

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22期（決算日 2024年10月21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
第20期(2023年10月20日)	8,950	0	△6.4	327.059	△6.1	98.3	0.6	4,258
第21期(2024年4月22日)	9,111	0	1.8	334.237	2.2	99.7	0.7	4,435
第22期(2024年10月21日)	9,265	0	1.7	341.151	2.1	100.8	0.5	4,681

(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。

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) 2024年4月22日	円	%		%	%	%
	9,111	—	334.237	—	99.7	0.7
4月末	9,103	△0.1	333.824	△0.1	101.3	1.0
5月末	9,077	△0.4	333.165	△0.3	97.9	0.8
6月末	9,160	0.5	336.313	0.6	99.4	1.1
7月末	9,231	1.3	339.237	1.5	92.9	0.8
8月末	9,302	2.1	342.249	2.4	96.2	0.8
9月末	9,364	2.8	344.613	3.1	96.2	0.9
(当期末) 2024年10月21日	9,265	1.7	341.151	2.1	100.8	0.5

(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。

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。

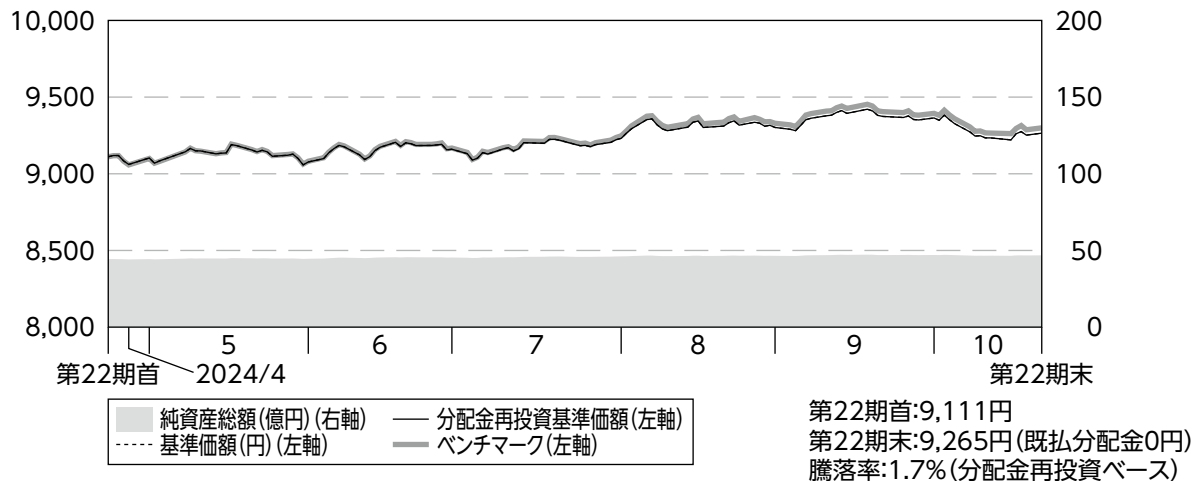
【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

「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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

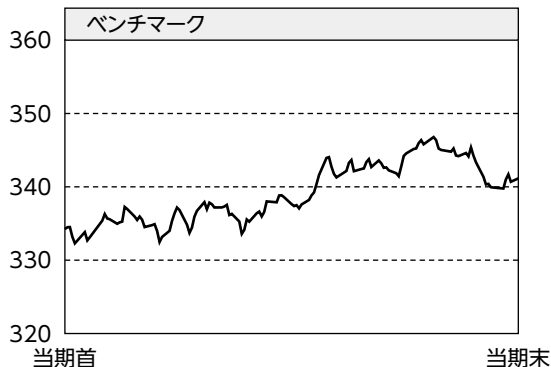


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2024年4月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、円ヘッジ円ベース)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



外国債券市場において主要な長期金利は、期首から9月にかけて、雇用や物価指標の鈍化を背景にした早期利下げ観測の高まりや、9月のFOMC(米連邦公開市場委員会)で0.5%の利下げが実施されたことなどから、米長期金利を中心に低下(債券価格は上昇)しました。その後期末にかけては、強い米経済指標を背景に米国で利下げ観測が後退したことなどから、米長期金利を中心に上昇しました。結果、期を通じてみると、長期金利は低下しました。

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。

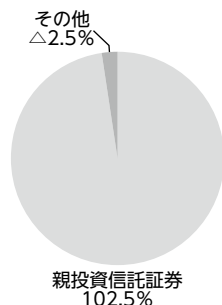
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

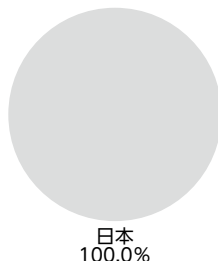
	当期末
	2024年10月21日
外国債券インデックス マザーファンド	102.5%
その他	△2.5%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

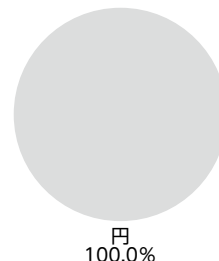
○資産別配分



○国別配分



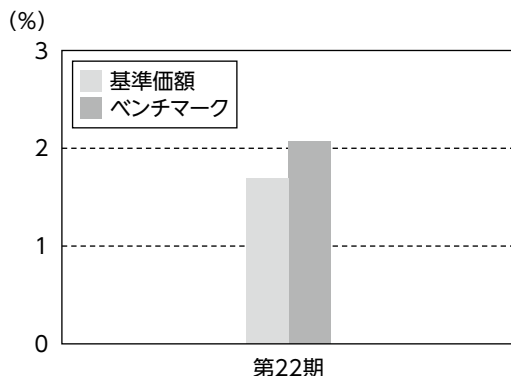
○通貨別配分



(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マイナス要因は、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22期	
	2024年4月23日~2024年10月21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)	2,652

(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
	(2024年4月23日~2024年10月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	25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9,206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	1	0.016	(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)	(0.013)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	26	0.290	

(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。

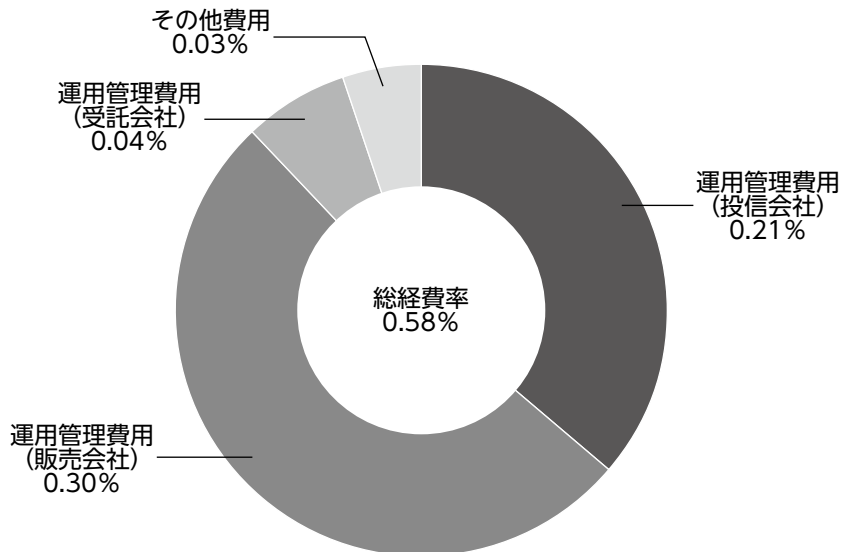
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.58%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 166,742	千円 594,521	千口 114,297	千円 417,061

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 27,247	百万円 13,463	% 49.4	百万円 27,487	百万円 18,481	% 67.2
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,652	565	21.3	2,655	565	21.3

(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 先 物 取 引	百万円 38,447	百万円 22,774	% 59.2	百万円 39,404	百万円 20,736	% 52.6
為 替 直 物 取 引	36,458	19,279	52.9	8,776	7,374	84.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	407,740	86,933	21.3	408,623	87,082	21.3

<平均保有割合 1.3%>

(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	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 1,273,954	千口 1,326,400	千円 4,799,313

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、101,775,665千口です。

※ 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	4,799,313	99.5
コール・ローン等、その他	26,103	0.5
投資信託財産総額	4,825,416	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(366,130,577千円)の投資信託財産総額(368,348,587千円)に対する比率は99.4%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=149.43円	1カナダドル=108.21円	1メキシコペソ=7.5159円
1ユーロ=162.36円	1イギリスポンド=194.96円	1スウェーデンクローナ=14.19円
1ノルウェークローネ=13.68円	1デンマーククローネ=21.77円	1ポーランドズロチ=37.6967円
1オーストラリアドル=100.19円	1ニュージーランドドル=90.78円	1シンガポールドル=114.03円
1マレーシアリンギット=34.6944円	1オフショア人民元=20.9894円	1イスラエルシェケル=40.2109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10月21日現在
(A) 資 産	9,530,186,207円
コール・ローン等	25,991,445
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,799,313,145
未 収 入 金	4,704,881,464
未 収 利 息	153
(B) 負 債	4,848,243,064
未 払 金	4,832,112,176
未 払 解 約 金	3,432,718
未 払 信 託 報 酬	12,572,504
そ の 他 未 払 費 用	125,666
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	4,681,943,143
元 本	5,053,513,771
次 期 繰 越 損 益 金	△371,570,628
(D) 受 益 権 総 口 数	5,053,513,771口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,265円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2024年 4月23日 至 2024年10月21日
(A) 配 当 等 収 益	15,135円
受 取 利 息	15,135
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	84,537,300
売 買 損 益	564,649,326
売 買 損 益	△480,112,026
(C) 信 託 報 酬 等	△12,698,170
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	71,854,265
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△591,253,723
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	147,828,830
(配 当 等 相 当 額)	(1,058,989,257)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△911,160,427)
(G) 計 (D+E+F)	△371,570,628
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△371,570,628
追 加 信 託 差 損 益 金	147,828,830
(配 当 等 相 当 額)	(1,059,229,247)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△911,400,417)
分 配 準 備 積 立 金	281,344,265
繰 越 損 益 金	△800,743,723

(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4,868,501,023円、期中追加設定元本額は588,413,521円、期中一部解約元本額は403,400,773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)		50,383,868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		1,059,229,247円
(D)	分配準備積立金額		230,960,397円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		1,340,573,512円
(F)	期末残存口数		5,053,513,771口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		2,652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。

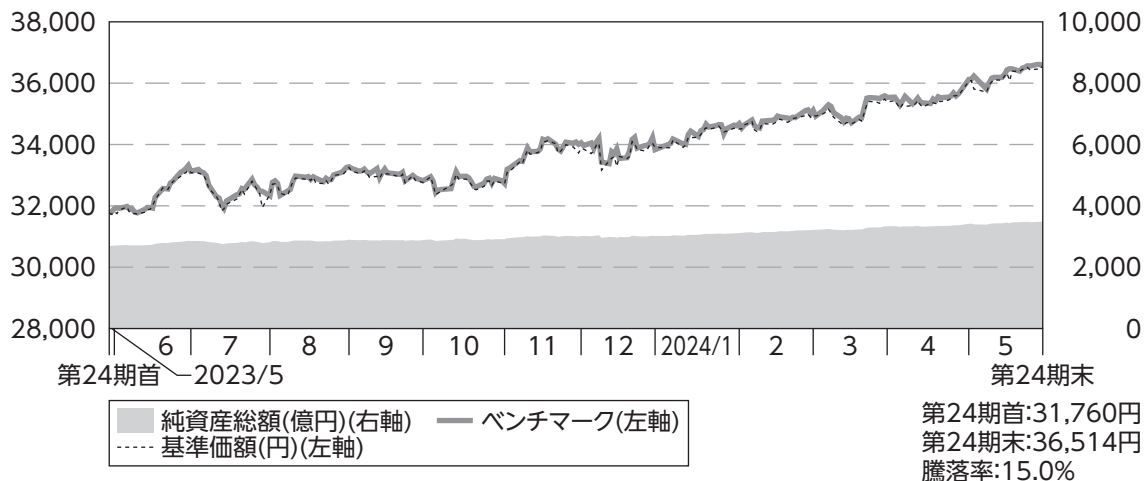
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

【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

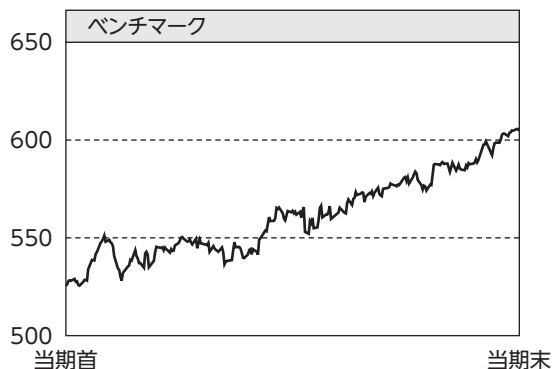


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

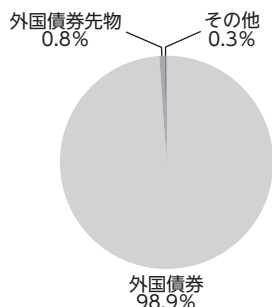
○上位10銘柄

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%

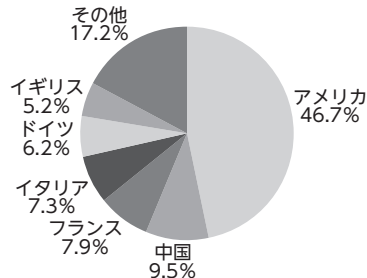
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.5%
8	T 3.5% 02/15/33	アメリカ	0.5%
9	T 1.125% 08/31/28	アメリカ	0.5%
10	T 1.625% 05/15/26	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		891	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

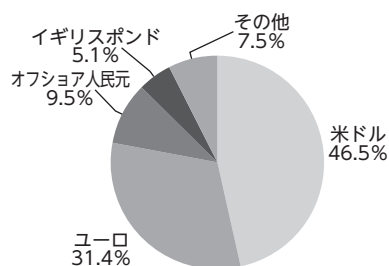
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

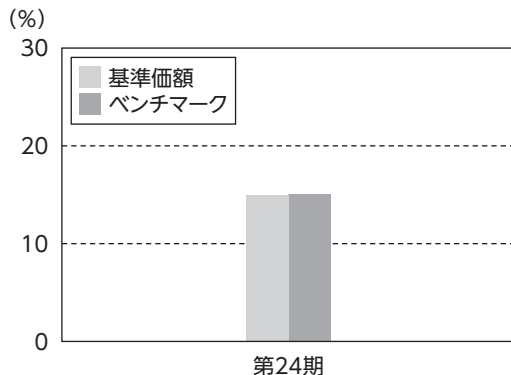


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 4,049	千スウェーデンクローナ 1,102
国	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。

外国債券インデックス マザーファンド ー第24期ー

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	
T 2.875% 05/15/52	2.875	10,800	7,759	1,221,419	2052/5/15	
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,732	587,509	2025/5/31	
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,319	837,213	2025/7/31	
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,220	7,669	1,207,252	2028/8/15	
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	1,717	270,334	2045/8/15	
T 2.875% 11/15/46	2.875	940	694	109,244	2046/11/15	
T 2.875% 11/30/25	2.875	9,000	8,713	1,371,445	2025/11/30	
T 3% 02/15/47	3.0	6,600	4,976	783,228	2047/2/15	
T 3% 02/15/48	3.0	1,000	748	117,754	2048/2/15	
T 3% 02/15/49	3.0	1,000	744	117,164	2049/2/15	
T 3% 05/15/42	3.0	2,450	1,930	303,909	2042/5/15	
T 3% 05/15/45	3.0	700	535	84,261	2045/5/15	
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	2,415	380,183	2047/5/15	
T 3% 07/15/25	3.0	11,150	10,885	1,713,397	2025/7/15	
T 3% 08/15/48	3.0	3,250	2,424	381,554	2048/8/15	
T 3% 08/15/52	3.0	5,200	3,834	603,533	2052/8/15	
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,085	643,132	2025/9/30	
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	4,857	764,512	2025/10/31	
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,150	338,459	2044/11/15	
T 3% 11/15/45	3.0	2,300	1,753	275,962	2045/11/15	
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	846	133,229	2042/2/15	
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,800	3,027	476,533	2043/2/15	
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,780	3,655	575,329	2048/5/15	
T 3.125% 08/15/25	3.125	10,200	9,956	1,567,224	2025/8/15	
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,840	1,446	227,744	2044/8/15	
T 3.125% 08/31/27	3.125	6,150	5,855	921,708	2027/8/31	
T 3.125% 08/31/29	3.125	7,150	6,666	1,049,312	2029/8/31	
T 3.125% 11/15/28	3.125	10,410	9,787	1,540,477	2028/11/15	
T 3.25% 05/15/42	3.25	4,150	3,394	534,305	2042/5/15	
T 3.25% 06/30/29	3.25	3,000	2,818	443,665	2029/6/30	
T 3.375% 05/15/33	3.375	13,630	12,459	1,961,120	2033/5/15	
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	2,467	388,309	2044/5/15	
T 3.375% 08/15/42	3.375	2,300	1,911	300,837	2042/8/15	
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	4,232	666,251	2048/11/15	
T 3.5% 01/31/30	3.5	4,000	3,785	595,783	2030/1/31	
T 3.5% 02/15/33	3.5	11,200	10,356	1,630,181	2033/2/15	
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	682	107,373	2039/2/15	
T 3.5% 04/30/30	3.5	3,500	3,305	520,342	2030/4/30	
T 3.5% 09/15/25	3.5	2,900	2,840	447,054	2025/9/15	
T 3.625% 02/15/44	3.625	4,890	4,169	656,277	2044/2/15	
T 3.625% 02/15/53	3.625	9,550	7,966	1,253,972	2053/2/15	
T 3.625% 05/15/53	3.625	2,300	1,919	302,074	2053/5/15	
T 3.625% 08/15/43	3.625	4,700	4,020	632,858	2043/8/15	
T 3.75% 04/15/26	3.75	6,570	6,425	1,011,335	2026/4/15	
T 3.75% 06/30/30	3.75	3,000	2,868	451,541	2030/6/30	
T 3.75% 11/15/43	3.75	4,730	4,115	647,774	2043/11/15	
T 3.875% 01/15/26	3.875	6,500	6,380	1,004,216	2026/1/15	
T 3.875% 02/15/43	3.875	2,500	2,224	350,061	2043/2/15	
T 3.875% 08/15/33	3.875	8,170	7,755	1,220,781	2033/8/15	
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,320	207,814	2040/8/15	
T 3.875% 09/30/29	3.875	3,540	3,421	538,521	2029/9/30	
T 3.875% 11/30/29	3.875	8,130	7,851	1,235,773	2029/11/30	
T 4% 01/15/27	4.0	3,200	3,136	493,704	2027/1/15	
T 4% 02/15/26	4.0	6,500	6,389	1,005,775	2026/2/15	
T 4% 02/28/30	4.0	6,200	6,018	947,289	2030/2/28	
T 4% 07/31/30	4.0	3,980	3,857	607,120	2030/7/31	
T 4% 10/31/29	4.0	6,550	6,366	1,002,094	2029/10/31	
T 4% 11/15/52	4.0	7,400	6,618	1,041,777	2052/11/15	
T 4.125% 08/15/53	4.125	4,300	3,928	618,378	2053/8/15	
T 4.125% 08/31/30	4.125	9,200	8,974	1,412,556	2030/8/31	
T 4.125% 10/31/27	4.125	3,100	3,043	479,019	2027/10/31	
T 4.125% 11/15/32	4.125	14,000	13,581	2,137,793	2032/11/15	
T 4.25% 02/15/54	4.25	3,250	3,036	477,979	2054/2/15	

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)	償還年月日	
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	865	136,286	2039/5/15	
T 4.25% 10/15/25	4.25	6,900	6,819	1,073,311	2025/10/15	
T 4.25% 11/15/40	4.25	740	703	110,797	2040/11/15	
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	984	154,940	2038/2/15	
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	1,842	289,994	2040/5/15	
T 4.375% 05/15/41	4.375	650	626	98,581	2041/5/15	
T 4.375% 08/15/26	4.375	6,000	5,933	933,923	2026/8/15	
T 4.375% 08/31/28	4.375	14,150	14,009	2,205,068	2028/8/31	
T 4.375% 11/15/39	4.375	960	933	146,919	2039/11/15	
T 4.375% 11/30/30	4.375	4,500	4,449	700,414	2030/11/30	
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,096	172,641	2036/2/15	
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	547	86,170	2038/5/15	
T 4.5% 07/15/26	4.5	10,000	9,915	1,560,627	2026/7/15	
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	1,679	264,277	2039/8/15	
T 4.5% 11/15/33	4.5	9,270	9,235	1,453,740	2033/11/15	
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,378	216,999	2040/2/15	
T 4.625% 09/30/30	4.625	3,010	3,018	475,041	2030/9/30	
T 4.625% 10/15/26	4.625	9,520	9,469	1,490,516	2026/10/15	
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	756	119,062	2041/2/15	
T 4.75% 11/15/53	4.75	3,180	3,227	508,039	2053/11/15	
T 4.875% 10/31/30	4.875	2,500	2,541	399,955	2030/10/31	
T 5% 08/31/25	5.0	4,250	4,241	667,538	2025/8/31	
T 5.0% 05/15/37	5.0	400	419	66,080	2037/5/15	
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,334	210,887	2028/11/15	
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,052	323,031	2031/2/15	
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,731	272,576	2026/2/15	
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,517	238,839	2027/11/15	
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,139	179,427	2030/5/15	
小計				160,034,924		
(カナダ)						
国債証券						
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,125	245,041	2026/3/1	
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	3,010	2,864	330,200	2025/9/1	
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,320	2,185	218,487	2030/12/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	743	85,730	2027/6/1	
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,427	164,506	2026/9/1	
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	1,880	1,745	201,192	2027/3/1	
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,146	362,709	2030/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	910	863	99,471	2026/6/1	
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,770	3,258	375,579	2031/6/1	
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	3,620	3,098	357,149	2031/12/1	
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	2,920	1,962	226,236	2053/12/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	410	383	44,194	2028/6/1	
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,520	1,341	154,603	2032/6/1	
CAN 2% 12/01/51	2.0	3,650	2,647	305,151	2051/12/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,280	1,250	144,111	2025/6/1	
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	240	226	25,907	2029/6/1	
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	2,300	2,099	242,017	2032/12/1	
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	1,200	1,113	128,399	2033/6/1	
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	1,600	1,543	177,876	2027/9/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,050	907	104,635	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	1,420	1,210	139,564	2055/12/1	
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	521	60,123	2064/12/1	
CAN 3% 04/01/26	3.0	1,340	1,309	150,953	2026/4/1	
CAN 3% 06/01/34	3.0	1,850	1,744	201,055	2034/6/1	
CAN 3% 10/01/25	3.0	3,290	3,225	371,760	2025/10/1	
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	2,070	2,025	233,447	2028/9/1	
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	1,310	1,263	145,664	2033/12/1	
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	1,160	1,145	132,032	2028/3/1	
CAN 3.5% 08/01/25	3.5	920	908	104,725	2025/8/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	960	942	108,668	2045/12/1	
CAN 4% 03/01/29	4.0	2,400	2,424	279,438	2029/3/1	
CAN 4% 05/01/26	4.0	2,250	2,238	257,982	2026/5/1	

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 2.8% 06/15/29	2.8	2,610	2,535	432,977	2029/6/15	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,420	1,387	236,894	2028/12/1	
BTPS 2.95% 02/15/27	2.95	330	326	55,719	2027/2/15	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	1,110	975	166,619	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,150	1,127	192,570	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,250	213,514	2040/3/1	
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	1,860	1,699	290,187	2038/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	2,270	1,953	333,650	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,890	1,801	307,639	2035/3/1	
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	2,000	2,001	341,833	2028/4/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,820	1,605	274,287	2048/3/1	
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	910	909	155,418	2026/1/15	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,360	2,366	404,172	2030/3/1	
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	1,030	1,040	177,626	2030/6/15	
BTPS 3.8% 04/15/26	3.8	1,440	1,448	247,450	2026/4/15	
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	1,760	1,787	305,275	2028/8/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,470	1,375	234,912	2049/9/1	
BTPS 3.85% 09/15/26	3.85	860	868	148,293	2026/9/15	
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	2,860	2,914	497,813	2029/12/15	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,070	3,085	527,025	2037/2/1	
BTPS 4% 04/30/35	4.0	880	890	152,067	2035/4/30	
BTPS 4% 10/30/31	4.0	1,250	1,283	219,292	2031/10/30	
BTPS 4% 11/15/30	4.0	1,800	1,846	315,372	2030/11/15	
BTPS 4.1% 02/01/29	4.1	440	453	77,380	2029/2/1	
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	460	459	78,484	2039/10/1	
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	1,920	1,979	338,041	2034/3/1	
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	1,800	1,879	321,066	2033/11/1	
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	1,060	1,113	190,201	2033/5/1	
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	1,560	1,597	272,871	2043/9/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,116	361,407	2026/3/1	
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	1,510	1,547	264,329	2053/10/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	2,770	473,241	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,600	1,707	291,585	2044/9/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,170	3,478	594,099	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,260	2,474	422,643	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,680	2,933	501,089	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,710	2,955	504,843	2029/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,618	447,288	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,140	1,312	224,178	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,700	2,972	507,693	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,524	260,397	2026/11/1	
(フランス)						
国債証券						
FRTR 0% 02/25/26	—	4,020	3,805	649,985	2026/2/25	
FRTR 0% 02/25/27	—	4,000	3,685	629,444	2027/2/25	
FRTR 0% 05/25/32	—	3,780	2,995	511,549	2032/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	4,820	4,120	703,720	2029/11/25	
FRTR 0% 11/25/30	—	5,810	4,822	823,710	2030/11/25	
FRTR 0% 11/25/31	—	4,890	3,936	672,393	2031/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,290	4,004	683,906	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,950	3,838	655,505	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	4,500	4,274	730,121	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,400	4,483	765,682	2029/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	2,690	1,761	300,881	2040/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	1,290	482	82,385	2072/5/25	
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	2,030	1,192	203,740	2044/6/25	
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	5,200	4,799	819,700	2028/2/25	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,410	4,970	848,854	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	2,940	1,541	263,256	2052/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	3,040	1,557	266,044	2053/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	3,850	3,502	598,187	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,970	4,689	800,859	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,670	4,518	771,678	2025/11/25	

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)		
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,460	3,771	644,180	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,450	3,608	616,273	2036/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	2,740	2,470	363,059	2038/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,080	5,543	946,827	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,050	2,048	349,948	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,680	1,092	186,529	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,250	2,672	456,353	2039/6/25	
FRTR 2% 05/25/48	2.0	2,860	2,026	376,226	2048/5/25	
FRTR 2% 11/25/32	2.0	2,900	2,687	459,021	2032/11/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,570	5,446	930,265	2030/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	1,440	1,260	215,349	2043/5/25	
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	3,140	3,097	528,986	2026/9/24	
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	4,370	4,334	740,318	2029/2/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,730	4,693	801,595	2027/10/25	
FRTR 3% 05/25/33	3.0	4,210	4,202	717,830	2033/5/25	
FRTR 3% 05/25/54	3.0	2,380	2,164	369,665	2054/5/25	
FRTR 3% 06/25/49	3.0	770	716	122,363	2049/6/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,860	2,799	478,157	2045/5/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,730	4,759	812,893	2026/4/25	
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	3,100	3,212	548,590	2033/11/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,540	2,784	475,491	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,780	1,971	336,640	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,140	2,321	396,489	2038/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,440	3,960	676,403	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,440	2,804	479,055	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,920	6,604	1,127,917	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,370	5,245	895,921	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	1,968	336,228	2025/10/25	
(オランダ)						
国債証券						
NETHER 0% 01/15/26	—	1,190	1,131	193,321	2026/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—	1,730	1,602	273,705	2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/29	—	1,610	1,416	241,902	2029/1/15	
NETHER 0% 01/15/38	—	1,170	786	131,319	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,740	809	138,308	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,350	1,142	195,051	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,370	1,128	192,666	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,910	1,846	315,382	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	950	836	142,931	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,470	1,025	175,169	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,750	1,660	283,588	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	1,150	960	164,032	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	843	144,077	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,610	1,482	253,199	2028/7/15	
NETHER 2% 01/15/54	2.0	1,120	924	157,816	2054/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	1,000	984	168,203	2030/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,550	1,515	258,764	2033/1/15	
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	1,320	1,285	219,540	2033/7/15	
NETHER 2.5% 07/15/34	2.5	500	483	82,659	2034/7/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,840	1,793	306,340	2047/1/15	
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	680	709	121,250	2044/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,700	1,883	321,651	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,660	1,843	314,872	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,530	1,667	284,756	2028/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0% 01/31/26	—	2,660	2,521	430,588	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	2,910	2,677	457,375	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	3,050	2,729	466,151	2028/1/31	
SPGB 0% 05/31/25	—	3,060	2,955	504,777	2025/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	2,200	1,794	306,531	2031/4/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,210	2,772	473,453	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	2,570	2,128	363,486	2031/10/31	

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	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	1,970	1,732	295,827	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,825	311,819	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,272	388,152	2027/7/30	
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	2,750	2,456	419,572	2029/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,050	179,495	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	1,180	764	130,492	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,000	1,079	184,323	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,110	1,470	251,157	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	2,980	2,665	455,171	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,070	1,981	338,492	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,450	2,302	393,187	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	2,050	1,919	327,887	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,497	426,593	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,280	2,161	369,084	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	320	54,754	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,500	1,433	244,771	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,450	1,425	243,441	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,190	1,879	320,915	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,810	1,205	205,960	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,300	2,245	383,546	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,020	1,895	323,743	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,570	1,545	263,933	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,190	2,034	347,462	2033/7/30	
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	2,530	2,408	411,355	2032/10/31	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,710	1,413	241,332	2048/10/31	
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	1,670	1,655	282,729	2026/5/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,850	1,607	274,592	2046/10/31	
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	1,990	1,974	337,178	2033/4/30	
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	2,150	2,134	364,513	2034/4/30	
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	1,190	1,137	194,354	2043/7/30	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,530	1,382	236,178	2066/7/30	
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	660	673	114,981	2029/5/31	
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	2,270	2,315	395,522	2033/10/31	
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	1,330	1,367	233,626	2039/7/30	
SPGB 4% 10/31/54	4.0	650	657	112,238	2054/10/31	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,800	1,931	329,836	2037/1/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	2,880	491,883	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,880	2,121	362,267	2041/7/30	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,730	1,985	339,080	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,710	4,029	688,170	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,420	1,699	290,172	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,250	2,663	454,815	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,310	2,437	416,259	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	910	1,026	175,313	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	900	815	139,284	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,460	1,177	201,166	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,420	1,201	205,221	2030/6/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	1,220	991	169,380	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	660	420	71,859	2040/6/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	440	180	30,752	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,000	1,945	332,314	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,510	1,415	241,687	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,600	1,473	251,625	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,670	1,516	258,941	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,840	1,763	301,134	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,560	1,369	233,965	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,310	1,135	193,925	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	1,050	652	111,478	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	652	111,408	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,080	764	130,647	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,100	767	131,101	2050/6/22	

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)	償還年月日	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	650	549	93,901	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	880	644	110,109	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	670	508	86,866	2057/6/22	
BGB 2.7% 10/22/29	2.7	180	178	30,433	2029/10/22	
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	560	523	89,487	2039/4/22	
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	680	664	113,445	2034/10/22	
BGB 3% 06/22/33	3.0	1,450	1,446	247,037	2033/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,050	1,043	178,258	2034/6/22	
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	1,020	974	166,489	2054/6/22	
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	440	441	75,372	2043/6/22	
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	530	523	89,427	2055/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	930	973	166,191	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,156	197,551	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,750	1,947	332,619	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,166	199,297	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,810	2,117	361,690	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,040	2,228	380,540	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,480	1,253	214,154	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,670	1,372	234,432	2031/2/20	
RAGB 0% 10/20/28	—	880	775	132,436	2028/10/20	
RAGB 0% 10/20/40	—	580	344	58,908	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	720	508	86,770	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,410	1,260	215,260	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,490	1,388	237,182	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	350	152	26,082	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	880	813	138,899	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	442	75,500	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	1,480	1,403	239,682	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	230	101	17,404	2120/6/30	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	1,230	1,054	180,122	2032/2/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,190	1,156	197,559	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,080	781	133,507	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	310	181	31,064	2086/11/2	
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	660	505	86,341	2049/5/23	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	650	476	81,314	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	930	877	149,928	2034/5/23	
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	1,500	1,485	255,731	2033/2/20	
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	720	710	121,308	2034/2/20	
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	220	219	37,572	2029/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	700	690	117,963	2044/6/20	
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	440	430	73,578	2053/10/20	
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	230	236	40,402	2030/10/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	470	80,387	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,460	1,609	274,930	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,170	1,203	205,620	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,292	220,783	2027/7/15	
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB 0% 09/15/26	—	460	428	73,250	2026/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	720	599	102,462	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	440	310	52,961	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	207	35,510	2052/4/15	
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	630	514	87,889	2031/9/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	300	188	32,199	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	570	542	92,726	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	490	303	51,858	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	540	498	85,162	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	730	658	112,549	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	530	467	79,873	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	510	441	75,375	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	440	426	72,909	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)	
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

		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)		
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	3,680	3,581	81,969	2033/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	9,470	11,541	264,191	2039/11/15	
小計				893,560		
(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% 10/25/25	—	940	875	35,150	2025/10/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,260	2,003	80,473	2026/10/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	3,900	2,989	120,081	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	3,560	2,669	107,210	2032/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,900	4,618	185,515	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	5,530	5,063	203,348	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	3,270	2,957	118,801	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,000	5,201	208,895	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,480	4,385	176,136	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	2,110	2,013	80,883	2027/5/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	4,320	4,329	173,903	2029/4/25	
POLGB 6% 10/25/33	6.0	4,350	4,407	177,031	2033/10/25	
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	3,610	3,853	154,759	2028/7/25	
小計				1,822,191		
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
国債証券						
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,100	1,984	207,436	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,390	2,207	230,793	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	2,780	2,221	232,188	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	1,710	1,409	147,300	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,770	2,223	232,387	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	2,400	2,017	210,916	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,860	1,032	107,952	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,000	1,650	172,570	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,480	1,388	145,118	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	2,340	2,150	224,755	2030/5/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,330	1,049	109,702	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,470	1,270	132,846	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,530	1,470	153,759	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,578	165,001	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,780	1,670	174,653	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,350	1,038	108,601	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,840	1,662	173,786	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,810	1,751	183,103	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	940	816	85,312	2039/6/21	
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	1,690	1,578	165,031	2034/12/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,220	1,146	119,828	2037/4/21	
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	1,980	1,898	198,468	2034/5/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,770	1,777	185,781	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	3,010	3,071	321,045	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,010	2,053	214,643	2027/4/21	
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	720	734	76,822	2054/6/21	
小計				4,479,809		
(ニュージーランド)		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル			
国債証券						
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	990	832	80,407	2028/5/15	
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	730	670	64,716	2026/5/15	
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	1,000	812	78,400	2031/5/15	
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	460	287	27,793	2041/5/15	
NZGB 2% 05/15/32	2.0	700	573	55,389	2032/5/15	
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	630	498	48,144	2037/4/15	
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	600	396	38,320	2051/5/15	
NZGB 3% 04/20/29	3.0	830	770	74,432	2029/4/20	
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	1,320	1,198	115,729	2033/4/14	
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	450	429	41,509	2034/5/15	
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	840	834	80,539	2027/4/15	
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	490	486	46,933	2030/5/15	

		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)		
NZGB 4.5% 05/15/35	4.5	440	426	41,179	2035/5/15	
NZGB 5% 05/15/54	5.0	380	373	36,105	2054/5/15	
小計				829,602		
(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	790	757	88,345	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	870	826	96,439	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	560	510	58,469	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	730	559	65,233	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	420	319	37,225	2051/10/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	830	808	94,358	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	760	684	79,795	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	900	889	103,765	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	380	340	39,683	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	720	702	81,979	2028/5/1	
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	460	438	51,141	2032/8/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	820	756	88,310	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	587	68,571	2042/4/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	637	74,388	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	420	414	48,335	2027/9/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	710	693	80,882	2030/9/1	
SIGB 3% 04/01/29	3.0	150	148	17,284	2029/4/1	
SIGB 3% 08/01/72	3.0	490	464	54,219	2072/8/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	836	97,554	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	740	742	86,630	2027/3/1	
小計				1,412,615		
(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券						
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,650	1,529	51,261	2031/4/15	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,506	50,487	2027/5/31	
MGS 3.519% 04/20/28	3.519	710	706	23,687	2028/4/20	
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	1,310	1,283	43,010	2032/7/15	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,930	2,937	98,416	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	2,360	2,272	76,147	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,770	1,761	59,032	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,880	1,873	62,971	2033/4/15	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	2,160	2,180	73,047	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,139	38,185	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,988	66,630	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,470	2,492	83,496	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	604	20,267	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,690	1,702	57,027	2025/9/15	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	3,070	2,993	100,286	2050/6/15	
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,490	2,549	85,426	2031/6/30	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,750	1,798	60,262	2035/5/31	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,520	2,562	85,870	2026/4/15	
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	1,090	1,131	37,923	2053/3/31	
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	3,070	3,184	106,692	2030/4/15	
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	350	362	12,157	2029/4/30	
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	870	920	30,830	2033/11/7	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	1,970	2,118	70,994	2042/10/15	
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	980	1,058	35,457	2046/3/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,780	2,988	100,138	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,840	2,010	67,365	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,680	1,860	62,324	2048/7/6	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,030	1,138	38,131	2043/9/30	
小計				1,697,340		
(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 2% 06/15/25	2.0	43,900	44,020	953,505	2025/6/15	
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	28,600	28,760	622,963	2026/8/15	
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	17,100	17,190	372,345	2025/8/25	

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 ファンド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 ファンド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・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	22,496円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	22,344円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	22,342円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	21,744円
DCターゲット・イヤーファンド(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。