末	30,662	△0.2	508.662	△0.3	96.8	2.3
7月末	30,869	0.5	513.081	0.5	98.8	0.5
8月末	30,875	0.5	512.289	0.4	97.2	1.9
9月末	30,660	△0.2	508.953	△0.3	97.7	1.6
10月末	31,292	1.9	518.317	1.5	98.3	1.0
11月末	30,970	0.8	512.768	0.5	96.9	2.3
12月末	31,153	1.4	516.730	1.2	97.5	2.1
2022年 1月末	30,627	△0.3	507.460	△0.6	97.1	2.0
2月末	30,088	△2.0	500.360	△2.0	97.7	1.4
3月末	31,088	1.2	514.015	0.7	97.5	1.6
4月末	31,147	1.4	514.167	0.7	97.9	0.8
(当期末) 2022年 5月30日	30,737	0.1	509.621	△0.2	97.2	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

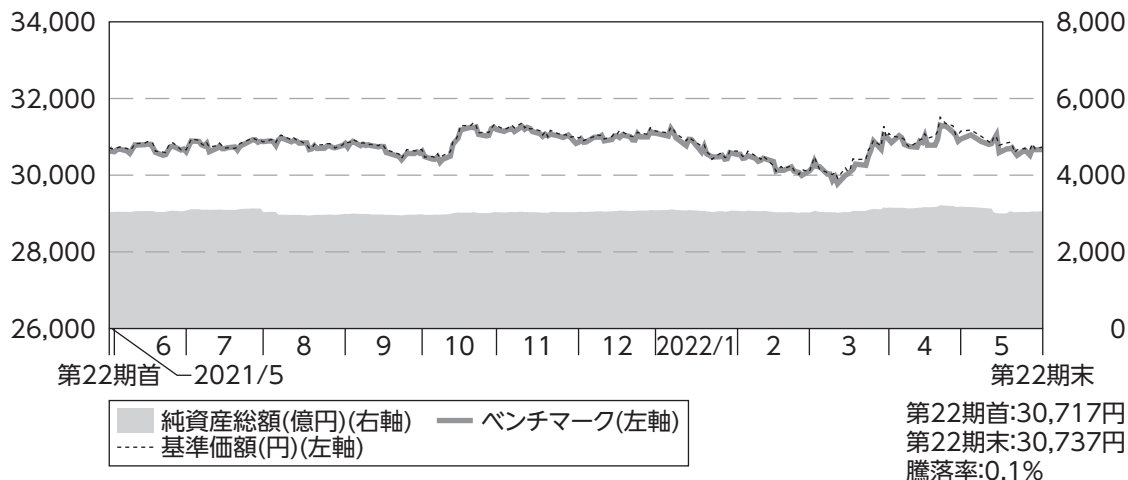
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

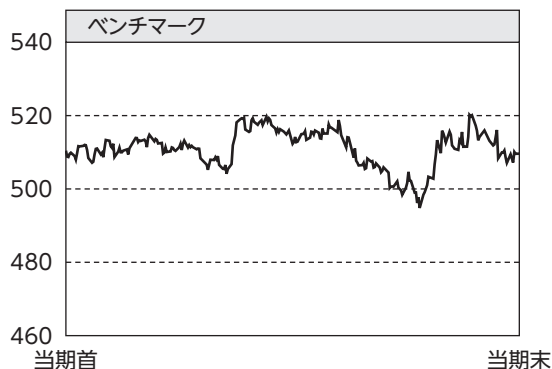


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2021年8月上旬にかけて、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬から10月上旬にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)で量的金融緩和の縮小開始が示唆されたことなどから主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬には、日本の貿易収支悪化懸念から円安の動きが加速し、基準価額は上昇しました。10月下旬から12月上旬は、主要国の長期金利が低下したものの円高となり、12月中旬から2022年1月上旬は、主要国の長期金利が上昇したものの円安となったことから、基準価額はレンジ内推移となりました。1月中旬から3月中旬にかけては米国で大幅利上げへの警戒感が高まったことから主要国の長期金利が上昇して基準価額は下落しましたが、3月下旬には日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから円売りが加速し、上昇しました。4月から5月上旬にかけて基準価額はレンジ内推移となり、以降は長期金利上昇と円安が一服したことから、緩やかに下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2021年12月上旬まで上下動しながらレンジ内での動きが続いていましたが、12月中旬以降は、米国で金融引き締めペースの加速見通しが強まったことや世界的にインフレ加速に対する警戒が続いたことから、概ね上昇推移となりました。

外国為替市場では、2022年3月上旬までは、円は主要通貨に対して円安傾向ながらレンジ内での展開が続いていましたが、3月中旬以降は、他の主要国の長期金利が大幅に上昇する中で日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことや資源価格高騰による日本の貿易収支悪化懸念から、主要通貨に対する円安が大幅に加速しました。

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。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため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

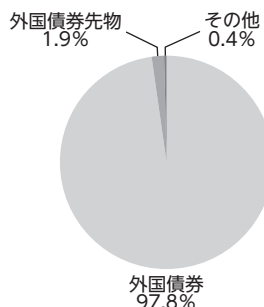
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.7%
2	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.6%
3	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 1.25% 09/30/28	アメリカ	0.5%
5	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
6	EURO-BUND 2206	ドイツ	0.5%

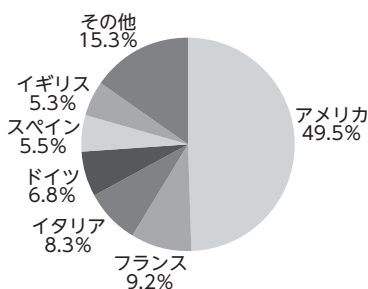
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/51	アメリカ	0.5%
9	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
10	T 0.25% 09/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		826	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

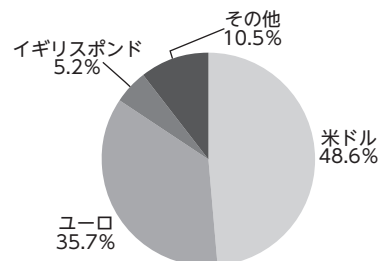
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

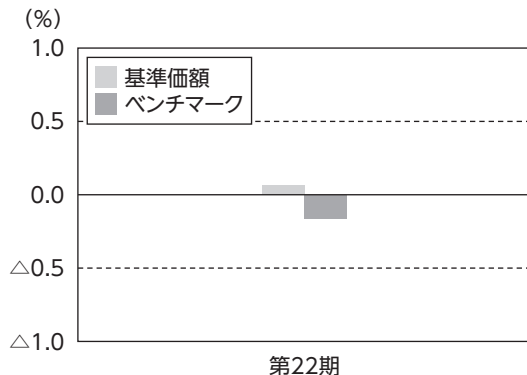


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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1.9%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要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

※当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

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
	(2021年6月1日~2022年5月30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	7	0.024	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(7)	(0.023)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	7	0.025	

(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(30,845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 401,216	千米ドル 335,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 25,360	千カナダドル 26,202
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 60,029	千メキシコペソ 100,386
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 38,129	千ユーロ 42,369
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,105	39,020
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	33,494	38,246
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	8,355	8,221
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,711	24,064
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,598	7,602
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,311	7,046
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,437	2,880
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,390	3,773
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 13,005	千イギリスポンド 27,780
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,776	千スウェーデンクローナ 21,158
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 9,121	千ノルウェークローネ 6,550
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,764	千デンマーククローネ 20,425
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 10,602	千ポーランドズロチ 20,693
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 4,003	千オーストラリアドル 23,876
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,224	千シンガポールドル 4,350
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,698	千マレーシアリンギット 11,065
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 268,308	千オフショア人民元 -	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 16,105	千イスラエルシェケル 21,192	

(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 63,854	百万円 61,561	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 35,250	百万円 131	% 0.4	百万円 35,483	百万円 351	% 1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,117,914	30,860	2.8	1,116,764	30,326	2.7

(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 1,234,970	千米ドル 1,161,808	千円 147,572,910	% 48.2	% —	% 21.4	% 17.1	% 9.7
カ ナ ダ	千カナダドル 64,950	千カナダドル 61,671	6,159,165	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 369,820	千メキシコペソ 355,118	2,306,634	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 142,510	千ユーロ 149,133	20,325,345	6.6	—	3.9	1.6	1.1
イ タ リ ア	180,290	181,990	24,803,426	8.1	—	4.7	2.2	1.2
フ ラ ン ス	195,640	201,735	27,494,486	9.0	—	5.4	2.5	1.1
オ ラ ン ダ	37,260	38,688	5,272,830	1.7	—	1.1	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,860	119,841	16,333,215	5.3	—	3.2	1.5	0.6
ベ ル ギ ー	43,490	45,243	6,166,301	2.0	—	1.5	0.5	0.1
オーストリア	28,260	28,531	3,888,520	1.3	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	12,390	11,847	1,614,662	0.5	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	15,570	15,302	2,085,579	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 93,140	千イギリスポンド 98,476	15,794,705	5.2	—	4.0	0.7	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 62,360	千スウェーデンクローナ 62,898	813,906	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 58,140	千ノルウェークローネ 56,123	752,049	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 62,040	千デンマーククローネ 65,222	1,194,873	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 51,380	千ポーランドズロチ 42,924	1,281,487	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 54,440	千オーストラリアドル 50,793	4,623,245	1.5	—	1.0	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 14,290	千シンガポールドル 14,083	1,307,226	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 50,920	千マレーシアリンギット 50,710	1,471,893	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中国オフショア	千オフショア人民元 266,140	千オフショア人民元 270,299	5,112,008	1.7	—	0.7	0.6	0.3
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,160	千イスラエルシェケル 31,896	1,209,741	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	297,584,217	97.2	—	51.4	29.9	15.9

(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。

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		償還年月日	
		末			
		額面金額	評価額		
千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
		(アメリカ)			
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,651	1,225,966	2024/1/15
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,536	576,203	2024/2/15
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,366	935,755	2023/5/15
T 0.125% 05/31/23	0.125	6,800	6,670	847,254	2023/5/31
T 0.125% 07/31/23	0.125	5,000	4,885	620,611	2023/7/31
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	7,851	997,286	2023/9/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,774	987,501	2023/10/15
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,144	399,406	2023/12/15
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	12,517	1,589,982	2024/3/15
T 0.25% 05/15/24	0.25	10,000	9,583	1,217,233	2024/5/15
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	7,850	997,146	2023/6/15
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,603	1,092,808	2024/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	928	117,969	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,818	612,024	2025/7/31
T 0.25% 09/30/23	0.25	12,000	11,697	1,485,836	2023/9/30
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	6,919	878,894	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,314	421,065	2025/10/31
T 0.25% 11/15/23	0.25	11,000	10,687	1,357,541	2023/11/15
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,349	933,557	2026/1/31
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	6,736	855,693	2024/4/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,491	951,578	2025/4/30
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,618	1,094,693	2024/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,878	619,607	2027/7/31
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,771	606,073	2024/8/15
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,283	798,085	2024/9/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,059	896,721	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,767	351,557	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,683	467,830	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	10,593	1,345,640	2026/2/28
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,800	863,743	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,639	335,278	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,135	398,254	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	3,100	2,771	352,001	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,148	526,987	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,646	844,286	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	4,500	4,072	517,288	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	11,988	1,522,754	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,338	932,168	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	10,105	1,283,564	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,227	282,991	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	8,891	1,129,386	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,599	965,292	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,214	1,297,395	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,000	2,781	353,343	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,700	470,093	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	11,830	10,891	1,383,432	2026/8/31
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,388	1,319,517	2024/11/15
T 0.75% 12/31/23	0.75	3,370	3,288	417,732	2023/12/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,429	943,639	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,545	704,425	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,600	1,219,433	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,293	799,427	2028/7/31
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,689	976,664	2024/12/15
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,546	831,480	2025/1/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	13,192	1,675,681	2031/2/15

銘柄	利率 (%)	期		償還年月日	
		末			
		額面金額	評価額		
千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
		(アメリカ)			
T 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	8,165	1,037,157	2025/2/28
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,302	927,563	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,236	157,099	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	7,300	5,245	666,313	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	10,210	9,242	1,173,924	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	4,726	600,338	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,333	931,532	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	8,650	5,721	726,702	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	8,000	7,326	930,619	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,500	8,685	1,103,272	2028/6/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,504	572,218	2023/7/31
T 1.25% 08/15/31	1.25	16,120	14,179	1,801,055	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	14,500	13,212	1,678,259	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,563	833,638	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,675	847,881	2026/12/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,872	491,884	2025/1/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,962	630,324	2023/6/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	6,767	859,617	2050/8/15
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,475	314,442	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	3,957	502,691	2023/9/30
T 1.375% 11/15/31	1.375	18,030	15,983	2,030,200	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	4,496	571,113	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,491	570,563	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,676	720,977	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,922	752,221	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	7,131	905,836	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,299	1,054,238	2024/9/30
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,928	880,010	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,787	989,194	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,177	276,587	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	11,150	10,170	1,291,906	2031/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	995	126,481	2023/5/31
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,263	795,626	2029/8/15
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,479	314,883	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,671	339,276	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	5,042	640,484	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	578,979	2026/11/30
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,680	467,504	2023/5/15
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,364	300,394	2024/6/30
T 1.75% 08/15/41	1.75	14,500	11,494	1,460,050	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,805	356,291	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	6,453	819,699	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	5,138	652,654	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,849	488,927	2027/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,019	637,576	2026/7/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,913	751,194	2024/8/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	9,300	7,243	920,111	2051/11/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,324	1,057,420	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,021	510,858	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,179	784,982	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,281	416,765	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,446	691,842	2024/6/30
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	6,747	857,014	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	15,150	12,151	1,543,541	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	9,897	1,257,171	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	5,700	4,717	599,234	2041/11/15
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,078	645,031	2024/2/29

外国債券インデックス マザーファンド ー第22期ー

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,363	935,321	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,364	300,370	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,519	447,108	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,763	605,004	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,952	629,071	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,674	339,715	2023/11/30
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	3,993	507,216	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,753	1,111,916	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,300	1,965	249,670	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,375	936,834	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	6,976	886,153	2024/4/30
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	5,598	711,121	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,338	1,059,125	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,510	445,895	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	4,687	595,401	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,252	794,255	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,067	1,278,828	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,335	550,744	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,451	946,499	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,496	571,121	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,352	679,933	2024/12/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	5,761	731,778	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,568	326,291	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,690	2,643	335,757	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,812	992,312	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	5,050	4,429	562,672	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,984	633,115	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	6,100	5,345	678,998	2049/11/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,477	441,766	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,984	633,164	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,710	1,506	191,360	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	3,524	447,705	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,909	1,004,692	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	4,447	564,927	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,570	580,514	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,677	594,118	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	13,340	13,213	1,678,428	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,251	921,038	2025/3/31
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	4,928	626,032	2023/6/30
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,518	446,905	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,807	737,610	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,019	383,493	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,544	831,298	2028/2/15
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	3,906	496,206	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,516	700,683	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,007	127,977	2023/7/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,211	153,876	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,754	476,893	2047/8/15
T 2.75% 08/31/23	2.75	1,500	1,511	191,947	2023/8/31
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,915	878,457	2025/8/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	2,320	2,336	296,838	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	3,920	3,646	463,141	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,834	359,989	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,025	511,295	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	7,297	926,920	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	3,934	499,746	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	5,388	684,452	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,845	488,438	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,496	698,107	2025/7/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,938	500,213	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	2,167	275,370	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,792	608,801	2023/9/30
T 2.875% 10/31/23	2.875	7,900	7,972	1,012,630	2023/10/31
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,363	300,233	2046/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,056	515,277	2023/11/30
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	7,544	958,306	2025/11/30
T 3% 02/15/47	3.0	800	774	98,376	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,346	552,035	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	5,000	4,942	627,855	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,576	200,226	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	2,500	2,406	305,666	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	3,108	394,865	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	5,346	679,116	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,243	538,985	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,050	641,475	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,694	342,263	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,043	1,043	132,495	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,974	250,824	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,948	755,641	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,071	517,153	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,564	1,087,890	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	1,741	221,190	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,083	391,649	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	5,587	709,758	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	826	104,949	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,555	324,544	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,130	270,631	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,172	275,990	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,256	413,688	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,611	204,683	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,055	134,118	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	2,731	346,979	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,191	151,391	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,254	286,306	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,298	291,905	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,960	3,516	446,622	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,312	166,715	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	664	84,378	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,053	260,807	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,689	214,576	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	928	117,949	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,390	176,271	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,489	189,230	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,345	297,923	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,897	240,977	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,694	215,259	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,313	166,828	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,732	220,021	2023/8/15
小 計				147,572,910	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,090	208,797	2026/3/1
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	2,400	2,303	230,069	2024/4/1
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,549	254,663	2023/5/1
CAN 0.25% 08/01/23	0.25	1,360	1,326	132,435	2023/8/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	2,480	2,320	231,717	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,590	2,145	214,263	2030/12/1
CAN 0.75% 02/01/24	0.75	1,300	1,262	126,121	2024/2/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		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)		
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	671	67,069	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	749	74,820	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,431	142,965	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,390	138,832	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	2,980	2,797	279,362	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,230	322,599	2030/6/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	490	480	47,982	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,060	105,892	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,304	130,316	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,565	356,125	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,172	117,143	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	4,170	3,724	371,926	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,830	1,431	142,965	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,263	126,165	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,290	1,199	119,834	2032/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	3,460	3,441	343,694	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,710	3,959	395,436	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,290	228,798	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,784	178,225	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,224	122,302	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,330	1,329	132,777	2024/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,650	1,626	162,468	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	760	743	74,253	2064/12/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,300	1,438	143,629	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,216	121,477	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	526	52,539	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,396	139,447	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	960	1,222	122,042	2033/6/1
小 計				6,159,165	
(メキシコ)					
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,578	62,216	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	31,259	203,043	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	3,700	3,345	21,731	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	12,500	10,952	71,137	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	47,710	43,077	279,804	2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	37,190	241,570	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	35,980	34,318	222,909	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,040	21,796	141,574	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	10,600	9,984	64,850	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	33,794	219,508	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	28,400	26,256	170,547	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	29,070	28,706	186,461	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	38,660	38,526	250,245	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,670	26,331	171,033	2038/11/18
小 計				2,306,634	
(ドイツ)					
国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 06/16/23	—	1,090	1,090	148,683	2023/6/16
BKO 0% 09/15/23	—	3,150	3,149	429,266	2023/9/15
BKO 0% 12/15/23	—	1,880	1,879	256,163	2023/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,470	2,319	316,192	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	3,120	2,891	394,094	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	2,790	2,542	346,559	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,260	1,954	266,411	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	3,380	2,880	392,523	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,248	579,018	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,306	450,612	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	4,190	3,911	533,085	2030/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		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)		
DBR 0% 08/15/30	—	670	626	85,386	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,450	3,172	432,368	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,420	3,142	428,307	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,260	868	118,378	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,960	2,851	388,612	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	2,500	2,383	324,806	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	3,825	521,362	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,080	2,977	405,849	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,553	347,986	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	3,089	421,053	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,998	408,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,680	3,636	495,603	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	1,940	1,922	262,046	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,029	276,606	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,640	3,704	504,613	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	3,631	494,871	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,065	417,794	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,345	319,728	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,695	231,015	2024/2/15
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	2,931	399,530	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,360	4,226	575,994	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,810	4,894	667,058	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,230	3,048	415,504	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,060	553,415	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,150	3,170	432,153	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,167	431,633	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,990	4,258	580,374	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,480	3,913	533,305	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,933	536,102	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,001	409,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,551	484,000	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,751	238,735	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,266	172,548	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	3,330	3,316	452,039	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	3,007	409,924	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,705	505,072	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	1,100	1,065	145,211	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,900	2,824	384,933	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	3,500	3,444	469,497	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,510	205,886	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,389	325,709	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	986	134,475	2024/1/15
BTPS 0% 01/30/24	—	940	927	126,384	2024/1/30
BTPS 0% 04/01/26	—	1,460	1,362	185,735	2026/4/1
BTPS 0% 04/15/24	—	3,000	2,944	401,338	2024/4/15
BTPS 0% 08/01/26	—	2,580	2,389	325,607	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,461	199,225	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	2,900	2,799	381,502	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,503	204,934	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	2,900	2,896	394,822	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	564	76,983	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,820	248,059	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,829	249,357	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	2,280	2,052	279,685	2028/7/15
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,114	151,838	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,599	354,231	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	670	671	91,483	2023/10/15

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)	
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,144	292,291	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,230	1,903	259,443	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	767	104,620	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,550	2,125	289,726	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,952	266,072	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,248	306,468	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,805	246,074	2031/12/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,898	258,799	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	1,773	241,708	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,700	1,400	190,940	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,296	312,937	2025/5/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,407	328,083	2024/11/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	913	124,460	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,412	328,751	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	2,812	383,301	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	2,713	369,837	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,337	318,565	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	1,190	162,262	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	1,012	137,978	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	2,260	1,816	247,545	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,450	2,489	339,326	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,723	371,224	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,246	306,111	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,116	288,415	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,741	373,572	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,236	441,104	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	524	71,506	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	920	713	97,258	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,303	314,003	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	1,672	227,938	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,522	343,851	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,810	1,532	208,806	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,910	2,984	406,721	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,035	413,703	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,037	413,988	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,210	2,023	275,803	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,130	984	134,236	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	3,190	3,289	448,325	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,012	274,222	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,483	474,823	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,407	191,790	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	1,967	268,213	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,820	1,885	256,989	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,195	299,171	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,246	578,745	2030/3/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,274	309,942	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,860	2,046	278,917	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	3,947	537,945	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	2,926	398,863	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,297	313,172	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,720	507,068	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	3,838	523,087	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	3,011	410,499	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,100	2,607	355,411	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,022	548,219	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	3,600	490,764	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,240	2,811	383,187	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,000	3,739	509,627	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,262	580,896	2029/11/1

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)	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,881	392,692	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,940	3,714	506,243	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,432	604,159	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,726	235,326	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	895	122,005	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/24	—	4,850	4,832	658,613	2024/2/25
FRTR 0% 02/25/25	—	2,050	2,016	274,790	2025/2/25
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,067	690,629	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	3,560	3,413	465,192	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/24	—	3,750	3,730	508,414	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	6,390	6,286	856,845	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/32	—	1,970	1,701	231,957	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	4,815	656,351	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,412	737,604	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	4,990	4,370	595,606	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,566	621,011	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,571	759,369	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,690	6,617	901,859	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,131	699,336	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	3,160	2,497	340,363	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	505	68,870	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,980	1,474	200,979	2044/6/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,290	6,194	844,233	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,350	2,387	325,235	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	2,060	1,438	196,047	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,738	782,068	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,671	636,676	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,330	5,335	727,231	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,090	3,919	534,147	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	5,130	4,819	656,812	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,770	6,880	937,769	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,590	3,202	436,497	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,470	745,536	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	1,614	220,066	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,320	3,314	451,277	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,289	584,633	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	3,571	486,706	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,253	579,648	2024/5/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	7,180	7,899	1,076,653	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,110	5,600	763,251	2027/10/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,400	4,221	575,340	2045/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,050	5,589	761,736	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,420	3,507	478,066	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,030	3,029	412,822	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	4,437	604,738	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,650	5,980	815,070	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,520	6,363	867,346	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,630	4,942	673,618	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	6,685	911,164	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	6,135	836,189	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,241	305,512	2025/10/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/24	—	2,230	2,224	303,109	2024/1/15
NETHER 0% 01/15/26	—	790	770	104,999	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,774	241,871	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/29	—	1,390	1,300	177,218	2029/1/15

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)		
NETHER 0% 01/15/38	—	960	759	103,546	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,490	970	132,283	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,500	1,374	187,376	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,820	1,643	224,026	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,287	311,794	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,570	1,488	202,810	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,040	877	119,628	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,302	313,783	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	700	650	88,655	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,560	1,554	211,919	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,683	229,482	2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,540	1,571	214,222	2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,059	280,685	2024/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,263	308,452	2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,330	2,963	403,870	2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,250	3,096	422,045	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	2,900	395,254	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,170	295,792	2028/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,230	304,047	2025/1/31	
SPGB 0% 01/31/26	—	2,720	2,613	356,154	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	1,560	1,469	200,210	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	1,930	1,782	242,975	2028/1/31	
SPGB 0% 04/30/23	—	1,630	1,629	222,134	2023/4/30	
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,086	284,420	2024/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	3,180	2,721	370,974	2031/4/30	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,271	309,541	2024/7/30	
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,599	490,607	2023/7/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,400	3,105	423,196	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,960	1,717	234,012	2031/10/31	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,950	2,743	373,891	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,939	264,304	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,374	323,635	2027/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,172	159,733	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	650	498	67,899	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,470	1,665	227,027	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,260	1,831	249,547	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	2,927	398,928	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,750	2,768	377,327	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	3,070	3,067	418,033	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,570	3,559	485,163	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,672	364,295	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,055	416,405	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	411	56,085	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,677	364,946	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,113	424,401	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	2,625	357,890	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	900	740	100,897	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	2,899	395,210	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,990	2,024	275,852	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	2,922	398,309	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,501	340,954	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	1,886	257,131	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,050	3,202	436,468	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,200	2,338	318,655	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,780	1,991	271,421	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,677	364,950	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,135	427,272	2037/1/31	

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)		
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	2,845	387,803	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,169	431,986	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,240	3,023	412,400	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,574	350,934	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,250	3,089	421,055	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,490	4,272	582,351	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,740	2,536	345,721	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,862	526,379	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,462	335,566	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,353	184,487	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	430	409	55,791	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,680	1,466	199,874	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,248	170,202	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,030	1,032	140,714	2023/10/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	480	426	58,155	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	1,240	940	128,203	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,621	220,984	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	342	46,726	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,680	2,694	367,273	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,682	229,337	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,260	1,245	169,796	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,560	1,535	209,208	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,301	313,277	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	2,770	2,680	365,374	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,465	199,771	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	610	502	68,507	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	755	102,910	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,240	1,114	151,856	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,300	1,176	160,368	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,048	142,941	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	780	767	104,661	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,180	1,208	164,661	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	784	106,922	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,239	305,170	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,180	160,866	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,566	213,503	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,331	181,434	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,870	2,509	342,065	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,305	177,978	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,290	3,149	429,296	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,507	478,014	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,450	1,311	178,783	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,640	1,453	198,110	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	914	124,622	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,120	1,120	152,760	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,440	1,430	194,985	2024/7/15	
RAGB 0% 10/20/40	—	670	477	65,042	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	486	66,246	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,693	230,836	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	1,071	146,024	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	440	266	36,307	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,210	1,193	162,608	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	592	80,727	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,076	282,958	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	330	167	22,880	2120/6/30	

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)	償還年月日	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	510	482	65,737	2032/2/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,070	1,090	148,558	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,030	972	132,483	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	216	29,530	2086/11/2	
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,020	139,049	2024/10/21	
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,361	185,616	2023/10/20	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	810	780	106,397	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,080	1,174	160,026	2034/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,044	142,336	2044/6/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	638	87,026	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,400	327,199	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,370	1,591	216,840	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,502	204,819	2027/7/15	
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB 0% 09/15/23	—	570	569	77,582	2023/9/15	
RFGB 0% 09/15/24	—	420	415	56,619	2024/9/15	
RFGB 0% 09/15/26	—	200	192	26,257	2026/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	800	717	97,809	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	330	265	36,172	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	285	38,851	2052/4/15	
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	540	480	65,442	2031/9/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	500	380	51,816	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	612	83,482	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	380	290	39,601	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	850	115,897	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	650	626	85,378	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	723	98,611	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	800	760	103,649	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	693	94,546	2025/9/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	560	529	72,134	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	455	62,015	2047/4/15	
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	752	102,588	2024/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	640	723	98,657	2042/7/4	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	606	82,648	2028/7/4	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	916	124,899	2025/7/4	
(アイルランド)						
国債証券						
IRISH 0% 10/18/31	—	850	741	101,012	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	899	122,598	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,090	991	135,187	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	416	56,710	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	610	516	70,411	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	500	392	53,537	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	690	684	93,284	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,640	1,658	225,992	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,196	163,018	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	651	88,836	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	810	811	110,627	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	708	96,504	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	815	111,099	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,150	1,158	157,891	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,319	179,838	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,024	139,621	2024/3/18	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,316	179,406	2025/3/13	
ユーロ計				107,984,367		
(イギリス)						
国債証券						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,520	1,446	232,005	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	3,300	3,227	517,637	2024/1/31	

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)	償還年月日	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,077	333,232	2028/1/31	
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,110	1,072	172,015	2025/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	3,270	2,821	452,574	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,910	1,811	290,494	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,157	345,999	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,020	940	150,856	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	782	125,467	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,659	266,102	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,810	2,319	372,094	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	880	594	95,393	2050/10/22	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,360	2,343	375,912	2023/7/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,170	881	141,444	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	510	452	72,628	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,601	256,897	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	400	366	58,847	2032/1/31	
UKT 1% 04/22/24	1.0	800	793	127,299	2024/4/22	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	500	424	68,100	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	520	381	61,202	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	935	150,052	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	830	663	106,431	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,373	380,645	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,599	256,534	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,370	2,044	327,887	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	420	358	57,481	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,620	1,621	260,081	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	1,633	261,968	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,480	1,313	210,615	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,183	189,749	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,210	2,003	322,159	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,630	2,478	397,600	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,809	290,170	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,524	404,952	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,510	1,710	274,281	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,736	278,580	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,180	2,556	410,003	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,290	2,799	448,953	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	2,770	444,331	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,155	345,782	2052/7/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,306	370,019	2060/1/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	2,051	329,096	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,544	408,190	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,620	2,097	336,401	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,559	250,103	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,750	2,288	367,079	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,920	2,651	425,243	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,143	343,724	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,910	2,871	460,485	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,860	2,348	376,707	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,210	3,037	487,197	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,804	289,353	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,238	359,052	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,300	2,515	403,517	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,584	254,059	2028/12/7	
小計				15,794,705		
(スウェーデン)						
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	6,470	5,738	74,256	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,800	7,481	96,809	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,560	7,168	92,763	2029/11/12	

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)		
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,440	8,283	107,188	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	12,561	162,539	2023/11/13	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	4,980	5,328	68,955	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,300	9,582	124,002	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,310	6,753	87,389	2039/3/30	
小計				813,906		
(ノルウェー)		千ノルウェー	千ノルウェー			
国債証券		クローネ	クローネ			
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,590	3,176	42,568	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	6,480	5,878	78,770	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,670	4,501	60,319	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,680	4,512	60,461	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,720	5,612	75,204	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	6,340	5,972	80,036	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,020	4,855	65,064	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	10,660	10,679	143,105	2023/5/24	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,220	3,070	41,150	2032/5/18	
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,760	7,863	105,368	2024/3/14	
小計				752,049		
(デンマーク)		千デンマーク	千デンマーク			
国債証券		クローネ	クローネ			
DGB 0% 11/15/24	—	2,550	2,514	46,062	2024/11/15	
DGB 0% 11/15/31	—	5,830	5,165	94,629	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	6,050	4,231	77,524	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	8,850	8,612	157,790	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,410	11,853	217,149	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,550	7,699	141,057	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,510	5,697	104,381	2025/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	13,290	19,447	356,278	2039/11/15	
小計				1,194,873		
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
国債証券						
POLGB 0% 07/25/24	—	2,160	1,885	56,302	2024/7/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,850	2,165	64,655	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,039	90,752	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,759	82,368	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	650	423	12,645	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,586	107,059	2024/10/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,550	3,309	98,809	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,860	5,830	174,057	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	3,088	92,207	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	5,750	4,663	139,231	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,220	4,815	143,768	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,910	4,449	132,840	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,410	2,334	69,697	2023/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	572	17,091	2029/4/25	
小計				1,281,487		
(オーストラリア)		千オーストラリア	千オーストラリア			
国債証券		ドル	ドル			
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	3,430	3,234	294,440	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,138	194,682	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,040	1,838	167,315	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,250	2,659	242,112	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,360	1,969	179,243	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,272	206,870	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	2,756	250,935	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,760	1,176	107,084	2051/6/21	

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)		
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,910	2,516	229,039	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,140	1,088	99,065	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,520	3,348	304,761	2030/5/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,388	126,365	2024/4/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,439	131,056	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,050	978	89,060	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,901	173,056	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,624	147,849	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,410	1,370	124,753	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,508	137,324	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,000	970	88,342	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,560	2,593	236,058	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,200	2,215	201,615	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,077	98,062	2039/6/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,672	152,268	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,890	1,982	180,422	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,310	2,565	233,478	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,504	227,979	2027/4/21	
小計				4,623,245		
(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券						
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	750	704	65,351	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	530	503	46,761	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	650	598	55,534	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	810	691	64,180	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	275	25,547	2051/10/1	
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	409	37,964	2024/2/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,080	1,068	99,135	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	890	839	77,942	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	730	730	67,828	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	408	37,926	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	530	533	49,496	2028/5/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	760	760	70,558	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	626	58,188	2042/4/1	
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	620	624	57,980	2023/7/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	662	61,514	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	1,200	1,224	113,641	2030/9/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,590	1,614	149,890	2024/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	886	82,296	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	920	85,487	2027/3/1	
小計				1,307,226		
(マレーシア)		千マレーシア	千マレーシア			
国債証券		リンギット	リンギット			
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,510	1,349	39,156	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	1,920	1,925	55,877	2024/6/14	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,490	43,267	2027/5/31	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,870	2,852	82,799	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,520	1,369	39,760	2040/5/22	
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	942	27,350	2023/8/17	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,180	1,119	32,496	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,670	1,601	46,485	2033/4/15	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,041	30,230	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,489	43,239	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,135	32,964	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,987	57,691	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,120	2,135	61,997	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	605	17,564	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	3,120	3,156	91,610	2025/9/15	

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)	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,780	1,806	52,428	2024/9/30
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	2,340	2,095	60,809	2050/6/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,280	1,300	37,741	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	3,000	3,014	87,493	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	2,030	1,984	57,609	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,500	2,565	74,470	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,860	2,945	85,484	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,770	1,824	52,967	2033/11/7
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,480	1,468	42,618	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,280	2,355	68,354	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	2,310	2,392	69,440	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,680	1,699	49,323	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,030	1,056	30,659	2043/9/30
小計				1,471,893	
(中国オフショア)		千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	29,520	29,240	553,007	2025/4/9
CGB 2.28% 03/17/24	2.28	9,700	9,720	183,830	2024/3/17
CGB 2.47% 09/02/24	2.47	18,980	19,083	360,906	2024/9/2
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	9,000	9,001	170,240	2027/4/15
CGB 2.56% 10/21/23	2.56	30,440	30,628	579,262	2023/10/21
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	22,480	22,308	421,898	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	17,240	17,391	328,905	2026/8/12
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	7,900	7,946	150,287	2029/3/24
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	11,650	11,793	223,043	2024/4/8
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	12,330	12,512	236,648	2027/6/4
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	5,510	5,562	105,208	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	10,280	10,419	197,053	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	7,230	7,378	139,539	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	6,850	6,971	131,841	2031/5/27
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	26,760	27,345	517,164	2026/3/11
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,120	134,656	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	5,410	5,614	106,182	2027/12/3
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	5,520	5,614	106,179	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	2,950	3,092	58,487	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	2,390	2,577	48,753	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	7,460	8,164	154,413	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,580	6,141	116,143	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	4,110	4,671	88,351	2048/10/22
小計				5,112,008	
(イスラエル)		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.15% 07/31/23	0.15	840	829	31,474	2023/7/31
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	1,210	1,166	44,236	2024/10/31
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	860	809	30,692	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,316	87,848	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	2,830	2,549	96,708	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	280	250	9,482	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,190	1,807	68,565	2037/5/31
ILGOV 1.5% 11/30/23	1.5	2,230	2,241	85,009	2023/11/30
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,240	1,236	46,902	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	2,750	2,725	103,382	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,010	2,004	76,018	2028/9/28
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	4,080	4,231	160,473	2024/3/31
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	3,130	3,391	128,622	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,030	2,755	104,494	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	3,060	3,581	135,829	2026/10/30
小計				1,209,741	
合計				297,584,217	

(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)
外国	EURO-SCHATZ	496	—
	US 5YR NOTE	1,065	—
	EURO-BOBL FU	781	—
	EURO-BUND	1,613	—
	US 10YR NOTE	869	—
	US LONG BOND	912	—

(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 297,584,217	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,619,511	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	306,203,728	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(300,593,413千円)の投資信託財産総額(306,203,728千円)に対する比率は98.2%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=127.02円

1ユーロ=136.29円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=91.02円

1オフショア人民元=18.9124円

1カナダドル=99.87円

1イギリスポンド=160.39円

1デンマーククローネ=18.32円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

1メキシコペソ=6.4954円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ポーランドズロチ=29.8545円

1マレーシアリングギット=29.0252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 2022年5月30日現在
(A)資 産	312,166,419,317円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,231,147,162
公 社 債(評価額)	297,584,217,256
未 収 入 金	5,975,913,184
未 収 利 息	1,602,999,713
前 払 費 用	68,788,346
差 入 委 託 証 拠 金	703,353,656
(B)負 債	6,035,903,620
未 払 金	6,013,434,102
未 払 解 約 金	22,464,619
未 払 利 息	4,899
(C)純 資 産 総 額(A-B)	306,130,515,697
元 本	99,597,188,643
次 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(D)受 益 権 総 口 数	99,597,188,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,737円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	5,588,602,464円
受 取 利 息	5,591,422,848
そ の 他 収 益 金	85,970
支 払 利 息	△2,906,354
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,919,550,310
売 買 益	28,346,868,449
売 買 損	△33,266,418,759
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△355,314,134
取 引 益	228,024,368
取 引 損	△583,338,502
(D)そ の 他 費 用	△78,636,127
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	235,101,893
(F)前 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	37,399,000,336
(H)解 約 差 損 益 金	△36,304,804,877
(I) 計 (E+F+G+H)	206,533,327,054
次 期 繰 越 損 益 金(I)	206,533,327,054

(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99,051,563,319円、期中追加設定元本額は17,957,103,019円、期中一部解約元本額は17,411,477,695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。

外国債券SMTBセクション(SMA専用)	15,588,874,755円
世界経済インデックスファンド	13,705,517,215円
DC世界経済インデックスファンド	12,670,772,916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)	11,035,294,676円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,187,835,347円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,001,557,866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)	2,526,946,203円
DC外国債券インデックス・オープン	2,299,774,574円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,173,342,834円
DCマイセクション25	1,953,384,106円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,763,244,024円
DCマイセクション50	1,676,561,671円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,322,110,043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)	1,316,783,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,312,521,937円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,174,457,124円
DCマイセクション75	1,141,290,393円
DCマイセクションS25	934,868,709円
グローバル経済コア	843,868,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,139,958円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	737,949,757円
DCマイセクションS50	736,631,684円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,286,117円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	600,790,052円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	569,673,405円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	545,698,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(切替型)	537,685,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	501,882,298円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	449,635,006円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	445,614,258円
DCマイセクションS75	414,158,205円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	387,700,518円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	344,318,886円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,732,727円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	311,958,664円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	305,209,636円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	283,459,403円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン	250,909,160円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,415,573円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	211,302,672円
SMT インデックスバランス・オープン	196,612,068円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	169,275,387円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,549,248円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	102,644,337円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	92,308,746円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	82,452,091円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	75,911,463円

バランス25VA2(適格機関投資家専用)	73,784,318円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	71,940,031円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	70,266,398円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	53,860,232円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	47,930,499円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,411,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,403,026円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173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)	23,157,130円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,454,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	13,381,571円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,541,025円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,653,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,114,094円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,968,437円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,146,398円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,811,153円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,650,011円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,324,475円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,718円

お知らせ

該当事項はありません。