

■ 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／内外／債券／インデックス型 |
| 信託期間 | 無期限（設定日：2014年12月15日） |
| 運用方針 | マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内債券パッシブ・マザーファンド 日本の公社債および短期金融資産 外国債券パッシブ・マザーファンド 日本を除く世界各国の債券 |
| 当ファンドの運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 内外の公社債に投資する2つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。 ■ 国内債券、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は、国内債券75%、外国債券20%、短期金融資産5%とします。 ■ 運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ■ 実質外貨建資産については、原則として円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。 |
| 組入制限 | 当ファンド <ul style="list-style-type: none"> ■ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 国内債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■ 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■ 外貨建資産への投資は行いません。 外国債券パッシブ・マザーファンド <ul style="list-style-type: none"> ■ 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■ 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 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 年1回（原則として毎年2月18日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。 ■ 分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 |

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

三井住友・DC年金 バランスゼロ(債券型) 【愛称:マイパッケージZERO】 【運用報告書(全体版)】

(2019年2月19日から2020年2月18日まで)

第 **5** 期
決算日 2020年2月18日

受益者の皆さまへ

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
 (旧:三井住友アセットマネジメント)
 〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

フリーダイヤル 0120-88-2976
 受付時間:午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■ 設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 税 配 込 金 騰 落 中 率 | | | ベンチマーク | | 債券組入率 比 | 純 資 産 額 |
|----------------------|------------------|-----------------|--------|--------|--------|--------|------------|------------|
| | | 税 分 配 | 込 金 | 騰 落 | 騰 落 | 中 率 | | |
| (設定日) 2014年12月15日 | 円 10,000 | 円 - | 円 - | % - | 100.00 | % - | % - | 百万円 0.1 |
| 1期(2016年2月18日) | 10,118 | 0 | | 1.2 | 101.36 | 1.4 | 91.9 | 8 |
| 2期(2017年2月20日) | 10,036 | 0 | | △0.8 | 100.86 | △0.5 | 94.7 | 71 |
| 3期(2018年2月19日) | 10,150 | 0 | | 1.1 | 102.23 | 1.4 | 93.7 | 98 |
| 4期(2019年2月18日) | 10,285 | 0 | | 1.3 | 103.85 | 1.6 | 94.7 | 144 |
| 5期(2020年2月18日) | 10,484 | 0 | | 1.9 | 106.14 | 2.2 | 94.3 | 207 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※ベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）75%、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）20%、有担保コール翌日物5%の割合で組み合わせ合わせた合成指数で、設定時を100として2020年2月18日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | ベンチマーク | 騰 落 率 | | 債券組入率 比 |
|--------------------|-------------|-------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 騰 落 | 率 | | 騰 落 | 率 | |
| (期首) 2019年2月18日 | 円 10,285 | | % - | 103.85 | % - | % 94.7 | |
| 2月末 | 10,293 | | 0.1 | 103.94 | 0.1 | 94.4 | |
| 3月末 | 10,372 | | 0.8 | 104.76 | 0.9 | 94.6 | |
| 4月末 | 10,340 | | 0.5 | 104.47 | 0.6 | 94.0 | |
| 5月末 | 10,371 | | 0.8 | 104.78 | 0.9 | 94.3 | |
| 6月末 | 10,442 | | 1.5 | 105.53 | 1.6 | 94.4 | |
| 7月末 | 10,455 | | 1.7 | 105.69 | 1.8 | 94.2 | |
| 8月末 | 10,572 | | 2.8 | 106.91 | 2.9 | 94.2 | |
| 9月末 | 10,497 | | 2.1 | 106.16 | 2.2 | 94.1 | |
| 10月末 | 10,484 | | 1.9 | 106.04 | 2.1 | 94.4 | |
| 11月末 | 10,455 | | 1.7 | 105.79 | 1.9 | 94.2 | |
| 12月末 | 10,439 | | 1.5 | 105.64 | 1.7 | 94.2 | |
| 2020年1月末 | 10,487 | | 2.0 | 106.15 | 2.2 | 94.3 | |
| (期末) 2020年2月18日 | 10,484 | | 1.9 | 106.14 | 2.2 | 94.3 | |

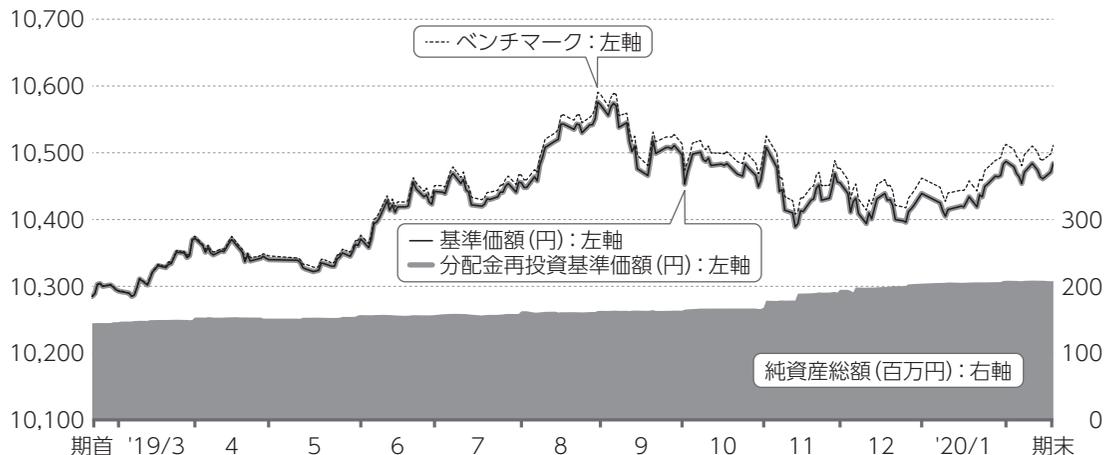
※騰落率は期首比です。

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

1 運用経過

基準価額等の推移について（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

基準価額等の推移



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

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 10,285円 |
| 期末 | 10,484円 (分配金0円(税引前)込み) |
| 騰落率 | +1.9% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI(総合)75%、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、有担保コール翌日物5%の割合で組み合わせた合成指数です。

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

基準価額の主な変動要因(2019年2月19日から2020年2月18日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- 内外の債券利回りが低下(価格は上昇)したこと

下落要因

- 米ドルやユーロが円に対して下落したこと

組入れファンドの状況

| 組入れファンド | 投資資産 | 騰落率 | 基本資産配分 | 期末組入比率 |
|------------------|--------|-------|--------|--------|
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 国内債券 | +1.4% | 75% | 74.9% |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 外国債券 | +5.9% | 20% | 20.1% |
| — | 短期金融資産 | — | 5% | 5.0% |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

当期の国内債券・外国債券の利回りはともに低下しました。為替市場では、米ドルやユーロが円に対して下落する展開となりました。

国内債券

日銀の金融緩和政策が続く中、米欧の債券利回りの低下に連れて、日本の長期債利回り（10年国債利回り）も期首から8月後半にかけては低下基調で推移しました。9月から2020年1月中旬にかけては、米欧債券利回りの上昇や日銀が国債買入れオペを減額したことなどを受け、国内債券利回りは上昇基調で推移しました。その後、期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大に対する懸念などから、債券利回りは低下しました。

当期の市場の動きを代表的な指数であるNOMURA-BPI（総合）でみると、期首比で1.3%上昇しました。

外国債券

米回国債利回りは、期を通してみれば低下しました。

期首からしばらくもみあいが続きましたが、3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）でFRB（米連邦準備制度理事会）のバランスシート縮小の早期停止が示唆されたことを受けて利下げ期待が広がり、金利は低下し

ました。その後も、米中貿易摩擦に対する警戒感などが下支えとなり、8月後半にかけて引き続き低下基調で推移しました。

9月から2020年1月中旬にかけては、米中貿易協議の進展などを背景に債券利回りが上昇しました。1月下旬以降は、新型コロナウイルスに対する懸念などから、債券利回りは低下する動きとなりました。

欧州では、英国のEU（欧州連合）離脱を巡る迷走やイタリアの政治情勢を巡る混乱といった欧州政治の不透明感などを背景に、ドイツの債券利回りは、期初から8月後半にかけて低下基調が続きました。

9月から1月中旬にかけては、米中貿易協議の進展や英国の合意なきEU離脱が避けられる見通しがついたことなどを受け、利回りが上昇する動きとなりました。1月下旬から期末にかけては、新型コロナウイルスに対する懸念などを背景に、債券利回りは低下する動きとなりました。

当期の米国10年国債利回りは期首2.66%から期末1.58%に低下しました。ドイツ10年国債利回りは期首0.10%から期末-0.40%に低下しました。

外国為替

●米ドル・円

米ドル・円は、期初から4月にかけては株価が反発する中、米ドルが上昇しました。5月以降は、米中貿易摩擦に対する懸念やFRBによる金融緩和観測などが米ドルの上値抑制要因となり、8月後半にかけて、米ドルは下落する展開となりました。9月以降は、米国株価の上昇などを背景に、期末にかけて米ドルがじり高の展開となりました。

当期の米ドル・円は、期首110円54銭から期末109円86銭と0円68銭の米ドル安・円高となりました。

●ユーロ・円

ユーロ・円は、期首から8月にかけて、英国のEU離脱を巡る迷走など欧州政治の不透明感や欧州債券利回りの低下が、ユーロの下押し材料となりました。9月以降は米中貿易協議の進展や英国の合意なきEU離脱が避けられる見通しがついたことなどを受け、ユーロは上昇しました。しかし、1月下旬から期末にかけては新型コロナウイルスの感染がイタリアを中心に拡大したことなどから、ユーロは再び下落しました。

当期のユーロ・円は、期首124円93銭から期末118円95銭と5円98銭のユーロ安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2019年2月19日から2020年2月18日まで)

当ファンド

マザーファンドへの投資を通じて、主として内外の公社債に国際分散投資を行いました。

時価変動等に伴う組入比率の変化については、追加設定や一部解約といった資金流入に応じて各マザーファンドの売買を通じて資産配分の基準値からの乖離を調整しました。

国内債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI(総合)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、デュレーション(投資資金の平均回収期間)、満期・債券種別・格付け構成などをベンチマークに合わせつつ、個別銘柄については分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーションなど)をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス(投資配分比率の調整)を

行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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）に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

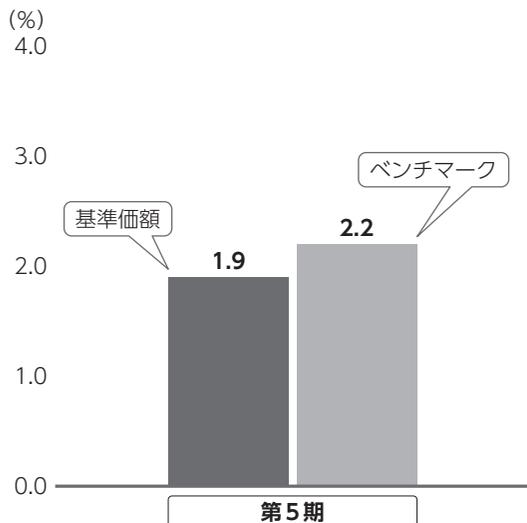
具体的には、通貨・国別配分、デュレーシ

ン、満期構成等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整しました。

インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（国別比率、デュレーション等）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランスを行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

ベンチマークとの差異について（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドはNOMURA-BPI（総合）を75%、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）を20%、有担保コール翌日物を5%の割合で組み合わせた合成指数をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は+1.9%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの騰落率の+2.2%を0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 資産配分のタイミング
時価変動により実際の資産配分比率が基本資産配分に対して乖離している状態で、当該資産の市場が変動することにより、各資産の複合ベンチマークを加重平均して算出する合成指数の収益率との乖離が生じるもの
- 信託報酬等の支払い

分配金について（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第5期 |
|-----------|------|
| 当期分配金 | — |
| （対基準価額比率） | （—%） |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 483 |

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

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

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

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続きマザーファンドへの投資を通じて、内外の公社債に国際分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指します。

国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指して運用を行います。デュレーション、満期構成、流動性などを考慮して選択した債券に分散投資し、債券組入比率を高位に保つことを基本とします。

外国債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整します。

また月次のベンチマーク更新時や、日々の資金流出入に対応し、迅速なリバランスを行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

約款変更について

- 委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。（適用日：2019年4月1日）

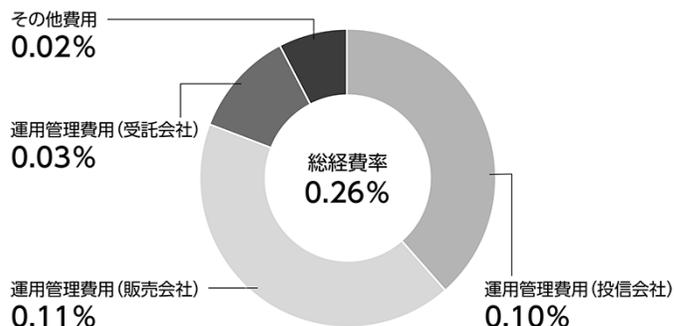
■ 1万口当たりの費用明細（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|--|------------------------------|---|---|
| (a) 信 託 報 酬 （ 投 信 会 社 ） （ 販 売 会 社 ） （ 受 託 会 社 ） | 25円 (10) (11) (3) | 0.242% (0.099) (0.110) (0.033) | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 （ 保 管 費 用 ） （ 監 査 費 用 ） （ そ の 他 ） | 2 (1) (1) (0) | 0.015 (0.007) (0.005) (0.002) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合 計 | 27 | 0.257 | |

期中の平均基準価額は10,433円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
 ※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。
 ※各項目毎に円未満は四捨五入しています。
 ※その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

参考情報 総経費率（年率換算）



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
 ※各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。
 ※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

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

■ 当期中の売買及び取引の状況（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------|-------------|--------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 千口 9,828 | 千円 17,670 | 千口 3,965 | 千円 7,100 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 47,121 | 60,930 | 11,945 | 15,450 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等（2019年2月19日から2020年2月18日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
| | | うち利害関係人 との取引状況B | B A | | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
| 公社債 | 百万円 27,384 | 百万円 2,601 | % 9.5 | 百万円 66,430 | 百万円 6,355 | % 9.6 |

※平均保有割合 0.1%

※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該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

外国債券パッシブ・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期 末 保 有 額 |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 203 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|------------|
| 公社債 | 百万円 800 |

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2019年2月19日から2020年2月18日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2020年2月18日現在)

親投資信託残高

| 種 類 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 千口 16,834 | 千口 22,698 | 千口 41,794 | 千円 41,794 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 85,042 | 120,218 | 155,766 | 155,766 |

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

外国債券パッシブ・マザーファンド 92,850,628千口 国内債券パッシブ・マザーファンド 107,405,246千口

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2020年2月18日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|------------------|--------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド | 千円 41,794 | % 20.0 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド | 155,766 | 74.5 |
| コール・ローン等、その他 | 11,648 | 5.5 |
| 投資信託財産総額 | 209,208 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（170,860,143千円）の投資信託財産総額（171,127,556千円）に対する比率は99.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.86円、1カナダドル=82.98円、1メキシコペソ=5.91円、1ユーロ=118.95円、1英ポンド=142.82円、1スウェーデンクローナ=11.32円、1ノルウェークローネ=11.85円、1デンマーククローネ=15.92円、1ポーランドズロチ=27.90円、1オーストラリアドル=73.55円、1シンガポールドル=79.04円、1マレーシアリンギット=26.48円、1南アフリカランド=7.32円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年2月18日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 209,208,610円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 10,617,307 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 41,794,435 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 155,766,868 |
| 未 収 入 金 | 1,030,000 |
| (B) 負 債 | 1,329,813 |
| 未 払 解 約 金 | 1,100,153 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 224,498 |
| 未 払 利 息 | 1 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,161 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 207,878,797 |
| 元 本 | 198,282,133 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 9,596,664 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 198,282,133口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 10,484円 |

※当期における期首元本額140,665,723円、期中追加設定元本額83,181,723円、期中一部解約元本額25,565,313円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2019年2月19日 至2020年2月18日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 4,883円 |
| 支 払 利 息 | △ 4,883 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,240,904 |
| 売 買 益 | 3,625,351 |
| 売 買 損 | △ 384,447 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 417,766 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 2,818,255 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,199,045 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,579,364 |
| (配 当 等 相 当 額) | (5,111,301) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (468,063) |
| (G) 計 (D + E + F) | 9,596,664 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | 9,596,664 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,579,364 |
| (配 当 等 相 当 額) | (5,166,731) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (412,633) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 4,017,300 |

※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。

※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。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(1,892,865円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,100円)、信託約款に規定される収益調整金(5,579,364円)および分配準備積立金(2,123,335円)より分配可能額は9,596,664円(1万口当たり483円)ですが、分配は行っていません。

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金(税引前) | 当 期 |
|----------------|-----|
| | 一円 |

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

第14期（2018年5月26日から2019年5月27日まで）

| | |
|------|--|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2005年6月10日） |
| 運用方針 | 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象として、NOMURA-BPI（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI(総合) | | 債券組入 比 | 純資産 総額 |
|-----------------|-----------|------|----------------------------|------|-----------|-----------|
| | 期中 騰落率 | 騰落率 | 期中 騰落率 | 騰落率 | | |
| 10期(2015年5月25日) | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 11期(2016年5月25日) | 11,956 | 2.3 | 362.06 | 2.3 | 99.4 | 296,491 |
| 12期(2017年5月25日) | 12,773 | 6.8 | 386.72 | 6.8 | 99.4 | 243,829 |
| 13期(2018年5月25日) | 12,530 | △1.9 | 379.26 | △1.9 | 99.0 | 229,268 |
| 14期(2019年5月27日) | 12,628 | 0.8 | 382.10 | 0.8 | 99.4 | 206,843 |
| | 12,860 | 1.8 | 388.97 | 1.8 | 98.7 | 165,548 |

※NOMURA-BPI（総合）は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | (ベンチマーク) NOMURA-BPI(総合) | | 債券組入 比 |
|--------------------|--------|------|----------------------------|------|-----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2018年5月25日 | 円 | % | | % | % |
| 5月末 | 12,628 | — | 382.10 | — | 99.4 |
| 6月末 | 12,642 | 0.1 | 382.50 | 0.1 | 99.4 |
| 7月末 | 12,648 | 0.2 | 382.67 | 0.1 | 99.5 |
| 8月末 | 12,626 | △0.0 | 381.98 | △0.0 | 99.5 |
| 9月末 | 12,558 | △0.6 | 379.89 | △0.6 | 99.5 |
| 10月末 | 12,527 | △0.8 | 378.99 | △0.8 | 99.6 |
| 11月末 | 12,549 | △0.6 | 379.64 | △0.6 | 99.3 |
| 12月末 | 12,602 | △0.2 | 381.24 | △0.2 | 99.4 |
| 2019年1月末 | 12,694 | 0.5 | 384.13 | 0.5 | 99.4 |
| 2月末 | 12,747 | 0.9 | 385.58 | 0.9 | 99.4 |
| 3月末 | 12,774 | 1.2 | 386.43 | 1.1 | 99.3 |
| 4月末 | 12,865 | 1.9 | 389.14 | 1.8 | 99.5 |
| (期末) 2019年5月27日 | 12,824 | 1.6 | 387.94 | 1.5 | 99.3 |
| | 12,860 | 1.8 | 388.97 | 1.8 | 98.7 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 12,628円 |
| 期末 | 12,860円 |
| 騰落率 | +1.8% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因 (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

当ファンドは、NOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指しました。

上昇要因

- ・10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下（価格は上昇）したこと

下落要因

- ・7月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇（価格は下落）したこと

▶ 投資環境について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

長期金利は、期首からしばらくは0.0%台の狭い範囲で推移しましたが、7月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度とすると、8月上旬には0.1%台前半へと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時の国債買入れオペを実施し金利上昇をけん制したため、長期金利は低下に転じました。

10月には、米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1%台半ばへ上昇する場面がありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のEU（欧州連合）離脱問題を巡る混乱が警戒されるなか、世界的な株価の下落とともに、国内長期金利は年末まで低下基調で推移しました。

年明け以降は、世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで欧米中央銀行が利上げ先送りのスタンスを示すと、海外金利の低下とともに、3月下旬には国内長期金利は一時-0.10%となるなど低下が進みました。期末にかけても、米中貿易摩擦問題への警戒が高まるなか、金利は低水準での推移が続きました。

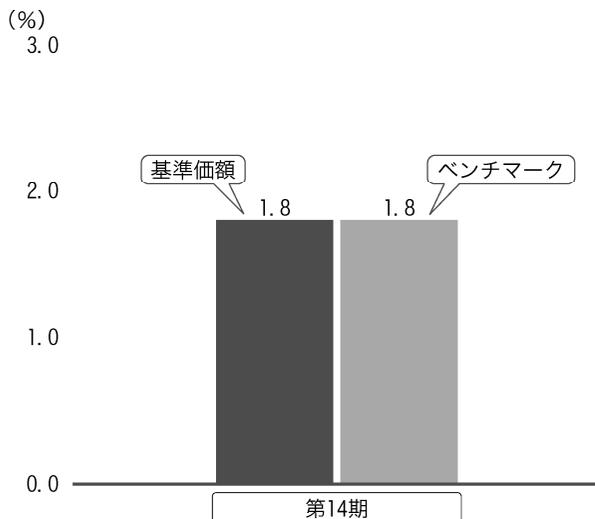
当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首の0.04%から期末には-0.07%へ低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

▶ ベンチマークとの差異について (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



当ファンドは、NOMURA-BPI (総合) をベンチマークとしています。
左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+1.8%となり、ベンチマークの騰落率+1.8%に概ね連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

債券組入比率を高位に保ち、デュレーション、残存期間別配分、種別配分、流動性などを考慮した債券に分散投資することで、NOMURA-BPI (総合) との連動をできる限り高めるように運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細(2018年5月26日から2019年5月27日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.000% (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

期中の平均基準価額は12,671円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年5月26日から2019年5月27日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|---------------------|------------|--------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 31,576,321 | 65,587,604 |
| | 地方債証券 | 1,214,805 | 7,044,159 (250,600) |
| | 特殊債証券 | 1,438,016 | 3,723,710 (1,413,736) |
| | 社債証券 (投資法人債券を含む) | 1,500,000 | 302,928 (700,000) |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等(2018年5月26日から2019年5月27日まで)

(1)利害関係人との取引状況

| 区分 | 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 35,729 | 百万円 6,876 | % 19.2 | 百万円 76,658 | 百万円 5,622 | % 7.3 |

(2)利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 買付額 | 売付額 | 期末保有額 |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 405 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-------|--------------|
| 公 社 債 | 百万円 1,300 |

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年5月26日から2019年5月27日まで)

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

■ 組入れ資産の明細(2019年5月27日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | |
|-------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|--------------------|----------------|----------------|--------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組入比率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 107,476,000 (17,585,000) | 120,966,594 (19,622,403) | 73.1 (11.9) | — (—) | 54.1 (9.0) | 18.2 (2.9) | 0.8 (—) |
| 地 方 債 証 券 | 12,000,500 (12,000,500) | 12,772,620 (12,772,620) | 7.7 (7.7) | — (—) | 3.1 (3.1) | 3.1 (3.1) | 1.5 (1.5) |
| 特 殊 債 券 (除く金融債) | 19,345,994 (19,345,994) | 20,442,309 (20,442,309) | 12.3 (12.3) | — (—) | 4.8 (4.8) | 3.4 (3.4) | 4.2 (4.2) |
| 金 融 債 券 | 1,000,000 (1,000,000) | 1,000,977 (1,000,977) | 0.6 (0.6) | — (—) | — (—) | 0.2 (0.2) | 0.4 (0.4) |
| 普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) | 8,000,000 (7,800,000) | 8,288,373 (8,084,434) | 5.0 (4.9) | — (—) | 2.1 (2.0) | 1.7 (1.7) | 1.2 (1.2) |
| 合 計 | 147,822,494 (57,731,494) | 163,470,874 (61,922,744) | 98.7 (37.4) | — (—) | 64.1 (18.9) | 26.5 (11.1) | 8.2 (7.4) |

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

| 種 類 | 銘 柄 | | 期 末 | | | |
|---------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国 債 証 券 | 第396回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 40,000 | 40,166 | 2021/1/1 |
| | 第397回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 90,000 | 90,394 | 2021/2/1 |
| | 第400回 | 利付国債(2年) | 0.1 | 100,000 | 100,502 | 2021/5/1 |
| | 第128回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 565,000 | 568,039 | 2021/6/20 |
| | 第129回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 950,000 | 955,842 | 2021/9/20 |
| | 第130回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 830,000 | 835,768 | 2021/12/20 |
| | 第131回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 140,000 | 141,066 | 2022/3/20 |
| | 第132回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 145,000 | 146,204 | 2022/6/20 |
| | 第133回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 108,000 | 108,989 | 2022/9/20 |
| | 第134回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 110,000 | 111,084 | 2022/12/20 |
| | 第135回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 190,000 | 192,004 | 2023/3/20 |
| | 第136回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 950,000 | 960,687 | 2023/6/20 |
| | 第137回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 700,000 | 708,365 | 2023/9/20 |
| | 第138回 | 利付国債(5年) | 0.1 | 500,000 | 506,325 | 2023/12/20 |
| | 第1回 | 利付国債(40年) | 2.4 | 40,000 | 60,432 | 2048/3/20 |
| | 第2回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 242,000 | 355,183 | 2049/3/20 |
| | 第3回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 225,000 | 332,896 | 2050/3/20 |
| | 第4回 | 利付国債(40年) | 2.2 | 302,000 | 450,949 | 2051/3/20 |
| | 第5回 | 利付国債(40年) | 2.0 | 295,000 | 426,334 | 2052/3/20 |
| | 第6回 | 利付国債(40年) | 1.9 | 300,000 | 427,653 | 2053/3/20 |
| | 第7回 | 利付国債(40年) | 1.7 | 345,000 | 473,364 | 2054/3/20 |
| | 第8回 | 利付国債(40年) | 1.4 | 390,000 | 499,640 | 2055/3/20 |
| | 第9回 | 利付国債(40年) | 0.4 | 551,000 | 524,893 | 2056/3/20 |
| | 第10回 | 利付国債(40年) | 0.9 | 565,000 | 632,839 | 2057/3/20 |
| | 第11回 | 利付国債(40年) | 0.8 | 460,000 | 499,173 | 2058/3/20 |
| | 第313回 | 利付国債(10年) | 1.3 | 95,000 | 97,518 | 2021/3/20 |
| | 第315回 | 利付国債(10年) | 1.2 | 1,800,000 | 1,850,652 | 2021/6/20 |
| | 第317回 | 利付国債(10年) | 1.1 | 1,005,000 | 1,034,416 | 2021/9/20 |
| | 第318回 | 利付国債(10年) | 1.0 | 895,000 | 919,120 | 2021/9/20 |
| | 第319回 | 利付国債(10年) | 1.1 | 980,000 | 1,011,918 | 2021/12/20 |
| | 第320回 | 利付国債(10年) | 1.0 | 960,000 | 988,800 | 2021/12/20 |
| | 第321回 | 利付国債(10年) | 1.0 | 960,000 | 991,718 | 2022/3/20 |
| | 第322回 | 利付国債(10年) | 0.9 | 1,065,000 | 1,097,184 | 2022/3/20 |
| | 第323回 | 利付国債(10年) | 0.9 | 310,000 | 320,211 | 2022/6/20 |
| | 第324回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 390,000 | 401,645 | 2022/6/20 |
| | 第325回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 1,365,000 | 1,409,376 | 2022/9/20 |
| | 第326回 | 利付国債(10年) | 0.7 | 77,000 | 79,416 | 2022/12/20 |
| 第327回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 375,000 | 388,113 | 2022/12/20 | |
| 第328回 | 利付国債(10年) | 0.6 | 380,000 | 391,297 | 2023/3/20 | |
| 第329回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 2,030,000 | 2,110,976 | 2023/6/20 | |
| 第330回 | 利付国債(10年) | 0.8 | 1,285,000 | 1,339,471 | 2023/9/20 | |
| 第332回 | 利付国債(10年) | 0.6 | 793,000 | 821,270 | 2023/12/20 | |
| 第333回 | 利付国債(10年) | 0.6 | 815,000 | 845,644 | 2024/3/20 | |
| 第334回 | 利付国債(10年) | 0.6 | 315,000 | 327,467 | 2024/6/20 | |
| 第335回 | 利付国債(10年) | 0.5 | 50,000 | 51,810 | 2024/9/20 | |
| 第336回 | 利付国債(10年) | 0.5 | 470,000 | 487,822 | 2024/12/20 | |
| 第337回 | 利付国債(10年) | 0.3 | 120,000 | 123,202 | 2024/12/20 | |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第338回 利付国債(10年) | 0.4 | 805,000 | 831,927 | 2025/3/20 |
| | 第339回 利付国債(10年) | 0.4 | 905,000 | 936,593 | 2025/6/20 |
| | 第340回 利付国債(10年) | 0.4 | 770,000 | 798,012 | 2025/9/20 |
| | 第341回 利付国債(10年) | 0.3 | 1,107,000 | 1,141,538 | 2025/12/20 |
| | 第342回 利付国債(10年) | 0.1 | 950,000 | 967,670 | 2026/3/20 |
| | 第343回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,110,000 | 1,131,012 | 2026/6/20 |
| | 第344回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,021,000 | 1,040,644 | 2026/9/20 |
| | 第345回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,398,000 | 1,425,274 | 2026/12/20 |
| | 第346回 利付国債(10年) | 0.1 | 990,000 | 1,009,552 | 2027/3/20 |
| | 第347回 利付国債(10年) | 0.1 | 990,000 | 1,009,374 | 2027/6/20 |
| | 第348回 利付国債(10年) | 0.1 | 665,000 | 677,854 | 2027/9/20 |
| | 第349回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,300,000 | 1,324,739 | 2027/12/20 |
| | 第350回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,330,000 | 1,354,844 | 2028/3/20 |
| | 第351回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,220,000 | 1,242,313 | 2028/6/20 |
| | 第352回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,200,000 | 1,221,408 | 2028/9/20 |
| | 第353回 利付国債(10年) | 0.1 | 1,070,000 | 1,088,553 | 2028/12/20 |
| | 第354回 利付国債(10年) | 0.1 | 135,000 | 137,266 | 2029/3/20 |
| | 第2回 利付国債(30年) | 2.4 | 510,000 | 643,456 | 2030/2/20 |
| | 第4回 利付国債(30年) | 2.9 | 300,000 | 399,894 | 2030/11/20 |
| | 第5回 利付国債(30年) | 2.2 | 290,000 | 365,542 | 2031/5/20 |
| | 第7回 利付国債(30年) | 2.3 | 474,000 | 611,123 | 2032/5/20 |
| | 第9回 利付国債(30年) | 1.4 | 100,000 | 117,712 | 2032/12/20 |
| | 第10回 利付国債(30年) | 1.1 | 585,000 | 665,595 | 2033/3/20 |
| | 第11回 利付国債(30年) | 1.7 | 430,000 | 525,408 | 2033/6/20 |
| | 第12回 利付国債(30年) | 2.1 | 590,000 | 755,465 | 2033/9/20 |
| | 第14回 利付国債(30年) | 2.4 | 742,000 | 987,468 | 2034/3/20 |
| | 第16回 利付国債(30年) | 2.5 | 465,000 | 629,535 | 2034/9/20 |
| | 第18回 利付国債(30年) | 2.3 | 450,000 | 598,500 | 2035/3/20 |
| | 第19回 利付国債(30年) | 2.3 | 490,000 | 653,189 | 2035/6/20 |
| | 第21回 利付国債(30年) | 2.3 | 345,000 | 462,272 | 2035/12/20 |
| | 第22回 利付国債(30年) | 2.5 | 315,000 | 433,184 | 2036/3/20 |
| | 第23回 利付国債(30年) | 2.5 | 329,000 | 453,480 | 2036/6/20 |
| | 第24回 利付国債(30年) | 2.5 | 310,000 | 428,606 | 2036/9/20 |
| | 第25回 利付国債(30年) | 2.3 | 300,000 | 405,522 | 2036/12/20 |
| | 第26回 利付国債(30年) | 2.4 | 363,000 | 498,202 | 2037/3/20 |
| | 第27回 利付国債(30年) | 2.5 | 440,000 | 614,455 | 2037/9/20 |
| | 第28回 利付国債(30年) | 2.5 | 386,000 | 541,546 | 2038/3/20 |
| | 第29回 利付国債(30年) | 2.4 | 177,000 | 246,208 | 2038/9/20 |
| | 第30回 利付国債(30年) | 2.3 | 472,000 | 650,345 | 2039/3/20 |
| | 第31回 利付国債(30年) | 2.2 | 395,000 | 538,704 | 2039/9/20 |
| | 第32回 利付国債(30年) | 2.3 | 420,000 | 583,963 | 2040/3/20 |
| | 第33回 利付国債(30年) | 2.0 | 613,000 | 818,489 | 2040/9/20 |
| | 第34回 利付国債(30年) | 2.2 | 477,000 | 659,156 | 2041/3/20 |
| | 第35回 利付国債(30年) | 2.0 | 465,000 | 625,750 | 2041/9/20 |
| | 第36回 利付国債(30年) | 2.0 | 240,000 | 324,336 | 2042/3/20 |
| | 第37回 利付国債(30年) | 1.9 | 640,000 | 853,830 | 2042/9/20 |
| | 第38回 利付国債(30年) | 1.8 | 375,000 | 493,425 | 2043/3/20 |
| | 第39回 利付国債(30年) | 1.9 | 260,000 | 348,665 | 2043/6/20 |
| | 第40回 利付国債(30年) | 1.8 | 295,000 | 389,538 | 2043/9/20 |
| | 第41回 利付国債(30年) | 1.7 | 335,000 | 435,325 | 2043/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第42回 利付国債(30年) | 1.7 | 345,000 | 448,762 | 2044/3/20 |
| | 第43回 利付国債(30年) | 1.7 | 315,000 | 410,148 | 2044/6/20 |
| | 第44回 利付国債(30年) | 1.7 | 415,000 | 541,504 | 2044/9/20 |
| | 第45回 利付国債(30年) | 1.5 | 415,000 | 522,082 | 2044/12/20 |
| | 第46回 利付国債(30年) | 1.5 | 435,000 | 547,586 | 2045/3/20 |
| | 第47回 利付国債(30年) | 1.6 | 360,000 | 462,506 | 2045/6/20 |
| | 第48回 利付国債(30年) | 1.4 | 425,000 | 525,559 | 2045/9/20 |
| | 第49回 利付国債(30年) | 1.4 | 395,000 | 488,674 | 2045/12/20 |
| | 第50回 利付国債(30年) | 0.8 | 505,000 | 548,596 | 2046/3/20 |
| | 第51回 利付国債(30年) | 0.3 | 520,000 | 498,175 | 2046/6/20 |
| | 第52回 利付国債(30年) | 0.5 | 503,000 | 507,265 | 2046/9/20 |
| | 第53回 利付国債(30年) | 0.6 | 197,000 | 203,497 | 2046/12/20 |
| | 第54回 利付国債(30年) | 0.8 | 160,000 | 173,412 | 2047/3/20 |
| | 第55回 利付国債(30年) | 0.8 | 425,000 | 460,912 | 2047/6/20 |
| | 第56回 利付国債(30年) | 0.8 | 430,000 | 466,038 | 2047/9/20 |
| | 第57回 利付国債(30年) | 0.8 | 590,000 | 639,029 | 2047/12/20 |
| | 第58回 利付国債(30年) | 0.8 | 590,000 | 638,592 | 2048/3/20 |
| | 第59回 利付国債(30年) | 0.7 | 400,000 | 422,444 | 2048/6/20 |
| | 第60回 利付国債(30年) | 0.9 | 420,000 | 465,931 | 2048/9/20 |
| | 第61回 利付国債(30年) | 0.7 | 355,000 | 374,248 | 2048/12/20 |
| | 第62回 利付国債(30年) | 0.5 | 70,000 | 69,909 | 2049/3/20 |
| | 第50回 利付国債(20年) | 1.9 | 918,000 | 952,443 | 2021/3/22 |
| | 第52回 利付国債(20年) | 2.1 | 720,000 | 757,936 | 2021/9/21 |
| | 第54回 利付国債(20年) | 2.2 | 965,000 | 1,023,768 | 2021/12/20 |
| | 第56回 利付国債(20年) | 2.0 | 818,000 | 872,650 | 2022/6/20 |
| | 第59回 利付国債(20年) | 1.7 | 1,455,000 | 1,552,848 | 2022/12/20 |
| | 第61回 利付国債(20年) | 1.0 | 1,215,000 | 1,269,760 | 2023/3/20 |
| | 第64回 利付国債(20年) | 1.9 | 1,025,000 | 1,117,229 | 2023/9/20 |
| | 第65回 利付国債(20年) | 1.9 | 1,020,000 | 1,117,124 | 2023/12/20 |
| | 第69回 利付国債(20年) | 2.1 | 1,020,000 | 1,132,302 | 2024/3/20 |
| | 第70回 利付国債(20年) | 2.4 | 780,000 | 882,367 | 2024/6/20 |
| | 第72回 利付国債(20年) | 2.1 | 753,000 | 844,677 | 2024/9/20 |
| | 第74回 利付国債(20年) | 2.1 | 664,000 | 748,666 | 2024/12/20 |
| | 第75回 利付国債(20年) | 2.1 | 490,000 | 555,116 | 2025/3/20 |
| | 第78回 利付国債(20年) | 1.9 | 590,000 | 664,611 | 2025/6/20 |
| | 第82回 利付国債(20年) | 2.1 | 620,000 | 709,614 | 2025/9/20 |
| | 第84回 利付国債(20年) | 2.0 | 850,000 | 972,119 | 2025/12/20 |
| | 第85回 利付国債(20年) | 2.1 | 645,000 | 745,374 | 2026/3/20 |
| | 第88回 利付国債(20年) | 2.3 | 742,000 | 872,080 | 2026/6/20 |
| | 第89回 利付国債(20年) | 2.2 | 20,000 | 23,363 | 2026/6/20 |
| | 第90回 利付国債(20年) | 2.2 | 580,000 | 680,809 | 2026/9/20 |
| | 第92回 利付国債(20年) | 2.1 | 734,000 | 860,027 | 2026/12/20 |
| | 第93回 利付国債(20年) | 2.0 | 632,000 | 738,808 | 2027/3/20 |
| | 第95回 利付国債(20年) | 2.3 | 305,000 | 365,390 | 2027/6/20 |
| | 第97回 利付国債(20年) | 2.2 | 677,000 | 808,913 | 2027/9/20 |
| | 第99回 利付国債(20年) | 2.1 | 693,000 | 825,411 | 2027/12/20 |
| | 第100回 利付国債(20年) | 2.2 | 207,000 | 249,321 | 2028/3/20 |
| | 第101回 利付国債(20年) | 2.4 | 355,000 | 433,891 | 2028/6/20 |
| | 第102回 利付国債(20年) | 2.4 | 457,000 | 561,232 | 2028/9/20 |
| | 第105回 利付国債(20年) | 2.1 | 390,000 | 470,008 | 2028/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------|-----|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第106回 利付国債(20年) | 2.2 | 370,000 | 449,379 | 2028/9/20 |
| | 第107回 利付国債(20年) | 2.1 | 378,000 | 457,198 | 2028/12/20 |
| | 第108回 利付国債(20年) | 1.9 | 390,000 | 464,201 | 2028/12/20 |
| | 第109回 利付国債(20年) | 1.9 | 340,000 | 405,966 | 2029/3/20 |
| | 第111回 利付国債(20年) | 2.2 | 386,000 | 474,077 | 2029/6/20 |
| | 第113回 利付国債(20年) | 2.1 | 427,000 | 521,917 | 2029/9/20 |
| | 第114回 利付国債(20年) | 2.1 | 383,000 | 469,703 | 2029/12/20 |
| | 第116回 利付国債(20年) | 2.2 | 380,000 | 471,652 | 2030/3/20 |
| | 第118回 利付国債(20年) | 2.0 | 200,000 | 244,658 | 2030/6/20 |
| | 第119回 利付国債(20年) | 1.8 | 365,000 | 438,408 | 2030/6/20 |
| | 第120回 利付国債(20年) | 1.6 | 280,000 | 330,108 | 2030/6/20 |
| | 第121回 利付国債(20年) | 1.9 | 255,000 | 309,995 | 2030/9/20 |
| | 第122回 利付国債(20年) | 1.8 | 380,000 | 457,653 | 2030/9/20 |
| | 第123回 利付国債(20年) | 2.1 | 230,000 | 285,689 | 2030/12/20 |
| | 第124回 利付国債(20年) | 2.0 | 330,000 | 406,088 | 2030/12/20 |
| | 第125回 利付国債(20年) | 2.2 | 275,000 | 345,842 | 2031/3/20 |
| | 第126回 利付国債(20年) | 2.0 | 180,000 | 222,125 | 2031/3/20 |
| | 第127回 利付国債(20年) | 1.9 | 145,000 | 177,224 | 2031/3/20 |
| | 第128回 利付国債(20年) | 1.9 | 265,000 | 324,757 | 2031/6/20 |
| | 第129回 利付国債(20年) | 1.8 | 230,000 | 279,098 | 2031/6/20 |
| | 第130回 利付国債(20年) | 1.8 | 135,000 | 164,216 | 2031/9/20 |
| | 第131回 利付国債(20年) | 1.7 | 640,000 | 770,662 | 2031/9/20 |
| | 第132回 利付国債(20年) | 1.7 | 680,000 | 820,603 | 2031/12/20 |
| | 第133回 利付国債(20年) | 1.8 | 160,000 | 195,081 | 2031/12/20 |
| | 第134回 利付国債(20年) | 1.8 | 50,000 | 61,099 | 2032/3/20 |
| | 第135回 利付国債(20年) | 1.7 | 205,000 | 247,898 | 2032/3/20 |
| | 第136回 利付国債(20年) | 1.6 | 100,000 | 119,654 | 2032/3/20 |
| | 第137回 利付国債(20年) | 1.7 | 245,000 | 297,077 | 2032/6/20 |
| | 第138回 利付国債(20年) | 1.5 | 25,000 | 29,666 | 2032/6/20 |
| | 第139回 利付国債(20年) | 1.6 | 80,000 | 95,968 | 2032/6/20 |
| | 第140回 利付国債(20年) | 1.7 | 600,000 | 729,018 | 2032/9/20 |
| | 第141回 利付国債(20年) | 1.7 | 460,000 | 559,994 | 2032/12/20 |
| | 第142回 利付国債(20年) | 1.8 | 230,000 | 283,084 | 2032/12/20 |
| | 第143回 利付国債(20年) | 1.6 | 290,000 | 349,734 | 2033/3/20 |
| | 第144回 利付国債(20年) | 1.5 | 180,000 | 214,621 | 2033/3/20 |
| | 第145回 利付国債(20年) | 1.7 | 445,000 | 543,736 | 2033/6/20 |
| | 第146回 利付国債(20年) | 1.7 | 275,000 | 336,622 | 2033/9/20 |
| | 第147回 利付国債(20年) | 1.6 | 590,000 | 714,991 | 2033/12/20 |
| | 第148回 利付国債(20年) | 1.5 | 284,000 | 340,535 | 2034/3/20 |
| | 第149回 利付国債(20年) | 1.5 | 715,000 | 858,443 | 2034/6/20 |
| | 第150回 利付国債(20年) | 1.4 | 541,000 | 642,237 | 2034/9/20 |
| | 第151回 利付国債(20年) | 1.2 | 790,000 | 914,764 | 2034/12/20 |
| | 第152回 利付国債(20年) | 1.2 | 570,000 | 660,396 | 2035/3/20 |
| | 第153回 利付国債(20年) | 1.3 | 457,000 | 536,906 | 2035/6/20 |
| | 第154回 利付国債(20年) | 1.2 | 560,000 | 649,499 | 2035/9/20 |
| | 第155回 利付国債(20年) | 1.0 | 570,000 | 643,108 | 2035/12/20 |
| | 第156回 利付国債(20年) | 0.4 | 630,000 | 648,383 | 2036/3/20 |
| | 第157回 利付国債(20年) | 0.2 | 565,000 | 561,751 | 2036/6/20 |
| | 第158回 利付国債(20年) | 0.5 | 545,000 | 568,554 | 2036/9/20 |
| | 第159回 利付国債(20年) | 0.6 | 553,000 | 586,058 | 2036/12/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------|-------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第160回 利付国債(20年) | 0.7 | 480,000 | 516,830 | 2037/3/20 |
| | 第161回 利付国債(20年) | 0.6 | 540,000 | 571,671 | 2037/6/20 |
| | 第162回 利付国債(20年) | 0.6 | 455,000 | 481,203 | 2037/9/20 |
| | 第163回 利付国債(20年) | 0.6 | 710,000 | 750,093 | 2037/12/20 |
| | 第164回 利付国債(20年) | 0.5 | 555,000 | 575,784 | 2038/3/20 |
| | 第165回 利付国債(20年) | 0.5 | 610,000 | 631,996 | 2038/6/20 |
| | 第166回 利付国債(20年) | 0.7 | 485,000 | 519,939 | 2038/9/20 |
| | 第167回 利付国債(20年) | 0.5 | 660,000 | 681,872 | 2038/12/20 |
| | 小 計 | - | 107,476,000 | 120,966,594 | - |
| 地方債証券 | 第1回 東京都公募公債(20年) | 1.54 | 100,000 | 106,219 | 2023/6/20 |
| | 第1回 東京都公募公債(30年) | 2.21 | 100,000 | 126,898 | 2033/6/20 |
| | 第6回 東京都公募公債(20年) | 2.0 | 100,000 | 111,462 | 2025/3/19 |
| | 第7回 東京都公募公債(20年) | 2.16 | 100,000 | 113,463 | 2025/9/19 |
| | 第8回 東京都公募公債(20年) | 2.36 | 100,000 | 115,800 | 2026/3/19 |
| | 第8回 東京都公募公債(30年) | 2.23 | 400,000 | 528,368 | 2038/9/17 |
| | 第13回 東京都公募公債(30年) | 1.93 | 500,000 | 646,445 | 2042/3/19 |
| | 第684回 東京都公募公債 | 1.26 | 100,000 | 101,322 | 2020/6/19 |
| | 第685回 東京都公募公債 | 1.13 | 100,000 | 101,185 | 2020/6/19 |
| | 第688回 東京都公募公債 | 0.94 | 193,500 | 195,847 | 2020/9/18 |
| | 第689回 東京都公募公債 | 1.08 | 200,000 | 202,794 | 2020/9/18 |
| | 第703回 東京都公募公債 | 0.99 | 100,000 | 102,514 | 2021/12/20 |
| | 第705回 東京都公募公債 | 1.06 | 100,000 | 102,950 | 2022/3/18 |
| | 第710回 東京都公募公債 | 0.81 | 100,000 | 102,452 | 2022/6/20 |
| | 平成21年度第14回 北海道公募公債 | 1.52 | 100,000 | 101,118 | 2020/2/26 |
| | 平成24年度第1回 北海道公募公債 | 0.99 | 100,000 | 102,799 | 2022/4/27 |
| | 平成24年度第14回 北海道公募公債 | 0.8 | 100,000 | 102,891 | 2023/2/28 |
| | 平成25年度第15回 北海道公募公債 | 0.67 | 100,000 | 103,041 | 2024/2/28 |
| | 平成26年度第10回 北海道公募公債(5年) | 0.147 | 200,000 | 200,112 | 2019/11/28 |
| | 平成26年度第15回 北海道公募公債 | 0.434 | 100,000 | 102,299 | 2025/2/27 |
| | 平成29年度第6回 北海道公募公債(5年) | 0.01 | 300,000 | 299,808 | 2022/7/28 |
| | 第1回 神奈川県公募公債(20年) | 2.55 | 100,000 | 112,798 | 2024/6/20 |
| | 第3回 神奈川県公募公債(20年) | 2.11 | 100,000 | 112,630 | 2025/6/20 |
| | 第7回 神奈川県公募公債(20年) | 2.22 | 100,000 | 117,023 | 2027/3/19 |
| | 第342回 大阪府公募公債(10年) | 1.2 | 200,000 | 203,126 | 2020/9/29 |
| | 第361回 大阪府公募公債(10年) | 0.92 | 200,000 | 205,490 | 2022/6/28 |
| | 第373回 大阪府公募公債(10年) | 0.904 | 100,000 | 103,565 | 2023/6/27 |
| | 第377回 大阪府公募公債(10年) | 0.729 | 100,000 | 103,090 | 2023/10/30 |
| | 平成22年度第5回 京都府公募公債 | 1.26 | 110,000 | 112,158 | 2020/12/21 |
| | 平成26年度第13回 京都府公募公債 | 0.484 | 100,000 | 102,664 | 2025/3/19 |
| | 平成27年度第4回 京都府公募公債 | 0.553 | 100,000 | 103,196 | 2025/6/19 |
| | 平成29年度第12回 京都府公募公債 | 0.04 | 300,000 | 300,339 | 2023/3/16 |
| | 第5回 兵庫県公募公債(15年) | 1.31 | 300,000 | 332,820 | 2028/5/26 |
| | 平成22年度第1回 兵庫県公募公債 | 1.46 | 100,000 | 101,268 | 2020/4/16 |
| | 第7回 静岡県公募公債(30年) | 1.988 | 100,000 | 131,520 | 2043/6/19 |
| | 平成20年度第1回 静岡県公募公債 | 2.18 | 200,000 | 227,180 | 2025/9/19 |
| | 平成21年度第10回 愛知県公募公債(10年) | 1.38 | 100,000 | 100,583 | 2019/10/30 |
| | 平成22年度第12回 愛知県公募公債(10年) | 1.085 | 100,000 | 101,624 | 2020/11/30 |
| | 平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年) | 0.01 | 200,000 | 200,000 | 2022/4/19 |
| | 平成29年度第7回 埼玉県公募公債(5年) | 0.02 | 400,000 | 400,136 | 2022/10/27 |
| | 平成21年度第8回 福岡県公募公債 | 1.34 | 100,000 | 100,770 | 2019/12/25 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|--------------------|---------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 平成25年度第11回 福岡県公募公債 | 0.694 | 100,000 | 103,250 | 2024/2/26 |
| | 平成26年度第10回 福岡県公募公債 | 0.453 | 100,000 | 102,466 | 2025/2/26 |
| | 第9回 群馬県公募公債(10年) | 0.801 | 100,000 | 102,766 | 2022/11/25 |
| | 第81回 共同発行市場公募地方債 | 1.32 | 100,000 | 100,758 | 2019/12/25 |
| | 第82回 共同発行市場公募地方債 | 1.42 | 100,000 | 100,932 | 2020/1/24 |
| | 第91回 共同発行市場公募地方債 | 0.9 | 300,000 | 303,744 | 2020/10/23 |
| | 第110回 共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 100,000 | 102,634 | 2022/5/25 |
| | 第111回 共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 300,000 | 308,118 | 2022/6/24 |
| | 第112回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 150,000 | 153,934 | 2022/7/25 |
| | 第113回 共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 102,466 | 2022/8/25 |
| | 第114回 共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 102,691 | 2022/9/22 |
| | 第115回 共同発行市場公募地方債 | 0.8 | 600,000 | 616,176 | 2022/10/25 |
| | 第118回 共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 100,000 | 103,041 | 2023/1/25 |
| | 第137回 共同発行市場公募地方債 | 0.566 | 200,000 | 205,714 | 2024/8/23 |
| | 第149回 共同発行市場公募地方債 | 0.5 | 400,000 | 411,848 | 2025/8/25 |
| | 第172回 共同発行市場公募地方債 | 0.225 | 500,000 | 507,520 | 2027/7/23 |
| | 第1回 名古屋市公募公債(20年) | 1.99 | 200,000 | 218,080 | 2023/12/20 |
| | 第3回 名古屋市公募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 112,145 | 2025/6/20 |
| | 第1回 京都市公募公債(7年) | 0.365 | 300,000 | 300,591 | 2019/12/18 |
| | 第1回 京都市公募公債(30年) | 2.57 | 100,000 | 137,377 | 2037/9/18 |
| | 第7回 京都市公募公債(20年) | 2.38 | 100,000 | 121,339 | 2028/9/21 |
| | 平成29年度第5回 京都市公募公債 | 0.04 | 100,000 | 100,114 | 2023/3/28 |
| | 平成26年度第17回 神戸市公募公債 | 0.28 | 100,000 | 101,460 | 2025/1/27 |
| | 第4回 横浜市公募公債(20年) | 2.03 | 100,000 | 111,636 | 2025/3/19 |
| | 第9回 横浜市公募公債(20年) | 2.35 | 100,000 | 116,313 | 2026/6/19 |
| | 第14回 横浜市公募公債(20年) | 2.32 | 100,000 | 119,852 | 2028/3/17 |
| | 第47回 横浜市公募公債(5年) | 0.04 | 100,000 | 100,110 | 2023/1/27 |
| | 平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年) | 0.54 | 100,000 | 102,626 | 2024/6/20 |
| | 第2回 川崎市15年公募公債 | 1.63 | 100,000 | 101,729 | 2020/6/22 |
| | 第4回 川崎市15年公募公債 | 2.11 | 100,000 | 105,390 | 2021/12/20 |
| | 平成24年度第2回 北九州市公募公債 | 0.715 | 100,000 | 102,525 | 2022/12/26 |
| | 平成23年度第9回 福岡市公募公債 | 1.01 | 147,000 | 151,168 | 2022/3/28 |
| | 平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年) | 0.04 | 300,000 | 300,339 | 2023/3/16 |
| | 小 計 | - | 12,000,500 | 12,772,620 | - |
| 特 殊 債 券 (除く金融債) | 第340回 政府保証道路債券 | 1.7 | 100,000 | 101,591 | 2020/4/28 |
| | 第14回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.199 | 200,000 | 200,472 | 2020/6/18 |
| | 第16回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 301,000 | 305,015 | 2020/9/14 |
| | 第3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.82 | 12,876 | 13,253 | 2036/5/10 |
| | 第4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 15,482 | 16,308 | 2042/8/10 |
| | 第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 13,424 | 13,822 | 2036/11/10 |
| | 第6回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.94 | 20,510 | 20,620 | 2037/6/10 |
| | 第7回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.0 | 17,022 | 17,991 | 2038/11/10 |
| | 第8回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 10,313 | 10,358 | 2037/10/10 |
| | 第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 29,074 | 30,487 | 2037/5/10 |
| | 第9回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.24 | 17,123 | 18,255 | 2039/5/10 |
| | 第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 44,967 | 47,183 | 2037/5/10 |
| | 第10回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.09 | 16,736 | 17,695 | 2039/11/10 |
| | 第11回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.12 | 17,992 | 19,158 | 2040/5/10 |
| | 第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 11,611 | 11,818 | 2038/9/10 |
| | 第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.7 | 15,977 | 16,322 | 2032/5/10 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------|--------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| 第17回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.71 | 37,218 | 38,302 | 2032/11/10 |
| 第19回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.15 | 21,971 | 23,501 | 2043/11/10 |
| 第24回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.34 | 45,428 | 49,014 | 2044/5/10 |
| 第26回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.14 | 71,601 | 77,009 | 2044/7/10 |
| 第27回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.05 | 25,852 | 27,817 | 2044/8/10 |
| 第28回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.98 | 28,514 | 30,657 | 2044/9/10 |
| 第29回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.81 | 14,159 | 14,638 | 2040/4/10 |
| 第29回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.95 | 30,921 | 33,384 | 2044/10/10 |
| 第30回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.97 | 30,415 | 32,820 | 2044/11/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 15,892 | 16,514 | 2040/7/10 |
| 第32回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.82 | 59,896 | 64,145 | 2045/1/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.79 | 16,663 | 17,437 | 2040/10/10 |
| 第35回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 33,133 | 35,483 | 2045/4/10 |
| 第36回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 33,307 | 35,525 | 2045/5/10 |
| 第39回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 14,914 | 15,519 | 2041/2/10 |
| 第41回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 16,291 | 17,207 | 2041/4/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.28 | 30,814 | 32,564 | 2041/6/10 |
| 第43回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 43,613 | 46,564 | 2045/12/10 |
| 第46回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.85 | 36,051 | 38,658 | 2046/3/10 |
| 第48回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 67,566 | 72,373 | 2046/5/10 |
| 第49回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 33,471 | 35,700 | 2046/6/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 14,619 | 15,385 | 2042/2/10 |
| 第51回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 73,514 | 78,337 | 2046/8/10 |
| 第52回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 2.01 | 100,000 | 120,116 | 2030/7/16 |
| 第53回 | 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 15,365 | 16,147 | 2042/4/10 |
| 第55回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.41 | 96,054 | 101,981 | 2046/12/10 |
| 第57回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 45,757 | 48,597 | 2047/2/10 |
| 第58回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 48,302 | 51,275 | 2047/3/10 |
| 第59回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 93,734 | 99,628 | 2047/4/10 |
| 第60回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 146,409 | 155,091 | 2047/5/10 |
| 第61回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 47,217 | 49,824 | 2047/6/10 |
| 第67回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.09 | 52,957 | 55,490 | 2047/12/10 |
| 第69回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.28 | 108,036 | 114,218 | 2048/2/10 |
| 第70回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 95,450 | 100,507 | 2048/3/10 |
| 第73回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 53,575 | 56,760 | 2048/6/10 |
| 第95回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.065 | 100,000 | 102,934 | 2022/3/18 |
| 第99回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 77,377 | 80,477 | 2050/8/10 |
| 第123回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 93,010 | 94,390 | 2052/8/10 |
| 第124回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 93,137 | 94,282 | 2052/9/10 |
| 第125回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 93,337 | 94,517 | 2052/10/10 |
| 第127回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 94,425 | 95,465 | 2052/12/10 |
| 第128回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 94,339 | 95,555 | 2053/1/10 |
| 第129回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 95,061 | 96,547 | 2053/2/10 |
| 第130回 | 一般担保住宅金融支援機構債券 | 1.763 | 200,000 | 239,716 | 2032/12/20 |
| 第137回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 97,784 | 99,393 | 2053/10/10 |
| 第1回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 29,628 | 30,937 | 2042/5/10 |
| 第2回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 32,174 | 33,848 | 2042/6/10 |
| 第3回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.09 | 15,832 | 16,676 | 2037/11/10 |
| 第6回 | 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 15,230 | 15,974 | 2042/10/10 |
| 第5回 | 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.96 | 32,874 | 34,696 | 2038/11/10 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 第7回 道路債券 | 2.7 | 100,000 | 108,145 | 2022/6/20 |
| | 第9回 道路債券 | 2.9 | 100,000 | 133,572 | 2032/5/20 |
| | 第42回 道路債券 | 2.22 | 100,000 | 112,456 | 2025/3/21 |
| | 第11回 地方公共団体金融機構債券 | 1.465 | 100,000 | 101,319 | 2020/4/28 |
| | 第15回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 200,000 | 202,492 | 2020/8/14 |
| | 第18回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.9 | 500,000 | 506,855 | 2020/11/17 |
| | 第18回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.001 | 800,000 | 800,744 | 2022/5/30 |
| | 第26回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.1 | 300,000 | 307,248 | 2021/7/16 |
| | 第27回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 200,000 | 204,562 | 2021/8/13 |
| | 第42回 地方公共団体金融機構債券 | 0.801 | 100,000 | 102,737 | 2022/11/28 |
| | 第45回 地方公共団体金融機構債券 | 0.791 | 200,000 | 205,792 | 2023/2/28 |
| | 第61回 地方公共団体金融機構債券 | 0.69 | 100,000 | 103,243 | 2024/6/28 |
| | 第63回 地方公共団体金融機構債券 | 0.581 | 100,000 | 102,781 | 2024/8/28 |
| | 第65回 地方公共団体金融機構債券 | 0.535 | 100,000 | 102,622 | 2024/10/28 |
| | 第67回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.466 | 100,000 | 102,670 | 2024/12/13 |
| | 第51回 政府保証関西国際空港債券 | 2.1 | 100,000 | 106,956 | 2022/8/31 |
| | 第3回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 2.1 | 200,000 | 219,458 | 2023/12/18 |
| | 第9回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 1.0 | 100,000 | 101,334 | 2020/9/14 |
| | 第15回 政府保証日本政策投資銀行債券 | 2.0 | 100,000 | 105,224 | 2021/12/22 |
| | 第20回 政府保証日本政策投資銀行債券 | 2.0 | 100,000 | 107,243 | 2022/12/19 |
| | 第27回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 0.11 | 100,000 | 100,240 | 2021/2/12 |
| | 第34回 政府保証日本政策投資銀行社債 | 0.001 | 300,000 | 300,285 | 2022/6/30 |
| | 第2回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.8 | 300,000 | 308,712 | 2020/12/27 |
| | 第9回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.9 | 100,000 | 103,534 | 2021/3/26 |
| | 第81回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1 | 200,000 | 240,970 | 2029/5/31 |
| | 第88回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.3 | 100,000 | 135,363 | 2039/8/31 |
| | 第89回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.3 | 751,000 | 754,424 | 2019/9/30 |
| | 第90回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1 | 300,000 | 362,901 | 2029/9/28 |
| | 第98回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.3 | 159,000 | 160,437 | 2020/1/31 |
| | 第99回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.2 | 100,000 | 122,457 | 2030/1/31 |
| | 第103回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.3 | 1,500,000 | 1,516,155 | 2020/3/19 |
| | 第104回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.4 | 300,000 | 303,966 | 2020/4/30 |
| | 第120回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.9 | 100,000 | 101,323 | 2020/10/30 |
| | 第137回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.2 | 1,000,000 | 1,025,750 | 2021/6/30 |
| | 第147回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.0 | 100,000 | 102,498 | 2021/10/29 |
| | 第152回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.1 | 300,000 | 308,778 | 2021/12/28 |
| | 第227回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.544 | 200,000 | 205,980 | 2024/9/30 |
| | 第231回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.495 | 300,000 | 308,433 | 2024/11/29 |
| | 第8回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 129,000 | 130,113 | 2020/1/20 |
| | 第203回 政府保証預金保険機構債 | 0.1 | 300,000 | 300,240 | 2020/1/17 |
| | 第208回 政府保証預金保険機構債 | 0.1 | 600,000 | 601,026 | 2020/10/6 |
| | 第209回 政府保証預金保険機構債 | 0.1 | 600,000 | 601,194 | 2020/12/11 |
| | 第20回 西日本高速道路社債 | 0.759 | 100,000 | 103,054 | 2023/9/20 |
| | 第332回 東京交通債券 | 2.65 | 100,000 | 101,335 | 2019/11/29 |
| | 第342回 東京交通債券 | 2.4 | 100,000 | 107,298 | 2022/6/21 |
| | 第36回 日本政策投資銀行債券 | 2.23 | 100,000 | 117,239 | 2027/5/28 |
| | 第8回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.45 | 100,000 | 116,017 | 2026/3/19 |
| | 第18回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.87 | 100,000 | 155,186 | 2046/12/20 |
| | 第22回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.67 | 300,000 | 451,305 | 2047/3/20 |
| | 第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.41 | 200,000 | 244,694 | 2029/4/20 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-------------------------|-------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第107回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.935 | 300,000 | 311,151 | 2023/6/20 |
| | 第120回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.751 | 100,000 | 103,335 | 2023/12/20 |
| | 第2回 地方公営企業等金融機構債券(20年) | 2.29 | 100,000 | 121,332 | 2029/4/27 |
| | 第3回 公営企業債券(20年) | 1.03 | 100,000 | 103,854 | 2023/3/22 |
| | 第5回 公営企業債券(20年) | 2.11 | 100,000 | 109,017 | 2023/9/20 |
| | 第11回 公営企業債券(20年) | 2.11 | 100,000 | 111,965 | 2025/3/24 |
| | 第16回 公営企業債券(20年) | 2.1 | 100,000 | 113,415 | 2025/12/19 |
| | 第17回 公営企業債券(20年) | 2.39 | 100,000 | 115,642 | 2026/3/24 |
| | 第18回 公営企業債券(20年) | 2.58 | 100,000 | 117,602 | 2026/6/19 |
| | 第22回 公営企業債券(20年) | 2.32 | 100,000 | 118,084 | 2027/6/18 |
| | 第24回 公営企業債券(20年) | 2.29 | 200,000 | 239,016 | 2028/4/25 |
| | 第44回 地方公共団体金融機構債券 | 0.791 | 300,000 | 308,484 | 2023/1/27 |
| | 第62回 地方公共団体金融機構債券 | 0.631 | 400,000 | 411,956 | 2024/7/26 |
| | 第15回 首都高速道路 | 0.21 | 100,000 | 100,196 | 2020/9/18 |
| | 第7回 本州四国連絡橋債券 | 2.26 | 100,000 | 113,161 | 2025/6/20 |
| | 第12回 国際協力機構債券 | 0.901 | 100,000 | 102,699 | 2022/6/20 |
| | 第28回 東日本高速道路 | 0.248 | 100,000 | 100,124 | 2019/12/20 |
| | 第35回 東日本高速道路 | 0.1 | 200,000 | 200,182 | 2021/3/19 |
| | 第45回 中日本高速道路 | 0.904 | 100,000 | 102,828 | 2022/9/20 |
| | 第22回 西日本高速道路 | 0.744 | 100,000 | 103,330 | 2024/3/19 |
| | 第23回 西日本高速道路 | 0.602 | 100,000 | 102,602 | 2024/6/20 |
| | 小 計 | - | 19,345,994 | 20,442,309 | - |
| 金 融 債 券 | い第810号 農林債 | 0.1 | 300,000 | 300,522 | 2022/11/25 |
| | 第297回 信金中金債(5年) | 0.2 | 200,000 | 200,088 | 2019/8/27 |
| | 第301回 信金中金債(5年) | 0.225 | 300,000 | 300,369 | 2019/12/27 |
| | 第197号 商工債(3年) | 0.02 | 200,000 | 199,998 | 2019/6/27 |
| | 小 計 | - | 1,000,000 | 1,000,977 | - |
| 普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) | 第528回 東京電力 | 1.905 | 100,000 | 100,085 | 2019/6/13 |
| | 第537回 東京電力 | 1.814 | 100,000 | 101,215 | 2020/2/28 |
| | 第547回 東京電力 | 1.948 | 100,000 | 101,944 | 2020/7/24 |
| | 第507回 中部電力 | 0.605 | 100,000 | 102,058 | 2026/1/23 |
| | 第518回 中部電力 | 0.19 | 100,000 | 100,091 | 2023/1/25 |
| | 第512回 関西電力 | 0.32 | 100,000 | 100,293 | 2024/10/25 |
| | 第527回 関西電力 | 0.28 | 100,000 | 100,167 | 2024/4/25 |
| | 第308回 北陸電力 | 0.769 | 100,000 | 102,703 | 2024/9/25 |
| | 第471回 東北電力 | 1.168 | 100,000 | 104,322 | 2023/12/25 |
| | 第472回 東北電力 | 0.954 | 100,000 | 103,422 | 2024/2/23 |
| | 第476回 東北電力 | 0.57 | 100,000 | 101,492 | 2025/1/24 |
| | 第508回 東北電力 | 0.465 | 200,000 | 201,332 | 2029/4/25 |
| | 第253回 四国電力 | 1.0 | 100,000 | 103,274 | 2023/6/23 |
| | 第328回 北海道電力 | 0.42 | 100,000 | 100,635 | 2023/1/25 |
| | 第13回 大和ハウス工業 | 0.285 | 100,000 | 100,598 | 2027/6/1 |
| | 第10回 アサヒグループホールディングス | 0.17 | 100,000 | 100,087 | 2022/6/13 |
| | 第9回 セブン&アイ・ホールディングス | 0.671 | 100,000 | 102,023 | 2023/3/20 |
| | 第30回 東レ | 0.375 | 100,000 | 100,875 | 2027/7/16 |
| | 第7回 クラレ | 0.19 | 100,000 | 100,188 | 2025/4/25 |
| | 第56回 住友化学 | 0.38 | 200,000 | 200,982 | 2027/9/13 |
| | 第47回 三井化学 | 0.26 | 100,000 | 100,072 | 2025/6/19 |
| | 第24回 三菱ケミカルホールディングス | 0.37 | 100,000 | 100,602 | 2028/2/25 |
| | 第13回 プリチソン | 0.23 | 100,000 | 99,974 | 2026/4/17 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|----------------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 第3回 新日鐵住金 | 0.22 | 100,000 | 100,163 | 2024/5/20 |
| | 第8回 ジェイテクト | 0.25 | 100,000 | 100,070 | 2025/3/7 |
| | 第16回 日立製作所 | 0.813 | 100,000 | 103,064 | 2023/12/13 |
| | 第12回 パナソニック | 0.387 | 200,000 | 200,504 | 2020/3/19 |
| | 第13回 パナソニック | 0.568 | 200,000 | 202,388 | 2022/3/18 |
| | 第1回 明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債 | 0.51 | 100,000 | 100,047 | 2019/8/7 |
| | 第1回 ユニー・ファミリーマートホールディングス | 0.14 | 100,000 | 100,133 | 2022/2/22 |
| | 第63回 三井物産 | 2.37 | 100,000 | 116,984 | 2027/4/23 |
| | 第47回 住友商事 | 0.858 | 100,000 | 102,999 | 2023/10/23 |
| | 第69回 クレディセゾン | 0.18 | 100,000 | 99,847 | 2023/6/19 |
| | 第8回 みずほコーポレート銀行 | 2.54 | 100,000 | 118,576 | 2027/7/27 |
| | 第25回 三菱東京UFJ銀行 | 1.31 | 300,000 | 305,292 | 2020/11/12 |
| | 第110回 三菱東京UFJ銀行 | 1.485 | 100,000 | 100,568 | 2019/10/16 |
| | 第1回 三井住友フィナンシャル | 0.849 | 100,000 | 102,158 | 2024/9/12 |
| | 第4回 りそな銀行 | 2.766 | 100,000 | 100,173 | 2019/6/20 |
| | 第9回 三菱UFJ信託銀行 | 1.68 | 100,000 | 102,967 | 2021/4/28 |
| | 第8回 住友信託銀行 | 2.49 | 100,000 | 115,807 | 2027/5/10 |
| | 第1回 みずほフィナンシャルグループ | 0.95 | 100,000 | 102,294 | 2024/7/16 |
| | 第20回 三井住友銀行 | 2.21 | 200,000 | 200,668 | 2019/7/24 |
| | 第24回 三井住友銀行 | 1.6 | 100,000 | 102,939 | 2021/6/1 |
| | 第9回 みずほ銀行 | 2.52 | 100,000 | 115,969 | 2027/4/27 |
| | 第50回 日産フィナンシャルサービス | 0.1 | 100,000 | 99,690 | 2021/12/20 |
| | 第17回 トヨタファイナンス | 1.91 | 100,000 | 102,426 | 2020/9/18 |
| | 第54回 トヨタファイナンス | 0.508 | 100,000 | 100,480 | 2020/6/19 |
| | 第83回 トヨタファイナンス | 0.08 | 100,000 | 100,019 | 2023/4/24 |
| | 第70回 日立キャピタル | 0.2 | 100,000 | 100,080 | 2022/12/20 |
| | 第1回 野村ホールディングス | 0.3 | 100,000 | 100,009 | 2023/9/4 |
| | 第21回 野村ホールディングス | 1.86 | 100,000 | 101,432 | 2020/3/17 |
| | 第58回 三井不動産 | 0.1 | 100,000 | 99,934 | 2023/2/24 |
| | 第58回 三菱地所 | 2.9 | 100,000 | 131,177 | 2032/5/20 |
| | 第38回 京王電鉄 | 0.295 | 100,000 | 100,800 | 2027/11/29 |
| | 第15回 東日本旅客鉄道 | 2.65 | 100,000 | 103,271 | 2020/8/25 |
| | 第34回 東日本旅客鉄道 | 2.53 | 100,000 | 112,355 | 2024/6/20 |
| | 第110回 東日本旅客鉄道 | 1.76 | 100,000 | 125,647 | 2045/7/28 |
| | 第41回 東海旅客鉄道 | 2.166 | 100,000 | 118,666 | 2029/1/29 |
| | 第42回 東海旅客鉄道 | 2.312 | 200,000 | 240,936 | 2029/4/24 |
| | 第27回 KDDI | 0.23 | 100,000 | 100,178 | 2026/4/24 |
| | 第11回 電源開発 | 2.05 | 100,000 | 109,978 | 2025/3/19 |
| | 第24回 東京電力パワーグリッド | 0.61 | 200,000 | 200,650 | 2024/4/24 |
| | 第18回 大阪瓦斯 | 1.47 | 200,000 | 210,224 | 2022/12/20 |
| | 第27回 東邦瓦斯 | 1.12 | 100,000 | 104,112 | 2023/3/20 |
| | 第4回 ファーストリテイリング | 0.749 | 100,000 | 103,132 | 2025/12/18 |
| | 第7回 ファーストリテイリング | 0.405 | 100,000 | 100,573 | 2028/6/6 |
| | 第2回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20) | 0.645 | 200,000 | 200,168 | 2023/7/12 |
| | 第11回 ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債 | 0.3 | 200,000 | 200,392 | 2021/1/22 |
| | 小 計 | — | 8,000,000 | 8,288,373 | — |
| | 合 計 | — | 147,822,494 | 163,470,874 | — |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2019年5月27日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 163,470,874 | 98.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,817,662 | 1.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 166,288,536 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年5月27日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 166,288,536,967円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 886,480,851 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 163,470,874,889 |
| 未 収 入 金 | 1,433,502,650 |
| 未 収 利 息 | 493,145,413 |
| 前 払 費 用 | 4,533,164 |
| (B) 負 債 | 739,539,609 |
| 未 払 解 約 金 | 739,497,801 |
| 未 払 利 息 | 901 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 40,907 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 165,548,997,358 |
| 元 本 | 128,728,886,975 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 36,820,110,383 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 128,728,886,975口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 12,860円 |

※当期における期首元本額163,796,330,040円、期中追加設定元本額18,991,205,023円、期中一部解約元本額54,058,648,088円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

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

■ 損益の状況

(自2018年5月26日 至2019年5月27日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------------|------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,031,762,455円 |
| 受 取 利 息 | 2,032,287,838 |
| 支 払 利 息 | △ 525,383 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,218,113,376 |
| 売 買 損 益 | 2,203,039,987 |
| 売 買 損 益 | △ 984,926,611 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 607,593 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 3,249,268,238 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 43,046,958,058 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,112,264,943 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △14,588,380,856 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 36,820,110,383 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 36,820,110,383 |

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※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。

■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|---------------------------------|-----------------|---|-----------------|
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 4,544,382,925円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 112,648,590円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 7,764,734,486円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 2,014,357,930円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 1,670,199,620円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,167,297,178円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 690,559,127円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,802,135,470円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ） | 49,679,212円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 10,589,912,942円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ） | 168,403,515円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 3,063,620円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ） | 310,024,681円 | 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 2,148,625,775円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ） | 271,423,917円 | 三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 9,593,375,639円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ） | 103,009,207円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 510,755,318円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ） | 209,045,221円 | SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 224,809,413円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型） | 90,014,140円 | 三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 7,679,220,975円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 2,427,872,977円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 919,958,791円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 643,158,344円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 186,847,552円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 33,591,719円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 44,401,846円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050 | 10,423,988円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,996,661,678円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） | 36,601,395円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,502,256,041円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） | 13,811,555円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 2,365,436,017円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） | 7,776,181円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 1,012,950,975円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） | 3,623,027円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 244,033,609円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） | 4,896,557円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 18,430,319円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 26,417,100円 | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 354,495,506円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 5,800,435,855円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 6,233,010,024円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 18,018,659,061円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 301,457,933円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 7,267,490,683円 | SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 142,628,061円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 17,716,923,693円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 1,365,633,107円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 351,415,849円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定> | 654,311,594円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 578,749,942円 | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 1,624,886,083円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 2,668,525円 | SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定> | 1,846,803,949円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 252,488,538円 | | |

■ お知らせ

<約款変更について>

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)

外国債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

| | |
|------|--|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2003年12月18日） |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・ 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |

■ 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 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|-------------|-----------|-----------------------------------|-----------|----------------|
| | | 期 騰 落 率 | F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | | |
| 12期 (2015年12月17日) | 円 18,044 | % △1.6 | 182.96 | % 98.5 | 百万円 198,255 |
| 13期 (2016年12月19日) | 17,116 | △5.1 | 172.59 | 98.4 | 180,203 |
| 14期 (2017年12月18日) | 17,897 | 4.6 | 181.01 | 98.9 | 196,212 |
| 15期 (2018年12月17日) | 17,553 | △1.9 | 177.36 | 98.7 | 168,894 |
| 16期 (2019年12月17日) | 18,248 | 4.0 | 184.64 | 98.6 | 171,892 |

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、前日の指数を当日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、設定時を100として2019年12月17日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

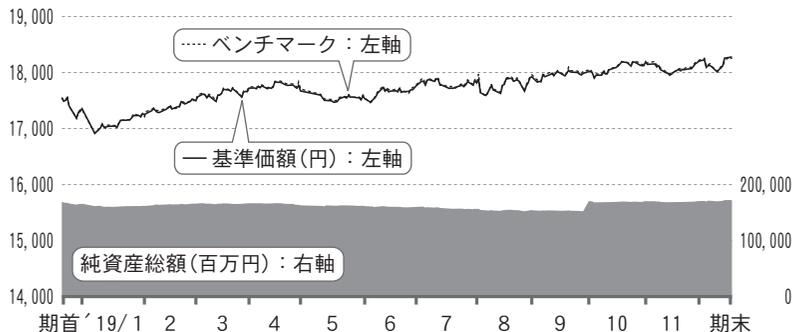
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | (ベンチマーク) | | 債 券 組 入 率 |
|----------------------|-------------|----------|-----------------------------------|--------------|
| | | 騰 落 率 | F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | |
| (期 首) 2018年12月17日 | 円 17,553 | % — | 177.36 | % 98.7 |
| 12月末 | 17,355 | △1.1 | 175.20 | △1.2 98.7 |
| 2019年 1 月末 | 17,249 | △1.7 | 173.91 | △1.9 98.8 |
| 2 月末 | 17,495 | △0.3 | 176.93 | △0.2 98.2 |
| 3 月末 | 17,722 | 1.0 | 179.31 | 1.1 98.8 |
| 4 月末 | 17,671 | 0.7 | 178.91 | 0.9 98.4 |
| 5 月末 | 17,533 | △0.1 | 177.32 | △0.0 98.9 |
| 6 月末 | 17,763 | 1.2 | 179.64 | 1.3 99.1 |
| 7 月末 | 17,814 | 1.5 | 180.05 | 1.5 98.8 |
| 8 月末 | 17,925 | 2.1 | 181.49 | 2.3 98.8 |
| 9 月末 | 18,017 | 2.6 | 182.32 | 2.8 98.5 |
| 10 月末 | 18,192 | 3.6 | 183.72 | 3.6 98.1 |
| 11 月末 | 18,202 | 3.7 | 184.08 | 3.8 98.5 |
| (期 末) 2019年12月17日 | 18,248 | 4.0 | 184.64 | 4.1 98.6 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 17,553円 |
| 期末 | 18,248円 |
| 騰落率 | +4.0% |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債に分散投資し、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）に対し、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間）等を可能な限り近似させることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | ・FRB（米連邦準備制度理事会）が保険的な利下げを実施するなど、ハト派（景気を重視する立場）的な金融政策に転換したことにより、米国金利が低下したこと |
| 下落要因 | ・景気見通しに対する不透明感や投資家のリスク回避的な姿勢などから、円が対ドルや対ユーロで上昇したこと |

▶ 投資環境について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州（ドイツ）ともに低下（債券価格は上昇）しました。為替市場では、米ドルやユーロは対円で下落しました。

債券市場

米国では、期初からもみ合い推移が続いた後、2019年3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の見通しが大幅に引き下げられると、年内の利下げを織り込む形で金利が低下しました。その後、5月にトランプ大統領が中国に対する関税引上げを実施し、8月にも中国に対する追加関税が発表されるなど、米中通商摩擦に対する不透明感から金利は大きく低下しました。7月末にグローバルな景気見通しの悪化を受けてFRBが保険的な利下げを実施したことも、金利低下要因になりました。その後、米中協議の再開を受けて、米中間の対立先鋭化に対する警戒感が後退し、10月に金利は上昇に転じ、期末まで上昇基調で推移しました。

欧州では、域内の経済指標の低迷や、ECB（欧州中央銀行）が金利据え置き期間を長期化するなどハト派的な姿勢を示したことから、期首から8月にかけて金利低下が進行しました。ECBは9月に政策金利の引下げと量的緩和を含む金融緩和策を発表しました。ドイツの財政支出拡大観測や米中通商協議の進展に対する期待から、9月以降、金利は上昇に転じ、期末にかけて上昇傾向が続きました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.89%から期末1.87%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.25%から期末-0.28%へと低下しました。

為替市場

米ドル・円は、期初は株式市場の下落を受けてリスク回避の動きが強まるなか、円高が進行しましたが、2019年1月中旬以降は、米国の利上げ停止観測などを受けたリスク選好度の改善とともに、米ドルが反発しました。5月以降は、米中通商協議に対する警戒感が高まると、円が強含みで推移しました。10月から期末にかけては、米国金利の上昇に連れて米ドル高・円安基調となりました。

ユーロ・円は、期初から8月にかけて、投資家のリスク回避姿勢の強まりと欧州景気の低迷から、円高傾向となりました。その後は英国のEU（欧州連合）からの離脱交渉が進展するなどリスク選好度の改善とともにユーロが反発に転じ、期末までユーロ高・円安となりました。

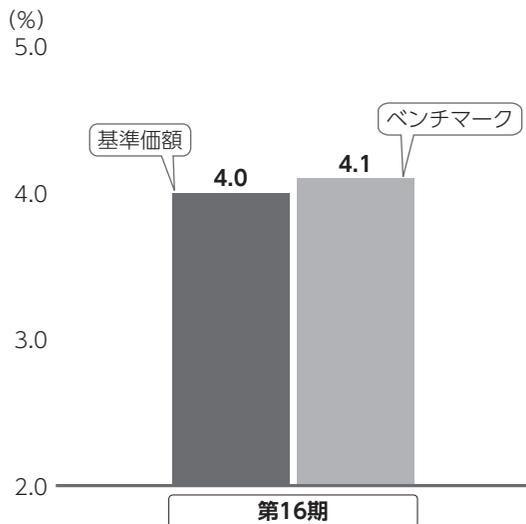
当期の米ドル・円は、期首113円47銭から期末109円56銭と3円91銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首128円28銭から期末122円01銭と6円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

F T S E世界国債インデックス (除く日本、円ベース) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値 (通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等) をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス (投資配分比率の調整) を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+4.0%となり、ベンチマークの騰落率+4.1%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・カストディフィーやポートフォリオの維持のための売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

米国では、景気に底入れの兆候が見られるものの、FRBは慎重なスタンスを継続する見通しです。インフレ環境が抑制されていることから、長期金利は低位での推移を予想します。ユーロ圏でも、景気の底入れが見込まれる一方で、低インフレ環境やECBの緩和政策が続くことから、金利は低位での推移を予想します。

為替相場は、米ドル・円では、日米金利差は米ドルの支援材料ですが、FRBの慎重な姿勢を背景にレンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しても、米国、ユーロ圏ともに慎重な金融政策が継続することから、レンジ相場を予想します。

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、通貨・国別配分、満期構成、デュレーション等を可能な限りベンチマークに近似させるよう運用を行います。また月次のベンチマークの構成銘柄の更新や、日々の資金流出入に対応し、迅速なリバランスを行います。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---------------|-----|---------|--|
| (a) そ の 他 費 用 | 7円 | 0.038% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| （保 管 費 用） | (7) | (0.037) | |
| （そ の 他） | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 7 | 0.038 | |

期中の平均基準価額は17,744円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|-------------|---------|----------------------|----------------------|
| 外 | ア メ リ カ | 国 債 証 券 | 千米ドル 237,118 | 千米ドル 211,041 |
| | カ ナ ダ | 国 債 証 券 | 千カナダドル 14,012 | 千カナダドル 15,881 |
| | メ キ シ コ | 国 債 証 券 | 千メキシコペソ 89,136 | 千メキシコペソ 89,554 |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ド イ ツ | 国 債 証 券 | 20,446 | 30,435 |
| | イ タ リ ア | 国 債 証 券 | 30,062 | 31,992 |
| | フ ラ ン ス | 国 債 証 券 | 41,083 | 35,251 |
| | オ ラ ン ダ | 国 債 証 券 | 4,653 | 6,453 |
| | ス ペ イ ン | 国 債 証 券 | 16,882 | 22,494 |
| | ベルギー | 国 債 証 券 | 6,308 | 5,023 |
| | オーストリア | 国 債 証 券 | 4,238 | 3,509 |
| | フィンランド | 国 債 証 券 | 2,223 | 725 |
| アイルランド | 国 債 証 券 | 1,637 | 2,094 | |
| 国 | イ ギ リ ス | 国 債 証 券 | 千英ポンド 17,673 | 千英ポンド 22,451 |
| | ス ウ ェ ー デ ン | 国 債 証 券 | 千スウェーデンクローナ 7,478 | 千スウェーデンクローナ 7,012 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|---------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | ノ ル ウ ェ ー | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ 4,912 | 千ノルウェークローネ 3,486 |
| | デ ン マ ー ク | 国 債 証 券 | 千デンマーククローネ 7,725 | 千デンマーククローネ 8,503 |
| | ポ ー ラ ン ド | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ 6,066 | 千ポーランドズロチ 6,826 |
| | オ ー ス ト ラ リ ア | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル 6,849 | 千オーストラリアドル 8,893 |
| 国 | シ ン ガ ポ ー ル | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル 2,281 | 千シンガポールドル 1,898 |
| | マ レ ー シ ア | 国 債 証 券 | 千マレーシアリンギット 10,439 | 千マレーシアリンギット 10,746 |
| | 南 ア フ リ カ | 国 債 証 券 | 千南アフリカランド 24,197 | 千南アフリカランド 17,148 |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2019年12月17日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分 | 額 面 金 額 | 期 | | 組 入 比 率 | う ち B B 格 以 下 組 入 比 率 | 末 | | |
|---------|------------------|------------------|------------------|-----------|--------------------------|-------------------|-----------|----------|
| | | 評 価 額 | | | | 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 711,170 | 千米ドル 741,288 | 千円 81,215,588 | % 47.2 | % - | % 20.2 | % 17.2 | % 9.8 |
| カ ナ ダ | 千カナダドル 35,500 | 千カナダドル 38,573 | 3,209,295 | 1.9 | - | 0.9 | 0.7 | 0.3 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | | |
|---------------|-----------------------|-----------------------|-------------|---------|--------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| メ キ シ コ | 千メキシコペソ 241,000 | 千メキシコペソ 257,176 | 1,486,478 | 0.9 | — | 0.5 | 0.4 | — |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ド イ ツ | 63,000 | 78,385 | 9,563,778 | 5.6 | — | 3.9 | 1.2 | 0.5 |
| イ タ リ ア | 109,120 | 125,910 | 15,362,296 | 8.9 | — | 5.1 | 2.7 | 1.1 |
| フ ラ ン ス | 117,270 | 140,636 | 17,159,073 | 10.0 | — | 6.6 | 2.4 | 1.0 |
| オ ラ ン ダ | 21,400 | 25,565 | 3,119,239 | 1.8 | — | 1.1 | 0.6 | 0.1 |
| ス ペ イ ン | 61,550 | 75,673 | 9,232,969 | 5.4 | — | 3.5 | 1.4 | 0.4 |
| ベ ル ギ ー | 27,450 | 34,658 | 4,228,633 | 2.5 | — | 1.7 | 0.4 | 0.3 |
| オ ー ス ト リ ア | 17,750 | 21,765 | 2,655,644 | 1.5 | — | 1.1 | 0.4 | 0.1 |
| フ ィ ン ラ ン ド | 9,000 | 10,106 | 1,233,111 | 0.7 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| ア イ ル ラ ン ド | 9,200 | 10,745 | 1,311,063 | 0.8 | — | 0.6 | 0.2 | — |
| イ ギ リ ス | 千英ポンド 58,020 | 千英ポンド 75,864 | 11,035,227 | 6.4 | — | 5.1 | 1.1 | 0.3 |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデンクローナ 43,800 | 千スウェーデンクローナ 49,622 | 580,091 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェークローネ 31,200 | 千ノルウェークローネ 32,213 | 391,397 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーククローネ 41,100 | 千デンマーククローネ 53,848 | 879,343 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランドズロチ 31,900 | 千ポーランドズロチ 34,087 | 976,939 | 0.6 | — | 0.3 | 0.1 | 0.2 |
| オ ー ス ト ラ リ ア | 千オーストラリアドル 38,250 | 千オーストラリアドル 43,919 | 3,307,106 | 1.9 | — | 1.3 | 0.5 | 0.1 |
| シ ン ガ ポ ー ル | 千シンガポールドル 8,050 | 千シンガポールドル 8,775 | 709,066 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| マ レ ー シ ア | 千マレーシアリンギット 28,200 | 千マレーシアリンギット 29,136 | 770,358 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | — |
| 南 ア フ リ カ | 千南アフリカランド 162,500 | 千南アフリカランド 132,294 | 1,006,764 | 0.6 | — | 0.5 | — | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 169,433,468 | 98.6 | — | 53.8 | 30.1 | 14.6 |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|----------------------|------|-----------------------|-------|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | % | 千 米 ド ル | 千 米 ド ル | 千 円 | |
| (アメリカ) | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 3,800 | 3,774 | 413,530 | 2021/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 3,000 | 2,974 | 325,906 | 2021/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 4,500 | 4,458 | 488,474 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 2,700 | 2,673 | 292,946 | 2021/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | | 1.125 | 2,100 | 2,079 | 227,775 | 2021/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 3,600 | 3,579 | 392,197 | 2021/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 4,500 | 4,463 | 489,014 | 2021/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.25 | | 1.25 | 3,000 | 2,952 | 323,493 | 2023/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,000 | 2,989 | 327,550 | 2021/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,400 | 2,389 | 261,814 | 2021/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 4,000 | 3,981 | 436,219 | 2021/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 4,000 | 3,966 | 434,610 | 2022/10/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,500 | 3,460 | 379,176 | 2023/6/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,500 | 2,470 | 270,626 | 2023/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 3,000 | 2,962 | 324,622 | 2023/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.375 | | 1.375 | 2,600 | 2,526 | 276,777 | 2026/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,989 | 327,575 | 2022/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 5,800 | 5,774 | 632,618 | 2022/9/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,982 | 326,754 | 2023/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 3,000 | 2,982 | 326,754 | 2023/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.5 | | 1.5 | 1,500 | 1,469 | 161,001 | 2026/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,500 | 3,498 | 383,250 | 2020/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 2,000 | 1,997 | 218,897 | 2022/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,400 | 3,395 | 372,038 | 2022/8/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,500 | 3,494 | 382,830 | 2022/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,993 | 327,961 | 2023/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,992 | 327,858 | 2023/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 3,000 | 2,990 | 327,652 | 2023/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 2,400 | 2,374 | 260,129 | 2026/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 6,050 | 5,980 | 655,225 | 2026/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 5,500 | 5,429 | 594,812 | 2026/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.625 | | 1.625 | 9,650 | 9,420 | 1,032,144 | 2029/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 2,000 | 2,001 | 219,274 | 2020/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 10,500 | 10,507 | 1,151,188 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,004 | 329,142 | 2021/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,005 | 329,296 | 2022/2/28 |
| US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 1,800 | 1,803 | 197,577 | 2022/3/31 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 2,400 | 2,404 | 263,457 | 2022/4/30 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 4,100 | 4,108 | 450,108 | 2022/5/15 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,347 | 2022/5/31 | | |
| US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,373 | 2022/6/30 | | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | |
|---|---|-----------------------|---|-------|--------|--------|-----------|-------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | | 面 | 金 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,005 | 329,296 | 2022/ 9 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 3,000 | 3,006 | 329,347 | 2023/ 1 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 5,700 | 5,709 | 625,516 | 2023/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 11,800 | 11,809 | 1,293,818 | 2024/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.75 | | 1.75 | 850 | 850 | 93,184 | 2024/ 7 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 2,400 | 2,409 | 264,012 | 2022/ 1 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 2,000 | 2,008 | 220,095 | 2022/ 3 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,014 | 330,220 | 2022/ 4 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,015 | 330,349 | 2022/ 5 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 1,700 | 1,708 | 187,183 | 2022/ 7 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 4,800 | 4,825 | 528,640 | 2022/ 8 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,000 | 3,016 | 330,451 | 2022/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 1,800 | 1,810 | 198,409 | 2024/ 8 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,500 | 3,512 | 384,778 | 2026/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 1.875 | | 1.875 | 3,200 | 3,210 | 351,769 | 2026/ 7 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 5,300 | 5,315 | 582,391 | 2020/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,010 | 329,784 | 2021/ 1 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,011 | 329,886 | 2021/ 2 /28 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,013 | 330,143 | 2021/ 5 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,015 | 330,400 | 2021/ 8 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,017 | 330,554 | 2021/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 4,300 | 4,327 | 474,089 | 2021/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,521 | 385,856 | 2021/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,100 | 3,121 | 341,997 | 2022/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,024 | 331,401 | 2022/ 7 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,531 | 386,905 | 2022/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,027 | 331,658 | 2022/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 5,500 | 5,552 | 608,370 | 2023/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 2,000 | 2,022 | 221,602 | 2024/ 4 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,300 | 3,338 | 365,756 | 2024/ 5 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 2,500 | 2,528 | 277,024 | 2024/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 3,500 | 3,541 | 387,983 | 2025/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 4,300 | 4,349 | 476,555 | 2025/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2 | | 2.0 | 7,000 | 7,077 | 775,428 | 2026/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 2,700 | 2,712 | 297,198 | 2021/ 1 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 1,700 | 1,711 | 187,474 | 2021/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,000 | 4,028 | 441,355 | 2021/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,022 | 331,145 | 2021/ 9 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,026 | 331,581 | 2021/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,500 | 4,547 | 498,219 | 2022/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,000 | 3,034 | 332,429 | 2022/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,000 | 4,052 | 443,991 | 2022/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,100 | 3,147 | 344,863 | 2023/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 2,000 | 2,031 | 222,612 | 2024/ 2 /29 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|---|---|-----------------------|---|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 6,500 | 6,606 | 723,767 | 2024/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 3,500 | 3,559 | 389,990 | 2024/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,000 | 4,069 | 445,874 | 2024/9/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 1,800 | 1,831 | 200,705 | 2024/11/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 4,900 | 4,989 | 546,616 | 2025/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.125 | | 2.125 | 5,700 | 5,806 | 636,152 | 2026/5/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,000 | 4,025 | 441,047 | 2021/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 3,000 | 3,021 | 330,991 | 2021/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,500 | 4,533 | 496,640 | 2021/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 2,800 | 2,824 | 309,404 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,300 | 4,356 | 477,254 | 2022/4/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 3,000 | 3,061 | 335,459 | 2023/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 5,200 | 5,308 | 581,551 | 2024/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,800 | 4,904 | 537,309 | 2024/4/30 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 1,500 | 1,535 | 168,230 | 2024/10/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 6,300 | 6,448 | 706,459 | 2024/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 3,100 | 3,174 | 347,808 | 2024/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,000 | 4,100 | 449,298 | 2025/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 7,200 | 7,387 | 809,415 | 2026/3/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,400 | 4,525 | 495,772 | 2027/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 5,200 | 5,351 | 586,358 | 2027/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 5,600 | 5,764 | 631,558 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 2,850 | 2,813 | 308,196 | 2046/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.25 | | 2.25 | 4,500 | 4,440 | 486,472 | 2049/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 2,000 | 2,014 | 220,694 | 2020/12/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 5,000 | 5,042 | 552,507 | 2021/3/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 2,000 | 2,017 | 221,071 | 2021/4/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 3,600 | 3,656 | 400,609 | 2022/3/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 1,200 | 1,224 | 134,204 | 2023/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 3,700 | 3,797 | 416,013 | 2024/2/29 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 5,600 | 5,756 | 630,695 | 2024/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 4,900 | 5,084 | 557,101 | 2027/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 6,200 | 6,458 | 707,557 | 2029/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.375 | | 2.375 | 700 | 709 | 77,782 | 2049/11/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 8,900 | 8,986 | 984,530 | 2021/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 1,900 | 1,931 | 211,611 | 2022/1/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 3,500 | 3,560 | 390,140 | 2022/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 5,000 | 5,139 | 563,078 | 2023/8/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 5,700 | 5,883 | 644,641 | 2024/5/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 4,600 | 4,768 | 522,481 | 2025/1/31 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 1,400 | 1,456 | 159,603 | 2026/2/28 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 4,100 | 4,248 | 465,514 | 2045/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 2,900 | 3,006 | 329,365 | 2046/2/15 |
| | | US TREASURY N/B 2.5 | | 2.5 | 4,100 | 4,252 | 465,900 | 2046/5/15 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|---|---|------------------------|--------|--------|---------|-----------|-------------|-----------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 1, 500 | 1, 513 | 165, 765 | 2020/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 500 | 506 | 55, 494 | 2021/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 4, 000 | 4, 055 | 444, 300 | 2021/ 6 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 4, 000 | 4, 057 | 444, 573 | 2021/ 7 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 3, 000 | 3, 056 | 334, 842 | 2021/12/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 4, 000 | 4, 116 | 450, 976 | 2023/ 2 /28 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 4, 300 | 4, 487 | 491, 608 | 2025/ 3 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 5, 800 | 6, 072 | 665, 333 | 2025/12/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 625 | 2. 625 | 6, 300 | 6, 691 | 733, 997 | 2029/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 4, 000 | 4, 068 | 445, 772 | 2021/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 1, 400 | 1, 425 | 156, 152 | 2021/ 9 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 4, 900 | 5, 068 | 555, 339 | 2023/ 4 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 2, 000 | 2, 072 | 227, 097 | 2023/ 7 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 5, 000 | 5, 185 | 568, 171 | 2023/ 8 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 6, 200 | 6, 439 | 705, 540 | 2023/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 5, 100 | 5, 308 | 581, 586 | 2024/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 2, 000 | 2, 098 | 229, 921 | 2025/ 2 /28 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 5, 000 | 5, 256 | 575, 874 | 2025/ 6 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 600 | 631 | 69, 171 | 2025/ 8 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 4, 800 | 5, 124 | 561, 385 | 2028/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 2, 000 | 2, 164 | 237, 163 | 2042/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 2, 800 | 3, 028 | 331, 764 | 2042/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 3, 800 | 4, 138 | 453, 439 | 2047/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 75 | 2. 75 | 1, 500 | 1, 634 | 179, 079 | 2047/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 4, 000 | 4, 089 | 447, 997 | 2021/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 5, 000 | 5, 216 | 571, 509 | 2023/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 2, 000 | 2, 088 | 228, 792 | 2023/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 2, 200 | 2, 324 | 254, 721 | 2025/ 4 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 1, 100 | 1, 162 | 127, 417 | 2025/ 5 /31 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 2, 500 | 2, 651 | 290, 526 | 2025/11/30 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 4, 500 | 4, 853 | 531, 768 | 2028/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 7, 000 | 7, 560 | 828, 273 | 2028/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 3, 000 | 3, 314 | 363, 088 | 2043/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 4, 000 | 4, 438 | 486, 275 | 2045/ 8 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 3, 600 | 4, 008 | 439, 219 | 2046/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 2. 875 | 2. 875 | 900 | 1, 008 | 110, 444 | 2049/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 4, 000 | 4, 266 | 467, 444 | 2025/ 9 /30 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 3, 100 | 3, 307 | 362, 402 | 2025/10/31 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 1, 800 | 2, 026 | 222, 074 | 2042/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 4, 000 | 4, 525 | 495, 861 | 2044/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 4, 000 | 4, 534 | 496, 786 | 2045/ 5 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 4, 200 | 4, 768 | 522, 488 | 2045/11/15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 2, 500 | 2, 851 | 312, 374 | 2047/ 2 /15 | |
| | | US TREASURY N/B 3 | 3. 0 | 2, 200 | 2, 508 | 274, 795 | 2047/ 5 /15 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | | | | | | | | | |
|-------|------|-----------------------|---|-------|---|-------|--------|-------|--------|------------|---|------------|---|---|---|---|---|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | 評 | 価 | 額 | 債 | 還 | 年 | 月 | 日 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | | 3,100 | | 3,542 | | 388,113 | | 2048/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | | 7,400 | | 8,466 | | 927,605 | | 2048/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3 | | 3.0 | | 3,800 | | 4,353 | | 477,020 | | 2049/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 3,000 | | 3,060 | | 335,253 | | 2021/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 6,700 | | 7,383 | | 808,948 | | 2028/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 1,100 | | 1,263 | | 138,405 | | 2041/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 2,000 | | 2,297 | | 251,679 | | 2042/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 2,300 | | 2,643 | | 289,589 | | 2043/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 3,800 | | 4,385 | | 480,468 | | 2044/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.125 | | 3.125 | | 2,400 | | 2,805 | | 307,315 | | 2048/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.375 | | 3.375 | | 4,000 | | 4,803 | | 526,298 | | 2044/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.375 | | 3.375 | | 3,100 | | 3,797 | | 416,080 | | 2048/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.5 | | 3.5 | | 800 | | 968 | | 106,156 | | 2039/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | | 5,000 | | 5,110 | | 559,911 | | 2021/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | | 3,400 | | 4,225 | | 462,923 | | 2043/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.625 | | 3.625 | | 3,600 | | 4,483 | | 491,201 | | 2044/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.75 | | 3.75 | | 1,500 | | 1,884 | | 206,477 | | 2041/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.75 | | 3.75 | | 4,000 | | 5,067 | | 555,229 | | 2043/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 3.875 | | 3.875 | | 1,500 | | 1,912 | | 209,494 | | 2040/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.25 | | 4.25 | | 1,000 | | 1,330 | | 145,757 | | 2039/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.25 | | 4.25 | | 600 | | 803 | | 87,978 | | 2040/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | | 500 | | 671 | | 73,572 | | 2038/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | | 700 | | 947 | | 103,809 | | 2039/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | | 1,400 | | 1,901 | | 208,374 | | 2040/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.375 | | 4.375 | | 1,800 | | 2,453 | | 268,834 | | 2041/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | | 750 | | 1,002 | | 109,806 | | 2036/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | | 200 | | 272 | | 29,896 | | 2038/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.5 | | 4.5 | | 1,000 | | 1,372 | | 150,396 | | 2039/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.625 | | 4.625 | | 4,200 | | 5,871 | | 643,278 | | 2040/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 4.75 | | 4.75 | | 1,500 | | 2,139 | | 234,377 | | 2041/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 5 | | 5.0 | | 500 | | 714 | | 78,258 | | 2037/5/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 5.25 | | 5.25 | | 500 | | 638 | | 69,964 | | 2028/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 5.375 | | 5.375 | | 320 | | 431 | | 47,253 | | 2031/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 5.5 | | 5.5 | | 500 | | 645 | | 70,691 | | 2028/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 6 | | 6.0 | | 1,000 | | 1,245 | | 136,462 | | 2026/2/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 6.125 | | 6.125 | | 1,000 | | 1,316 | | 144,225 | | 2027/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 6.25 | | 6.25 | | 800 | | 929 | | 101,794 | | 2023/8/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 6.5 | | 6.5 | | 500 | | 652 | | 71,505 | | 2026/11/15 | | | | | |
| | | US TREASURY N/B 8 | | 8.0 | | 1,300 | | 1,453 | | 159,274 | | 2021/11/15 | | | | | |
| | 小 | 計 | | - | | - | | - | | 81,215,588 | | - | | | | | |
| (カナダ) | 国債証券 | CANADA-GOV' T 0.5 | | 0.5 | | 2,000 | 千カナダドル | 1,948 | 千カナダドル | 162,136 | | 2022/3/1 | | | | | |
| | | CANADA-GOV' T 0.75 | | 0.75 | | 1,800 | | 1,785 | | 148,540 | | 2020/9/1 | | | | | |
| | | CANADA-GOV' T 0.75 | | 0.75 | | 2,000 | | 1,976 | | 164,428 | | 2021/3/1 | | | | | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | |
|---------|------|----------------------|---|------|---------|---------|-----------|------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | | 面 | 金 | |
| | | CANADA-GOV T 0.75 | | 0.75 | 2,000 | 1,965 | 163,556 | 2021/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1 | | 1.0 | 3,000 | 2,946 | 245,137 | 2022/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1 | | 1.0 | 1,600 | 1,526 | 126,983 | 2027/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.25 | | 1.25 | 600 | 576 | 47,985 | 2030/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 2,000 | 1,989 | 165,519 | 2023/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 993 | 82,667 | 2024/9/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 991 | 82,501 | 2026/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 1.75 | | 1.75 | 1,100 | 1,102 | 91,743 | 2023/3/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2 | | 2.0 | 900 | 924 | 76,885 | 2028/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,000 | 1,024 | 85,201 | 2024/3/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,400 | 1,444 | 120,173 | 2025/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.25 | | 2.25 | 1,400 | 1,474 | 122,676 | 2029/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.5 | | 2.5 | 2,100 | 2,176 | 181,118 | 2024/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 1,800 | 1,846 | 153,593 | 2022/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 1,100 | 1,354 | 112,661 | 2048/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 2.75 | | 2.75 | 500 | 661 | 55,021 | 2064/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 3.25 | | 3.25 | 1,000 | 1,021 | 85,005 | 2021/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 3.5 | | 3.5 | 1,500 | 2,047 | 170,354 | 2045/12/1 | |
| | | CANADA-GOV T 4 | | 4.0 | 1,500 | 2,100 | 174,759 | 2041/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5 | | 5.0 | 1,750 | 2,605 | 216,807 | 2037/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5.75 | | 5.75 | 250 | 338 | 28,153 | 2029/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 5.75 | | 5.75 | 500 | 742 | 61,783 | 2033/6/1 | |
| | | CANADA-GOV T 8 | | 8.0 | 700 | 1,008 | 83,898 | 2027/6/1 | |
| | 小 | 計 | | - | - | - | 3,209,295 | - | |
| (メキシコ) | 国債証券 | MEXICAN BONOS 10 | | 10.0 | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 211,052 | 2024/12/5 | |
| | | MEXICAN BONOS 5.75 | | 5.75 | 20,000 | 19,058 | 110,157 | 2026/3/5 | |
| | | MEXICAN BONOS 6.5 | | 6.5 | 52,000 | 51,819 | 299,514 | 2022/6/9 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.5 | | 7.5 | 25,000 | 26,059 | 150,625 | 2027/6/3 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | | 7.75 | 6,000 | 6,436 | 37,201 | 2031/5/29 | |
| | | MEXICAN BONOS 7.75 | | 7.75 | 11,000 | 11,859 | 68,545 | 2034/11/23 | |
| | | MEXICAN BONOS 8 | | 8.0 | 27,000 | 28,240 | 163,229 | 2023/12/7 | |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | | 8.5 | 28,000 | 31,311 | 180,980 | 2029/5/31 | |
| | | MEXICAN BONOS 8.5 | | 8.5 | 40,000 | 45,877 | 265,172 | 2038/11/18 | |
| | 小 | 計 | | - | - | - | 1,486,478 | - | |
| (ユ - ロ) | | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| (ドイツ) | 国債証券 | BUNDESUBL-173 0 | | - | 2,500 | 2,521 | 307,669 | 2021/4/9 | |
| | | BUNDESUBL-174 0 | | - | 3,000 | 3,035 | 370,327 | 2021/10/8 | |
| | | BUNDESUBL-176 0 | | - | 1,000 | 1,018 | 124,226 | 2022/10/7 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | | - | 3,400 | 3,507 | 427,996 | 2026/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0 | | - | 500 | 513 | 62,667 | 2029/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 1,800 | 1,890 | 230,673 | 2027/2/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 2,900 | 3,055 | 372,751 | 2028/8/15 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.25 | | 0.25 | 2,400 | 2,526 | 308,317 | 2029/2/15 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 |
|--------|------|-----------------------|---|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | | 0.5 | 2,500 | 2,636 | 321,633 | 2025/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | | 0.5 | 1,400 | 1,487 | 181,450 | 2026/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | | 0.5 | 1,500 | 1,607 | 196,093 | 2027/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 0.5 | | 0.5 | 2,000 | 2,147 | 262,023 | 2028/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1 | | 1.0 | 1,300 | 1,396 | 170,342 | 2024/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1 | | 1.0 | 2,050 | 2,228 | 271,946 | 2025/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.25 | | 1.25 | 1,450 | 1,867 | 227,910 | 2048/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | | 1.5 | 500 | 534 | 65,166 | 2023/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | | 1.5 | 1,300 | 1,395 | 170,228 | 2023/5/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.5 | | 1.5 | 2,000 | 2,185 | 266,679 | 2024/5/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | | 1.75 | 2,200 | 2,334 | 284,878 | 2022/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 1.75 | | 1.75 | 4,000 | 4,393 | 536,048 | 2024/2/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2 | | 2.0 | 1,500 | 1,645 | 200,772 | 2023/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.25 | | 2.25 | 1,400 | 1,469 | 179,334 | 2021/9/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | | 2.5 | 500 | 517 | 63,104 | 2021/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | | 2.5 | 2,200 | 3,451 | 421,172 | 2044/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 2.5 | | 2.5 | 2,100 | 3,367 | 410,809 | 2046/8/15 |
| | | DEUTSCHLAND REP 3.25 | | 3.25 | 1,200 | 2,045 | 249,611 | 2042/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4 | | 4.0 | 1,800 | 3,042 | 371,207 | 2037/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.25 | | 4.25 | 950 | 1,734 | 211,657 | 2039/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | | 4.75 | 1,600 | 2,309 | 281,813 | 2028/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | | 4.75 | 4,300 | 7,380 | 900,502 | 2034/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 4.75 | | 4.75 | 1,150 | 2,260 | 275,787 | 2040/7/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 5.5 | | 5.5 | 900 | 1,480 | 180,665 | 2031/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 5.625 | | 5.625 | 1,000 | 1,492 | 182,138 | 2028/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | | 6.25 | 1,200 | 1,536 | 187,524 | 2024/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.25 | | 6.25 | 500 | 834 | 101,809 | 2030/1/4 |
| | | DEUTSCHLAND REP 6.5 | | 6.5 | 1,000 | 1,531 | 186,832 | 2027/7/4 |
| (イタリア) | 国債証券 | BTPS 0.05 | | 0.05 | 1,000 | 1,003 | 122,417 | 2021/4/15 |
| | | BTPS 0.35 | | 0.35 | 1,500 | 1,512 | 184,515 | 2021/11/1 |
| | | BTPS 0.45 | | 0.45 | 1,500 | 1,513 | 184,678 | 2021/6/1 |
| | | BTPS 0.65 | | 0.65 | 2,000 | 2,028 | 247,511 | 2023/10/15 |
| | | BTPS 0.9 | | 0.9 | 2,250 | 2,298 | 280,471 | 2022/8/1 |
| | | BTPS 0.95 | | 0.95 | 3,000 | 3,071 | 374,741 | 2023/3/1 |
| | | BTPS 0.95 | | 0.95 | 2,000 | 2,048 | 249,922 | 2023/3/15 |
| | | BTPS 1 | | 1.0 | 2,300 | 2,355 | 287,414 | 2022/7/15 |
| | | BTPS 1.2 | | 1.2 | 1,000 | 1,027 | 125,317 | 2022/4/1 |
| | | BTPS 1.25 | | 1.25 | 1,600 | 1,643 | 200,469 | 2026/12/1 |
| | | BTPS 1.35 | | 1.35 | 2,000 | 2,060 | 251,440 | 2022/4/15 |
| | | BTPS 1.45 | | 1.45 | 2,000 | 2,074 | 253,092 | 2022/9/15 |
| | | BTPS 1.45 | | 1.45 | 1,800 | 1,880 | 229,386 | 2024/11/15 |
| | | BTPS 1.45 | | 1.45 | 1,000 | 1,041 | 127,084 | 2025/5/15 |
| | | BTPS 1.5 | | 1.5 | 2,700 | 2,818 | 343,895 | 2025/6/1 |
| | | BTPS 1.6 | | 1.6 | 1,200 | 1,261 | 153,905 | 2026/6/1 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 | | | | | | | | | |
|---|---|-----------|---|------|---|-------|---|-------|---|---------|---|------------|---|---|---|---|---|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | 評 | 価 | 額 | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | BTPS 1.65 | | 1.65 | | 2,400 | | 2,458 | | 299,980 | | 2032/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 1.85 | | 1.85 | | 1,000 | | 1,061 | | 129,500 | | 2024/5/15 | | | | | |
| | | BTPS 2 | | 2.0 | | 2,300 | | 2,469 | | 301,310 | | 2025/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2 | | 2.0 | | 1,600 | | 1,724 | | 210,384 | | 2028/2/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.05 | | 2.05 | | 1,500 | | 1,617 | | 197,319 | | 2027/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.1 | | 2.1 | | 1,000 | | 1,079 | | 131,713 | | 2026/7/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.15 | | 2.15 | | 500 | | 522 | | 63,689 | | 2021/12/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.2 | | 2.2 | | 1,000 | | 1,088 | | 132,867 | | 2027/6/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.25 | | 2.25 | | 1,200 | | 1,277 | | 155,896 | | 2036/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.3 | | 2.3 | | 600 | | 625 | | 76,375 | | 2021/10/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.45 | | 2.45 | | 1,100 | | 1,213 | | 148,011 | | 2033/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.5 | | 2.5 | | 600 | | 656 | | 80,083 | | 2024/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.5 | | 2.5 | | 1,100 | | 1,211 | | 147,782 | | 2025/11/15 | | | | | |
| | | BTPS 2.7 | | 2.7 | | 2,050 | | 2,254 | | 275,057 | | 2047/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.8 | | 2.8 | | 300 | | 343 | | 41,867 | | 2028/12/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.8 | | 2.8 | | 900 | | 960 | | 117,244 | | 2067/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 2.95 | | 2.95 | | 1,000 | | 1,150 | | 140,366 | | 2038/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3 | | 3.0 | | 3,500 | | 4,075 | | 497,265 | | 2029/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.1 | | 3.1 | | 1,700 | | 1,979 | | 241,474 | | 2040/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.25 | | 3.25 | | 1,500 | | 1,807 | | 220,503 | | 2046/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.35 | | 3.35 | | 850 | | 1,029 | | 125,582 | | 2035/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.45 | | 3.45 | | 1,600 | | 1,987 | | 242,526 | | 2048/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.5 | | 3.5 | | 1,900 | | 2,304 | | 281,187 | | 2030/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,500 | | 2,621 | | 319,852 | | 2021/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,000 | | 2,108 | | 257,255 | | 2021/5/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 3,200 | | 3,401 | | 415,001 | | 2021/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.75 | | 3.75 | | 2,000 | | 2,298 | | 280,427 | | 2024/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 3.85 | | 3.85 | | 400 | | 528 | | 64,439 | | 2049/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4 | | 4.0 | | 2,100 | | 2,739 | | 334,263 | | 2037/2/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 2,300 | | 2,627 | | 320,617 | | 2023/5/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 3,000 | | 3,508 | | 428,020 | | 2024/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.5 | | 4.5 | | 1,800 | | 2,207 | | 269,306 | | 2026/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,600 | | 2,815 | | 343,501 | | 2021/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,500 | | 2,901 | | 354,066 | | 2023/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 2,500 | | 3,259 | | 397,630 | | 2028/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 4.75 | | 4.75 | | 1,600 | | 2,359 | | 287,873 | | 2044/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 2,000 | | 2,221 | | 271,013 | | 2022/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,000 | | 1,224 | | 149,437 | | 2025/3/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 2,070 | | 2,946 | | 359,547 | | 2034/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,800 | | 2,658 | | 324,320 | | 2039/8/1 | | | | | |
| | | BTPS 5 | | 5.0 | | 1,700 | | 2,512 | | 306,533 | | 2040/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.5 | | 5.5 | | 1,200 | | 1,375 | | 167,865 | | 2022/9/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.5 | | 5.5 | | 2,000 | | 2,307 | | 281,572 | | 2022/11/1 | | | | | |
| | | BTPS 5.75 | | 5.75 | | 1,700 | | 2,536 | | 309,505 | | 2033/2/1 | | | | | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|----------------------|------|----------------------|-------|-------|---------|------------|-------------|------------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | BTPS 6 | | 6.0 | 2,700 | 4,008 | 489,113 | 2031/5/1 |
| | | BTPS 6.5 | | 6.5 | 3,700 | 5,233 | 638,553 | 2027/11/1 |
| | | BTPS 7.25 | | 7.25 | 400 | 569 | 69,502 | 2026/11/1 |
| | | BTPS 9 | | 9.0 | 300 | 400 | 48,814 | 2023/11/1 |
| (フランス) | 国債証券 | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 3,000 | 3,021 | 368,712 | 2021/2/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 4,200 | 4,237 | 517,012 | 2021/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 2,000 | 2,027 | 247,375 | 2022/2/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 2,200 | 2,233 | 272,534 | 2022/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 2,000 | 2,038 | 248,722 | 2023/3/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 5,000 | 5,105 | 622,873 | 2024/3/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 2,200 | 2,243 | 273,688 | 2025/3/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0 | | — | 4,000 | 3,993 | 487,278 | 2029/11/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.25 | | 0.25 | 2,400 | 2,481 | 302,785 | 2026/11/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | | 0.5 | 2,900 | 3,038 | 370,763 | 2025/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | | 0.5 | 3,500 | 3,676 | 448,604 | 2026/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.5 | | 0.5 | 3,300 | 3,464 | 422,668 | 2029/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.75 | | 0.75 | 3,300 | 3,542 | 432,218 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 0.75 | | 0.75 | 1,700 | 1,825 | 222,682 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1 | | 1.0 | 2,050 | 2,212 | 269,945 | 2025/11/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1 | | 1.0 | 2,500 | 2,723 | 332,333 | 2027/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.25 | | 1.25 | 1,700 | 1,932 | 235,843 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.25 | | 1.25 | 2,400 | 2,727 | 332,809 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.5 | | 1.5 | 3,650 | 4,229 | 516,047 | 2031/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | | 1.75 | 4,000 | 4,322 | 527,405 | 2023/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | | 1.75 | 2,300 | 2,549 | 311,036 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | | 1.75 | 2,900 | 3,578 | 436,639 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 1.75 | | 1.75 | 800 | 1,038 | 126,730 | 2066/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 2 | | 2.0 | 3,000 | 3,960 | 483,163 | 2048/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 2.25 | | 2.25 | 1,900 | 2,056 | 250,923 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 2.25 | | 2.25 | 3,400 | 3,816 | 465,676 | 2024/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 2.5 | | 2.5 | 3,500 | 4,399 | 536,829 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 2.75 | | 2.75 | 4,050 | 4,992 | 609,097 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 3 | | 3.0 | 5,000 | 5,431 | 662,666 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 3.25 | | 3.25 | 2,500 | 2,681 | 327,212 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 3.25 | | 3.25 | 2,200 | 3,529 | 430,615 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 3.5 | | 3.5 | 2,500 | 3,110 | 379,457 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 3.75 | | 3.75 | 3,400 | 3,602 | 439,566 | 2021/4/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | | 4.0 | 2,000 | 3,288 | 401,195 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | | 4.0 | 1,170 | 2,294 | 279,993 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE O. A. T. 4 | | 4.0 | 1,400 | 2,873 | 350,635 | 2060/4/25 |
| FRANCE O. A. T. 4.25 | | 4.25 | 3,000 | 3,560 | 434,448 | 2023/10/25 | | |
| FRANCE O. A. T. 4.5 | | 4.5 | 2,900 | 5,223 | 637,277 | 2041/4/25 | | |
| FRANCE O. A. T. 4.75 | | 4.75 | 2,200 | 3,670 | 447,870 | 2035/4/25 | | |
| FRANCE O. A. T. 5.5 | | 5.5 | 2,750 | 4,189 | 511,179 | 2029/4/25 | | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|--------|------|------------------------|-------|--------|---------|-----------|-------------|-----------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | FRANCE O. A. T. 5. 75 | 5. 75 | 2, 800 | 4, 800 | 585, 676 | 2032/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 6 | 6. 0 | 3, 000 | 4, 123 | 503, 082 | 2025/10/25 | |
| | | FRANCE O. A. T. 8. 5 | 8. 5 | 600 | 785 | 95, 794 | 2023/ 4 /25 | |
| (オランダ) | 国債証券 | NETHERLANDS GOVT 0 | — | 1, 800 | 1, 823 | 222, 435 | 2022/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0 | — | 2, 000 | 2, 043 | 249, 320 | 2024/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 25 | 0. 25 | 1, 700 | 1, 764 | 215, 228 | 2025/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 25 | 0. 25 | 300 | 311 | 38, 024 | 2029/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 5 | 0. 5 | 1, 500 | 1, 586 | 193, 553 | 2026/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 5 | 0. 5 | 600 | 634 | 77, 439 | 2040/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 75 | 0. 75 | 1, 400 | 1, 511 | 184, 385 | 2027/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0. 75 | 0. 75 | 1, 200 | 1, 301 | 158, 843 | 2028/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 1. 75 | 1. 75 | 1, 600 | 1, 735 | 211, 739 | 2023/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2 | 2. 0 | 1, 000 | 1, 115 | 136, 127 | 2024/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 25 | 2. 25 | 1, 500 | 1, 612 | 196, 746 | 2022/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 5 | 2. 5 | 1, 000 | 1, 329 | 162, 161 | 2033/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 2. 75 | 2. 75 | 1, 200 | 1, 987 | 242, 436 | 2047/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 25 | 3. 25 | 800 | 849 | 103, 624 | 2021/ 7 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 75 | 3. 75 | 700 | 795 | 97, 029 | 2023/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3. 75 | 3. 75 | 1, 300 | 2, 308 | 281, 607 | 2042/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 4 | 4. 0 | 1, 100 | 1, 827 | 223, 015 | 2037/ 1 /15 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 5. 5 | 5. 5 | 700 | 1, 028 | 125, 521 | 2028/ 1 /15 | |
| (スペイン) | 国債証券 | SPANISH GOV' T 0. 05 | 0. 05 | 1, 100 | 1, 105 | 134, 931 | 2021/ 1 /31 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 25 | 0. 25 | 3, 000 | 3, 049 | 372, 069 | 2024/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 4 | 0. 4 | 2, 000 | 2, 036 | 248, 461 | 2022/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 45 | 0. 45 | 500 | 511 | 62, 375 | 2022/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 0. 75 | 0. 75 | 2, 000 | 2, 038 | 248, 724 | 2021/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 3 | 1. 3 | 2, 700 | 2, 916 | 355, 899 | 2026/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 4 | 1. 4 | 2, 000 | 2, 185 | 266, 613 | 2028/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 4 | 1. 4 | 1, 600 | 1, 748 | 213, 310 | 2028/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 45 | 1. 45 | 600 | 656 | 80, 143 | 2027/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 45 | 1. 45 | 2, 900 | 3, 185 | 388, 610 | 2029/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 5 | 1. 5 | 1, 200 | 1, 315 | 160, 510 | 2027/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 6 | 1. 6 | 2, 200 | 2, 392 | 291, 898 | 2025/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 85 | 1. 85 | 400 | 459 | 56, 119 | 2035/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 95 | 1. 95 | 400 | 447 | 54, 610 | 2026/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 1. 95 | 1. 95 | 1, 700 | 1, 956 | 238, 766 | 2030/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 15 | 2. 15 | 2, 000 | 2, 248 | 274, 341 | 2025/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 35 | 2. 35 | 2, 200 | 2, 674 | 326, 283 | 2033/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 7 | 2. 7 | 1, 750 | 2, 342 | 285, 816 | 2048/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 75 | 2. 75 | 2, 100 | 2, 391 | 291, 787 | 2024/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 2. 9 | 2. 9 | 1, 400 | 1, 926 | 235, 084 | 2046/10/31 | |
| | | SPANISH GOV' T 3. 45 | 3. 45 | 1, 100 | 1, 759 | 214, 646 | 2066/ 7 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 3. 8 | 3. 8 | 1, 900 | 2, 226 | 271, 701 | 2024/ 4 /30 | |
| | | SPANISH GOV' T 4. 2 | 4. 2 | 1, 650 | 2, 531 | 308, 924 | 2037/ 1 /31 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 | | |
|----------|------|---------------------|---|------|-------|-------|---------|------------|-------------|-----------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 面 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | 4.4 | 2,000 | 2,356 | 287,511 | 2023/10/31 | | |
| | | | | 4.65 | 1,800 | 2,268 | 276,780 | 2025/7/30 | | |
| | | | | 4.7 | 1,800 | 3,067 | 374,251 | 2041/7/30 | | |
| | | | | 4.8 | 2,000 | 2,409 | 293,944 | 2024/1/31 | | |
| | | | | 4.9 | 1,500 | 2,587 | 315,688 | 2040/7/30 | | |
| | | | | 5.15 | 1,500 | 2,131 | 260,024 | 2028/10/31 | | |
| | | | | 5.15 | 1,200 | 2,231 | 272,217 | 2044/10/31 | | |
| | | | | 5.4 | 2,250 | 2,650 | 323,382 | 2023/1/31 | | |
| | | | | 5.5 | 2,700 | 2,919 | 356,248 | 2021/4/30 | | |
| | | | | 5.75 | 1,500 | 2,444 | 298,211 | 2032/7/30 | | |
| | | | | 5.85 | 2,200 | 2,492 | 304,068 | 2022/1/31 | | |
| | | | | 5.9 | 500 | 690 | 84,250 | 2026/7/30 | | |
| | | | | 6.0 | 2,200 | 3,317 | 404,761 | 2029/1/31 | | |
| (ベルギー) | 国債証券 | BELGIAN 0326 4 | | 4.0 | 700 | 1,028 | 125,503 | 2032/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 1,300 | 1,382 | 168,645 | 2025/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 700 | 751 | 91,634 | 2027/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0.8 | | 0.8 | 500 | 537 | 65,619 | 2028/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0291 5.5 | | 5.5 | 2,000 | 2,941 | 358,911 | 2028/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0304 5 | | 5.0 | 1,600 | 2,710 | 330,695 | 2035/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0308 4 | | 4.0 | 700 | 774 | 94,473 | 2022/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0320 4.25 | | 4.25 | 1,500 | 2,596 | 316,782 | 2041/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0321 4.25 | | 4.25 | 4,300 | 4,677 | 570,706 | 2021/9/28 | | |
| | | BELGIAN 0324 4.5 | | 4.5 | 1,000 | 1,302 | 158,965 | 2026/3/28 | | |
| | | BELGIAN 0325 4.25 | | 4.25 | 1,700 | 1,931 | 235,673 | 2022/9/28 | | |
| | | BELGIAN 0328 2.25 | | 2.25 | 1,500 | 1,649 | 201,226 | 2023/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0332 2.6 | | 2.6 | 500 | 569 | 69,448 | 2024/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0333 3 | | 3.0 | 1,500 | 2,080 | 253,821 | 2034/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0338 0.5 | | 0.5 | 1,000 | 1,043 | 127,325 | 2024/10/22 | | |
| | | BELGIAN 0338 2.25 | | 2.25 | 500 | 707 | 86,380 | 2057/6/22 | | |
| | | BELGIAN 0344 1.45 | | 1.45 | 400 | 465 | 56,831 | 2037/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 1,400 | 1,515 | 184,936 | 2026/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1 | | 1.0 | 1,300 | 1,430 | 174,477 | 2031/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1.25 | | 1.25 | 400 | 453 | 55,363 | 2033/4/22 | | |
| | | BELGIAN 1.6 | | 1.6 | 1,150 | 1,397 | 170,528 | 2047/6/22 | | |
| | | BELGIAN 1.9 | | 1.9 | 500 | 623 | 76,081 | 2038/6/22 | | |
| | | BELGIAN 2.15 | | 2.15 | 500 | 711 | 86,828 | 2066/6/22 | | |
| | | BELGIAN 3.75 | | 3.75 | 800 | 1,375 | 167,768 | 2045/6/22 | | |
| (オーストリア) | 国債証券 | REP OF AUSTRIA 0 | | — | 1,100 | 1,121 | 136,778 | 2023/7/15 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 1,300 | 1,368 | 167,002 | 2027/4/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.5 | | 0.5 | 850 | 894 | 109,083 | 2029/2/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 900 | 963 | 117,512 | 2026/10/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 0.75 | | 0.75 | 200 | 214 | 26,195 | 2028/2/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.2 | | 1.2 | 2,000 | 2,182 | 266,279 | 2025/10/20 | | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.5 | | 1.5 | 1,000 | 1,248 | 152,297 | 2047/2/20 | | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 | | |
|-----------------|------|---------------------|---|-------|---|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 面 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | REP OF AUSTRIA 1.5 | | 1.5 | | 200 | | 262 | 32,009 | 2086/11/2 |
| | | REP OF AUSTRIA 1.65 | | 1.65 | | 1,100 | | 1,211 | 147,830 | 2024/10/21 |
| | | REP OF AUSTRIA 1.75 | | 1.75 | | 1,000 | | 1,087 | 132,744 | 2023/10/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 2.4 | | 2.4 | | 600 | | 787 | 96,126 | 2034/5/23 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.15 | | 3.15 | | 600 | | 979 | 119,485 | 2044/6/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.4 | | 3.4 | | 1,100 | | 1,229 | 149,978 | 2022/11/22 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.5 | | 3.5 | | 1,000 | | 1,072 | 130,809 | 2021/9/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.65 | | 3.65 | | 1,000 | | 1,100 | 134,265 | 2022/4/20 |
| | | REP OF AUSTRIA 3.8 | | 3.8 | | 500 | | 1,074 | 131,047 | 2062/1/26 |
| | | REP OF AUSTRIA 4.15 | | 4.15 | | 1,300 | | 2,149 | 262,249 | 2037/3/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 4.85 | | 4.85 | | 1,000 | | 1,325 | 161,758 | 2026/3/15 |
| | | REP OF AUSTRIA 6.25 | | 6.25 | | 1,000 | | 1,493 | 182,191 | 2027/7/15 |
| (フィンランド) | 国債証券 | FINNISH GOV'T 0 | | — | | 400 | | 405 | 49,489 | 2022/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.5 | | 0.5 | | 400 | | 421 | 51,444 | 2028/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.5 | | 0.5 | | 1,400 | | 1,476 | 180,087 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 0.75 | | 0.75 | | 500 | | 539 | 65,863 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.125 | | 1.125 | | 200 | | 226 | 27,610 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.5 | | 1.5 | | 1,000 | | 1,069 | 130,437 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 1.625 | | 1.625 | | 1,000 | | 1,061 | 129,483 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOV'T 2 | | 2.0 | | 1,000 | | 1,107 | 135,184 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOV'T 2.625 | | 2.625 | | 500 | | 748 | 91,314 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOV'T 2.75 | | 2.75 | | 600 | | 748 | 91,345 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOV'T 3.5 | | 3.5 | | 1,000 | | 1,055 | 128,737 | 2021/4/15 |
| FINNISH GOV'T 4 | | 4.0 | | 1,000 | | 1,246 | 152,113 | 2025/7/4 | | |
| (アイルランド) | 国債証券 | IRISH GOVT 0 | | — | | 400 | | 405 | 49,477 | 2022/10/18 |
| | | IRISH GOVT 0.8 | | 0.8 | | 700 | | 720 | 87,894 | 2022/3/15 |
| | | IRISH GOVT 0.9 | | 0.9 | | 700 | | 757 | 92,384 | 2028/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1 | | 1.0 | | 1,000 | | 1,077 | 131,517 | 2026/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.1 | | 1.1 | | 1,100 | | 1,212 | 147,985 | 2029/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.5 | | 1.5 | | 400 | | 472 | 57,606 | 2050/5/15 |
| | | IRISH GOVT 1.7 | | 1.7 | | 300 | | 361 | 44,056 | 2037/5/15 |
| | | IRISH GOVT 2 | | 2.0 | | 1,000 | | 1,307 | 159,519 | 2045/2/18 |
| | | IRISH GOVT 2.4 | | 2.4 | | 600 | | 744 | 90,777 | 2030/5/15 |
| | | IRISH GOVT 3.4 | | 3.4 | | 1,000 | | 1,163 | 141,902 | 2024/3/18 |
| | | IRISH GOVT 3.9 | | 3.9 | | 500 | | 571 | 69,783 | 2023/3/20 |
| IRISH GOVT 5.4 | | 5.4 | | 1,500 | | 1,951 | 238,159 | 2025/3/13 | | |
| 小 | | 計 | | | | — | | — | 63,865,811 | — |
| (イギリス) | 国債証券 | UK TSY GILT 0.5 | | 0.5 | | 1,800 | | 1,796 | 261,306 | 2022/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.625 | | 0.625 | | 1,000 | | 998 | 145,185 | 2025/6/7 |
| | | UK TSY GILT 0.75 | | 0.75 | | 750 | | 753 | 109,625 | 2023/7/22 |
| | | UK TSY GILT 0.875 | | 0.875 | | 700 | | 703 | 102,353 | 2029/10/22 |
| | | UK TSY GILT 1 | | 1.0 | | 1,000 | | 1,015 | 147,761 | 2024/4/22 |
| | | UK TSY GILT 1.25 | | 1.25 | | 1,500 | | 1,563 | 227,408 | 2027/7/22 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|----------|------|-----------------------|-------|-------|---------|------------|-------------|-----------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | UK TSY GILT 1.5 | 1.5 | 1,000 | 1,055 | 153,573 | 2026/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.5 | 1.5 | 1,700 | 1,773 | 257,949 | 2047/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 2,000 | 2,152 | 313,029 | 2028/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 100 | 110 | 16,074 | 2054/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.625 | 1.625 | 450 | 531 | 77,276 | 2071/10/22 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 3,000 | 3,094 | 450,099 | 2022/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 2,600 | 2,821 | 410,437 | 2037/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 1.75 | 1.75 | 1,650 | 1,823 | 265,200 | 2049/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 2 | 2.0 | 1,100 | 1,186 | 172,579 | 2025/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 2.25 | 2.25 | 2,700 | 2,863 | 416,495 | 2023/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 2.5 | 2.5 | 1,600 | 2,335 | 339,748 | 2065/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 2.75 | 2.75 | 1,700 | 1,867 | 271,673 | 2024/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 3.25 | 3.25 | 1,600 | 2,239 | 325,821 | 2044/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 2,550 | 3,740 | 544,099 | 2045/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.5 | 3.5 | 1,450 | 2,682 | 390,131 | 2068/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 3.75 | 3.75 | 1,500 | 1,581 | 229,998 | 2021/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 3.75 | 3.75 | 1,600 | 2,664 | 387,612 | 2052/7/22 | |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 1,500 | 1,613 | 234,663 | 2022/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 4 | 4.0 | 1,700 | 3,216 | 467,820 | 2060/1/22 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,100 | 1,405 | 204,404 | 2027/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,400 | 1,939 | 282,089 | 2032/6/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,050 | 1,534 | 223,220 | 2036/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,350 | 2,064 | 300,331 | 2039/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,300 | 2,015 | 293,149 | 2040/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,500 | 2,501 | 363,799 | 2046/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,400 | 2,423 | 352,583 | 2049/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.25 | 4.25 | 1,700 | 3,194 | 464,630 | 2055/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 1,100 | 1,614 | 234,815 | 2034/9/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.5 | 4.5 | 1,350 | 2,213 | 321,934 | 2042/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 1,450 | 2,042 | 297,150 | 2030/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 4.75 | 4.75 | 1,200 | 1,925 | 280,110 | 2038/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 5 | 5.0 | 1,600 | 1,958 | 284,880 | 2025/3/7 | |
| | | UK TSY GILT 6 | 6.0 | 950 | 1,384 | 201,410 | 2028/12/7 | |
| | | UK TSY GILT 8 | 8.0 | 1,320 | 1,462 | 212,791 | 2021/6/7 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 11,035,227 | — | |
| (スウェーデン) | 国債証券 | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 0.75 | 4,000 | 4,271 | 49,934 | 2028/5/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1 | 1.0 | 7,400 | 7,982 | 93,316 | 2026/11/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 1.5 | 7,000 | 7,488 | 87,540 | 2023/11/13 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 2.5 | 5,000 | 5,740 | 67,109 | 2025/5/12 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 8,000 | 8,754 | 102,337 | 2022/6/1 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 3.5 | 4,600 | 7,191 | 84,065 | 2039/3/30 | |
| | | SWEDISH GOVRNMNT 5 | 5.0 | 7,800 | 8,193 | 95,786 | 2020/12/1 | |
| | 小 | 計 | — | — | — | 580,091 | — | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | |
|-----------|------|-----------------------|------|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------|
| | | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ノルウェー) | 国債証券 | NORWEGIAN GOV T 1.5 | 1.5 | 千ノルウェークロネ 3,500 | 千ノルウェークロネ 3,533 | 42,937 | 2026/2/19 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 1.75 | 1.75 | 5,000 | 5,110 | 62,092 | 2025/3/13 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 1.75 | 1.75 | 2,700 | 2,766 | 33,615 | 2029/9/6 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 2 | 2.0 | 6,000 | 6,136 | 74,553 | 2023/5/24 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 2 | 2.0 | 4,000 | 4,178 | 50,767 | 2028/4/26 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 3 | 3.0 | 4,000 | 4,280 | 52,006 | 2024/3/14 | |
| | | NORWEGIAN GOV T 3.75 | 3.75 | 6,000 | 6,207 | 75,424 | 2021/5/25 | |
| | | 小 計 | | — | — | — | 391,397 | — |
| (デンマーク) | 国債証券 | DENMARK - BULLET 0.25 | 0.25 | 千デンマーククロネ 3,500 | 千デンマーククロネ 3,531 | 57,675 | 2020/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 0.5 | 0.5 | 8,100 | 8,673 | 141,637 | 2027/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 1.5 | 1.5 | 5,000 | 5,413 | 88,402 | 2023/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 1.75 | 1.75 | 6,000 | 6,805 | 111,128 | 2025/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 3 | 3.0 | 7,000 | 7,498 | 122,448 | 2021/11/15 | |
| | | DENMARK - BULLET 4.5 | 4.5 | 11,500 | 21,925 | 358,049 | 2039/11/15 | |
| 小 計 | | — | — | — | 879,343 | — | | |
| (ポーランド) | 国債証券 | POLAND GOVT BOND 1.75 | 1.75 | 千ポーランドズロチ 3,000 | 千ポーランドズロチ 3,015 | 86,427 | 2021/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2 | 2.0 | 2,000 | 2,013 | 57,692 | 2021/4/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 4,500 | 4,659 | 133,535 | 2026/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 2.5 | 2.5 | 3,000 | 3,099 | 88,817 | 2027/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 3.25 | 3.25 | 8,900 | 9,523 | 272,929 | 2025/7/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 4 | 4.0 | 2,700 | 2,943 | 84,346 | 2023/10/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 4,000 | 4,306 | 123,409 | 2021/10/25 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 2,400 | 2,670 | 76,537 | 2022/9/23 | |
| | | POLAND GOVT BOND 5.75 | 5.75 | 1,400 | 1,857 | 53,244 | 2029/4/25 | |
| 小 計 | | — | — | — | 976,939 | — | | |
| (オーストラリア) | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVT. 1.5 | 1.5 | 千オーストラリアドル 1,400 | 千オーストラリアドル 1,438 | 108,297 | 2031/6/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 1.75 | 1.75 | 300 | 302 | 22,770 | 2020/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2 | 2.0 | 1,000 | 1,021 | 76,952 | 2021/12/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 2,000 | 2,084 | 156,992 | 2022/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25 | 3,000 | 3,264 | 245,801 | 2028/5/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.5 | 2.5 | 1,350 | 1,519 | 114,392 | 2030/5/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 2,500 | 2,707 | 203,901 | 2024/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 2,200 | 2,472 | 186,152 | 2027/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 1,800 | 2,047 | 154,143 | 2028/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 1,300 | 1,487 | 112,005 | 2029/11/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2.75 | 800 | 943 | 71,041 | 2035/6/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3 | 3.0 | 1,100 | 1,394 | 104,993 | 2047/3/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 1,900 | 2,130 | 160,453 | 2025/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 2,100 | 2,480 | 186,783 | 2029/4/21 | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3.25 | 1,150 | 1,459 | 109,915 | 2039/6/21 | |

外国債券パッシブ・マザーファンド

| 種 | 類 | 銘 | 柄 | 期 | | | 末 | | | | | | | |
|----------|------|------------------|-------|-------|--------|--------|-------------|-----------|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 利 | 率 | 額 | 評 | | 額 | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 |
| | | | | | | | 外 | 貨 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 3.75 | 3.75 | 1,200 | 1,615 | 121,654 | 2037/4/21 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 4.25 | 4.25 | 2,150 | 2,578 | 194,144 | 2026/4/21 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 4.5 | 4.5 | 1,400 | 1,946 | 146,533 | 2033/4/21 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 4.75 | 4.75 | 2,300 | 2,905 | 218,790 | 2027/4/21 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 5.5 | 5.5 | 2,000 | 2,309 | 173,920 | 2023/4/21 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 5.75 | 5.75 | 2,800 | 2,993 | 225,373 | 2021/5/15 | | | | | | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. | 5.75 | 5.75 | 2,500 | 2,816 | 212,091 | 2022/7/15 | | | | | | |
| | 小 | 計 | | — | — | — | 3,307,106 | — | | | | | | |
| (シンガポール) | 国債証券 | SINGAPORE GOV'T | 2.25 | 2.25 | 1,100 | 1,111 | 89,785 | 2021/6/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 2.75 | 2.75 | 1,200 | 1,248 | 100,878 | 2023/7/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 2.75 | 2.75 | 400 | 454 | 36,703 | 2042/4/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 2.75 | 2.75 | 700 | 793 | 64,124 | 2046/3/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 2.875 | 2.875 | 400 | 443 | 35,841 | 2030/9/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 3 | 3.0 | 700 | 745 | 60,201 | 2024/9/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 3.125 | 3.125 | 800 | 833 | 67,363 | 2022/9/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 3.375 | 3.375 | 950 | 1,122 | 90,669 | 2033/9/1 | | | | | | |
| | | SINGAPORE GOV'T | 3.5 | 3.5 | 1,800 | 2,023 | 163,499 | 2027/3/1 | | | | | | |
| | 小 | 計 | | — | — | — | 709,066 | — | | | | | | |
| (マレーシア) | 国債証券 | MALAYSIA GOVT | 3.418 | 3.418 | 7,000 | 7,059 | 186,660 | 2022/8/15 | | | | | | |
| | | MALAYSIA GOVT | 3.502 | 3.502 | 7,900 | 7,937 | 209,866 | 2027/5/31 | | | | | | |
| | | MALAYSIA GOVT | 3.955 | 3.955 | 5,300 | 5,485 | 145,035 | 2025/9/15 | | | | | | |
| | | MALAYSIA GOVT | 4.498 | 4.498 | 5,000 | 5,382 | 142,301 | 2030/4/15 | | | | | | |
| | | MALAYSIA GOVT | 4.736 | 4.736 | 3,000 | 3,271 | 86,494 | 2046/3/15 | | | | | | |
| | 小 | 計 | | — | — | — | 770,358 | — | | | | | | |
| (南アフリカ) | 国債証券 | REP SOUTH AFRICA | 6.5 | 6.5 | 60,000 | 41,310 | 314,369 | 2041/2/28 | | | | | | |
| | | REP SOUTH AFRICA | 6.75 | 6.75 | 16,000 | 15,986 | 121,655 | 2021/3/31 | | | | | | |
| | | REP SOUTH AFRICA | 7 | 7.0 | 59,000 | 49,536 | 376,972 | 2031/2/28 | | | | | | |
| | | REP SOUTH AFRICA | 8 | 8.0 | 27,500 | 25,462 | 193,767 | 2030/1/31 | | | | | | |
| | 小 | 計 | | — | — | — | 1,006,764 | — | | | | | | |
| | 合 | 計 | | — | — | — | 169,433,468 | — | | | | | | |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2019年12月17日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 169,433,469 | % |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,747,300 | 1.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 172,180,769 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（171,602,207千円）の投資信託財産総額（172,180,769千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.56円、1カナダドル=83.20円、1メキシコペソ=5.78円、1ユーロ=122.01円、1英ポンド=145.46円、1スウェーデンクローナ=11.69円、1ノルウェークローネ=12.15円、1デンマーククローネ=16.33円、1ポーランドズロチ=28.66円、1オーストラリアドル=75.30円、1シンガポールドル=80.80円、1マレーシアリンギット=26.44円、1南アフリカランド=7.61円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月17日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|----------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 173,190,376,657円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,588,753,970 |
| 公 社 債(評価額) | 169,433,469,191 |
| 未 収 入 金 | 1,009,996,247 |
| 未 収 利 息 | 1,093,891,665 |
| 前 払 費 用 | 64,265,584 |
| (B) 負 債 | 1,297,746,532 |
| 未 払 金 | 1,009,610,339 |
| 未 払 解 約 金 | 288,134,468 |
| 未 払 利 息 | 1,725 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 171,892,630,125 |
| 元 本 | 94,197,787,250 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 77,694,842,875 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 94,197,787,250口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,248円 |

※当期における期首元本額96,220,120,290円、期中追加設定元本額19,281,670,482円、期中一部解約元本額21,304,003,522円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2018年12月18日 至2019年12月17日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 3,862,550,604円 |
| 受 取 利 息 | 3,862,909,631 |
| 支 払 利 息 | △ 359,027 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 2,383,483,514 |
| 売 買 益 | 9,490,306,434 |
| 売 買 損 | △ 7,106,822,920 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 61,607,846 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 6,184,426,272 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 72,674,184,817 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 15,131,895,633 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △16,295,663,847 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 77,694,842,875 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 77,694,842,875 |

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|---------------------------------|-----------------|---|-----------------|
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 21,416,234,918円 | SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 105,090,890円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 653,338,604円 | 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 558,555円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,771,536,835円 | SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 748,096,890円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 890,673,798円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 123,648,852円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 136,965,014円 | SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,233,947,890円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 8,807,362円 | SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,543,643,762円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 31,937,213円 | SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,892,409,294円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 90,257,895円 | SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 6,151,843,262円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 129,206,353円 | SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,620,816円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 71,166,457円 | SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 10,187,665,851円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 151,244,659円 | 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 413,794,737円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 21,944,188円 | SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 171,764,970円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 209,755,424円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 104,353,401円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 228,446,383円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 39,453,718円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 178,930,457円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 13,885,160円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 53,824,408円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 130,916,754円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050 | 6,018,684円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 511,180,891円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 48,085,507円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 886,798円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 53,273,704円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 164,457,715円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 102,132,606円 | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 51,439,144円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 39,851,024円 | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,536,577円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 18,271,008円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,260,435,983円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 40,500,450円 | SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 21,829,928円 |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド | 563,635円 | SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 2,731,528,169円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 56,364円 | SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 1,403,654,156円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 56,364円 | SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 5,798,596,392円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 57,463円 | SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 610,297,468円 |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,659,394,714円 | SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定> | 76,064,013円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 68,956,145円 | SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 49,676,039円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 10,485,338,822円 | SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 193,332,563円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 5,453,787,775円 | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 124,745,649円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 12,406,346,106円 | SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定> | 862,645,245円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 41,825,379円 | | |

■ お知らせ

<約款変更について>

・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)