

三井住友DS・ 先進国債 インデックス・ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

第 2 期

決算日 2022年11月30日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、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ます。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2021年8月23日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、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。 外国債券パッシブ・マザーファンド 日本を除く世界各国・地域の公社債等
当ファンドの運用方法	■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ます。 ■実質組入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す。
組入制限	当ファンド ■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、制限を設けません。 外国債券パッシブ・マザーファンド ■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	■年1回（原則として毎年11月30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。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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DS・先進国債インデックス・ファンド

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

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債比率	純資産額
	(分配落)	税金	期騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日) 2021年8月23日	円 10,000	円 -	% -	100.00	% -	% -	百万円 1
1期(2021年11月30日)	10,037	0	0.4	100.53	0.5	98.5	6
2期(2022年11月30日)	10,037	0	0.0	101.30	0.8	98.4	80

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

※F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) とは、FTSE Fixed income LLCが算出し公表している指数 (F T S E 世界国債インデックス) をもとに、委託会社が計算したものです。F T S E 世界国債インデックスに関する知的所有権その他一切の権利はFTSE Fixed income LLCに帰属します。また、同社は当ファンドの運用に関して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) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2021年11月30日	円 10,037	% -	100.53	% -	% 98.5
12月末	10,090	0.5	101.16	0.6	98.8
2022年1月末	9,914	△1.2	99.43	△1.1	99.2
2月末	9,721	△3.1	97.63	△2.9	99.4
3月末	10,039	0.0	100.86	0.3	99.0
4月末	10,058	0.2	101.11	0.6	99.0
5月末	9,995	△0.4	100.46	△0.1	98.7
6月末	10,226	1.9	102.89	2.4	98.7
7月末	10,286	2.5	103.65	3.1	99.0
8月末	10,159	1.2	102.30	1.8	98.4
9月末	10,064	0.3	101.41	0.9	98.6
10月末	10,349	3.1	104.45	3.9	98.6
(期末) 2022年11月30日	10,037	0.0	101.30	0.8	98.4

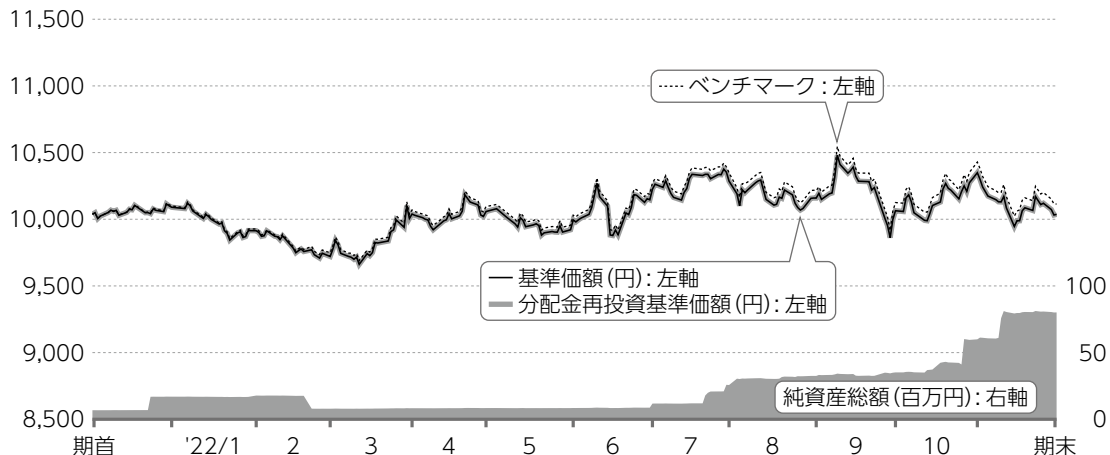
※騰落率は期首比です。

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

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年12月1日から2022年11月30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	10,037円
期末	10,037円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	0.0% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

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

※FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、FTSE Fixed income LLCが算出し公表している指数(FTSE世界国債インデックス)をもとに、委託会社が計算したものです。FTSE世界国債インデックスに関する知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed income LLCに帰属します。また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資することにより、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。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

- 米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇したこと

下落要因

- 欧米金利が上昇(債券価格は下落)したこと

投資環境について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

債券市場は下落しました。為替市場は米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

債券市場

エネルギー価格の高騰や、人手不足に起因する供給制約を背景にインフレ上昇が顕在化する中、グローバルに中央銀行の急速な金融引き締めが意識され、米欧金利は上昇しました。

為替市場

グローバルに金利先高観が強まる中、米ドルを中心に対円で投資通貨は上昇しました。また、日本銀行の金融緩和姿勢を堅持したことも円売りに拍車をかけ、投資通貨を対円で押し上げました。

ポートフォリオについて(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当ファンド

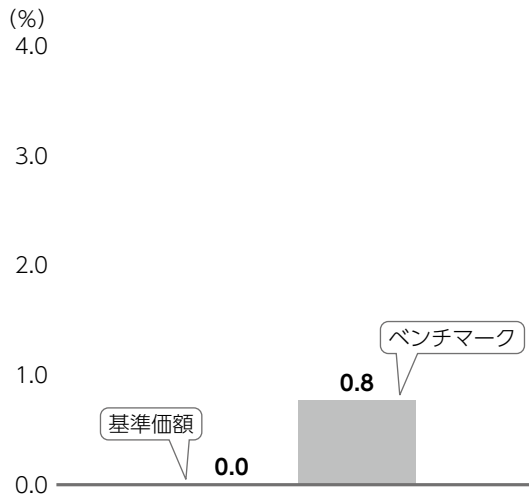
期を通じて主要投資対象である「外国債券パッシブ・マザーファンド」を高位に組み入れました。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

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

基準価額の騰落率は0.0%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+0.8%を0.8%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 資金流入によるタイミング効果
- 信託報酬等の費用が生じたため

分配金について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第2期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	115

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

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

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き主要投資対象である「外国債券パッシブ・マザーファンド」を高位に組み入れます。

外国債券パッシブ・マザーファンド

債券相場は、インフレのピークアウトの兆しや利上げに伴う景気減速が進む中で、F R B(米連邦準備制度理事会)の利上げペース鈍化など、グローバルに中銀のタカ派(インフレ抑制を重視する立場)姿勢が緩むことで、金利の上昇余地は限定的になると予想します。

為替相場は、日本の貿易赤字拡大などの

構造的な円安圧力が残るとみられるものの、グローバルに中銀のタカ派姿勢が緩むことも見込まれるなか、来年にかけては、海外通貨高・円安圧力が後退に向かう展開を予想します。

上記見通しのもと、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(投資資金の平均回収期間)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、日々の資金流入出に対応し、迅速なりバランスを行います。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

1万口当たりの費用明細(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	30円	0.297%	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) <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">期中の平均基準価額は10,057円です。</div>
(投信会社)	(14)	(0.137)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(14)	(0.137)	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)	(2)	(0.022)	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) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	4	0.042	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)	(4)	(0.037)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.004)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	34	0.339	

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

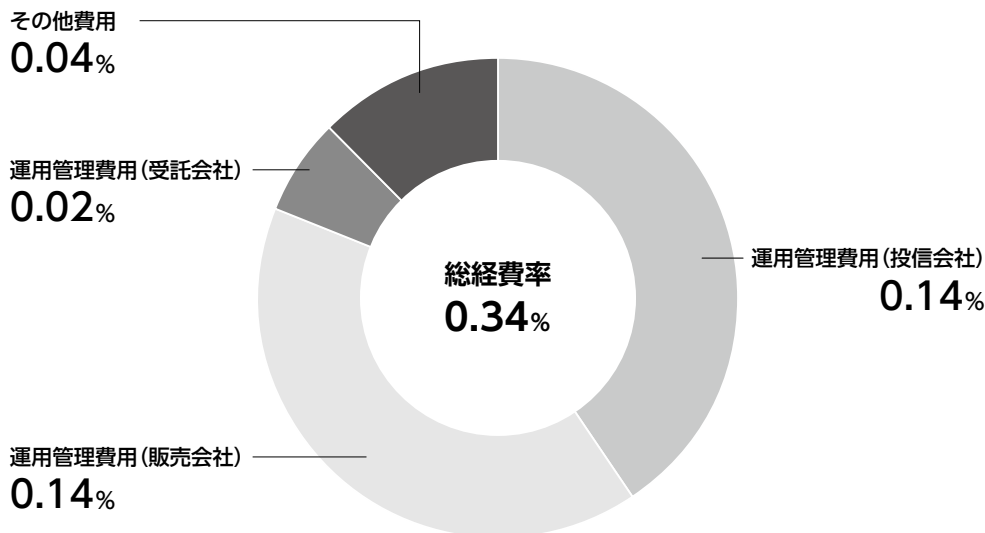
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は0.34%です。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年12月1日から2022年11月30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 43,460	千円 87,991	千口 6,750	千円 13,209

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年12月1日から2022年11月30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。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

期首 (元)	残高 (本)	当 元	期 設 定 本	当 元	期 解 約 本	期 末 (元)	残高 (本)	取 引 の 理 由
	百万円 1		百万円 -		百万円 1		百万円 -	当初設定時または当初運用時における取得等

■ 組入れ資産の明細 (2022年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)		期 末	
	口 数	金 額	口 数	評 価 額
外国債券パッシブ・マザーファンド	千口 3,423		千口 40,133	千円 80,186

※外国債券パッシブ・マザーファンドの期末の受益権総口数は77,181,314,549口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30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 80,186	% 100.0
コール・ローン等、その他	0	0.0
投資信託財産総額	80,187	100.0

※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(153,143,085千円)の投資信託財産総額(154,237,308千円)に対する比率は99.3%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローナ=13.14円、1メキシコ・ペソ=7.222円、1オフショア・人民元=19.415円、1マレーシア・リンギット=30.789円、1ポーランド・ズロチ=30.711円、1ユーロ=143.58円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	80,187,223円
コール・ローン等	638
外国債券バッシブ・マザーファンド(評価額)	80,186,585
(B) 負 債	51,363
未払信託報酬	50,512
その他未払費用	851
(C) 純資産総額(A-B)	80,135,860
元 本	79,842,763
次期繰越損益金	293,097
(D) 受益権総口数	79,842,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,037円

※当期における期首元本額6,762,046円、期中追加設定元本額86,535,230円、期中一部解約元本額13,454,513円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△1,123,880円
売 買 益	291,799
売 買 損	△1,415,679
(B) 信託報酬等	△ 67,886
(C) 当期損益金(A+B)	△1,191,766
(D) 前期繰越損益金	10,573
(E) 追加信託差損益金	1,474,290
(配当等相当額)	(359,633)
(売買損益相当額)	(1,114,657)
(F) 合 計(C+D+E)	293,097
次期繰越損益金(F)	293,097
追加信託差損益金	1,474,290
(配当等相当額)	(450,582)
(売買損益相当額)	(1,023,708)
分配準備積立金	472,369
繰越損益金	△1,653,562

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

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

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	460,737円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	450,582
(d) 分配準備積立金	11,632
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	922,951
1万口当たり当期分配対象額	115.60
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当	期

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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年12月18日から2021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。

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

■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
14期（2017年12月18日）	円	%		%	%	百万円
	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
15期（2018年12月17日）	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
16期（2019年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
17期（2020年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
18期（2021年12月17日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

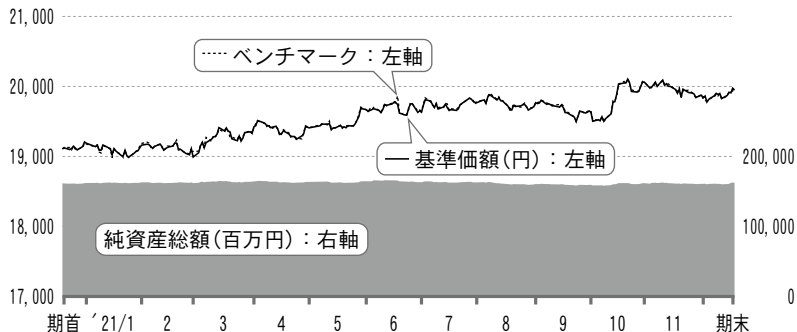
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2020年12月17日	円 19,109	% —	193.48	% —	% 99.0
12月末	19,189	0.4	194.18	0.4	98.6
2021年1月末	19,162	0.3	194.26	0.4	98.7
2月末	18,992	△0.6	193.11	△0.2	98.8
3月末	19,424	1.6	196.58	1.6	98.8
4月末	19,409	1.6	196.54	1.6	98.7
5月末	19,669	2.9	199.12	2.9	98.9
6月末	19,632	2.7	198.94	2.8	99.1
7月末	19,768	3.4	200.30	3.5	98.9
8月末	19,768	3.4	200.22	3.5	98.8
9月末	19,635	2.8	198.94	2.8	99.0
10月末	20,063	5.0	203.09	5.0	98.8
11月末	19,840	3.8	200.65	3.7	98.5
(期 末) 2021年12月17日	円 19,947	% 4.4	201.87	% 4.3	% 99.1

※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（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額等の推移



期首	19,109円
期末	19,947円
騰落率	+4.4%

※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、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の国債に分散投資し、ベンチマークであるF T S E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	・グローバルに金利先高観が強まる中、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇したこと
下落要因	・グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利が上昇（債券価格は下落）したこと

▶ **投資環境について（2020年12月18日から2021年12月17日まで）**

債券市場は米国、欧州ともに下落しました。為替市場は米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

債券市場

米欧を中心に新型コロナウイルスワクチンの接種が進展し、経済再開の動きが本格化する中、グローバルに中央銀行の将来の金融緩和策の縮小が意識され、米欧金利は上昇（債券価格は下落）しました。また、エネルギー価格の高騰や、人手不足に起因する供給制約を背景にインフレ率上昇への懸念が強まったことも、米欧金利の上昇要因となりました。

為替市場

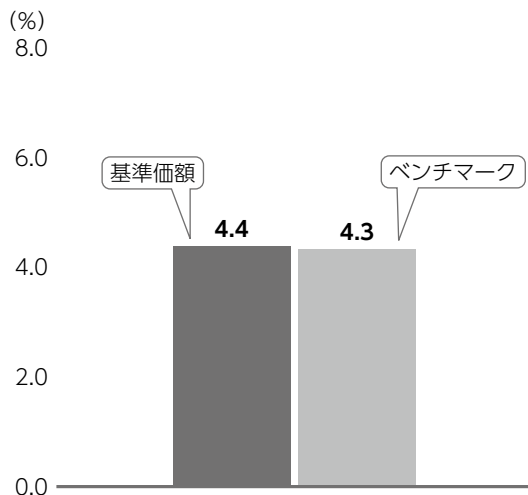
米欧を中心とした経済再開の本格化やインフレ率上昇懸念の高まりから、グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、米欧の金利先高観が強まり、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇しました。

▶ **ポートフォリオについて（2020年12月18日から2021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（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【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+4.4%となり、ベンチマークの騰落率+4.3%と0.1%の上方乖離となりました。

上方乖離要因

・キャッシュフローに伴う売買のタイミング

2 今後の運用方針

米国では、当面は変異ウイルスの感染拡大が警戒されますが、景気の回復や金融政策の正常化を背景に、長期金利は緩やかに水準を切り上げていく見通しです。ユーロ圏でも、資産購入ペースの減速など金融政策の正常化観測が長期金利の上昇要因となっていく見通しですが、当面はECB（欧州中央銀行）が緩和的な姿勢を維持していることや感染再拡大への懸念から、長期金利の上昇ペースは緩やかになると予想します。

為替相場は、米ドル・円は、米国の景気回復や金融政策の正常化を背景に、米ドル高・円安圧力がかかる見通しです。ユーロ・米ドルに関しては、米国とユーロ圏の中央銀行の政策姿勢や景気格差などを反映し、ユーロ安・米ドル高圧力がかかる見通しです。

上記見通しのもと、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、迅速なりバランスを行います。

■ 1万口当たりの費用明細（2020年12月18日から2021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付金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保 管 費 用）	(7)	(0.037)	
（そ の 他）	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.038	

期中の平均基準価額は19,551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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月18日から2021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	千アメリカ・ドル 195,849	千アメリカ・ドル 163,553
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 12,407	千カナダ・ドル 14,579
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 1,902	千オーストラリア・ドル 23,215
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,174	千シンガポール・ドル 932
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 7,602	千イギリス・ポンド 16,887
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 9,140	千イスラエル・シェケル 8,450
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 1,771	千デンマーク・クローネ 8,663
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 1,555	千ノルウェー・クローネ 2,049
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 2,614	千スウェーデン・クローナ 8,806
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 20,788	千メキシコ・ペソ 52,993
	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 39,140	千オフショア・人民元 -
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 4,583	千マレーシア・リンギット 7,324
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 35,968	千ポーランド・ズロチ 40,616
	国	ユ ー ロ		千ユーロ
アイルランド		国 債 証 券	1,270	1,111
オランダ		国 債 証 券	4,395	5,272
ベルギー		国 債 証 券	4,624	8,181

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外 国	フ ラ ン ス	国 債 証 券	26,142	32,170
	ド イ ツ	国 債 証 券	22,150	24,196
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	7,855	8,933
	イ タ リ ア	国 債 証 券	15,196	23,507
	フィンランド	国 債 証 券	1,451	3,116
	オーストリア	国 債 証 券	2,517	4,650

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等（2020年12月18日から2021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 （2020年12月18日から2021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（2021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	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 644,020	千アメリカ・ドル 672,251	千円 76,549,238	% 47.1	% —	% 21.6	% 17.3	% 8.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 32,300	千カナダ・ドル 35,262	3,142,202	1.9	—	1.0	0.7	0.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 29,350	千オーストラリア・ドル 32,046	2,618,502	1.6	—	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,950	千シンガポール・ドル 8,624	720,460	0.4	—	0.3	0.0	0.1

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
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 48,450	千イギリス・ポンド 64,546	9,793,053	6.0	—	4.8	0.7	0.6
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シェケル 18,400	千イスラエル・シェケル 20,818	763,243	0.5	—	0.2	0.1	0.2
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 31,900	千デンマーク・クローネ 41,093	712,971	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 29,700	千ノルウェー・クローネ 30,253	383,313	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 33,000	千スウェーデン・クローナ 36,917	465,525	0.3	—	0.1	0.1	0.1
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 201,000	千メキシコ・ペソ 208,282	1,139,138	0.7	—	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 39,000	千オフショア・人民元 39,234	700,385	0.4	—	0.2	0.2	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 26,900	千マレーシア・リンギット 27,865	753,031	0.5	—	0.3	0.1	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 27,600	千ポーランド・ズロチ 27,894	776,753	0.5	—	0.2	0.1	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	9,000	10,300	1,328,861	0.8	—	0.6	0.2	0.0
オランダ	19,500	23,835	3,074,959	1.9	—	1.3	0.4	0.2
ベルギー	22,750	27,521	3,550,490	2.2	—	1.6	0.5	0.1
フランス	105,370	123,265	15,902,433	9.8	—	6.3	2.9	0.6
ドイツ	78,500	91,073	11,749,439	7.2	—	4.5	2.0	0.7
スペイン	60,950	73,322	9,459,337	5.8	—	3.7	1.7	0.4
イタリア	93,470	109,645	14,145,323	8.7	—	5.5	2.3	0.9
フィンランド	6,300	7,279	939,103	0.6	—	0.4	0.1	0.1
オーストリア	14,500	17,402	2,245,153	1.4	—	0.9	0.3	0.2
合 計	—	—	160,912,922	99.1	—	55.6	30.4	13.1

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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

区 分	銘 柄	種 類	期				末	
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,800	3,872	441,000	2023/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,792	318,002	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,700	2,749	313,032	2023/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,000	5,160	587,671	2023/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,200	4,370	497,623	2023/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,400	2,811	320,088	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,400	3,138	357,343	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	700	933	106,243	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,700	5,935	675,878	2024/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	5,100	5,325	606,388	2024/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,000	3,806	433,441	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,600	5,828	663,701	2024/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	3,600	4,722	537,777	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	3,300	4,038	459,906	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	5,100	5,298	603,374	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,500	3,613	411,465	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,500	4,210	479,497	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	4,100	4,549	518,072	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,900	5,081	578,624	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,000	3,621	412,357	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,300	4,445	506,239	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,700	4,384	499,229	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,000	4,176	475,584	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	5,081	578,641	2022/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	4,074	463,929	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	3,000	3,046	346,959	2023/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,700	3,272	372,612	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,700	4,792	545,764	2026/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,900	3,233	368,145	2046/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	3,041	346,344	2023/02/28	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	3,040	346,266	2023/03/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,048	347,079	2023/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	14,950	15,246	1,736,131	2026/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	4,015	457,295	2046/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,050	347,331	2023/05/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	500	506	57,701	2023/06/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	3,034	345,586	2023/07/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,500	2,533	288,543	2023/08/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,850	3,041	346,305	2046/08/15	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,000	3,042	346,399	2023/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,056	348,080	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	5,193	591,366	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,100	3,190	363,269	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,600	4,299	489,577	2046/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	3,096	352,616	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,631	527,407	2027/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,200	2,272	258,780	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	3,055	347,901	2047/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	6,500	6,703	763,366	2024/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,000	2,059	234,465	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,000	2,062	234,811	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,900	5,196	591,742	2027/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,200	2,696	307,014	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,397	386,923	2024/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,100	4,224	480,999	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,500	3,620	412,227	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	4,429	504,333	2027/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	4,467	508,663	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,800	3,905	444,704	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	4,140	471,453	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	800	831	94,654	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,764	200,921	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,643	528,779	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,693	306,655	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,100	3,224	367,116	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,200	1,227	139,722	2023/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,563	405,741	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,800	5,215	593,931	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,821	435,206	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,000	4,104	467,418	2023/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,113	240,620	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,300	2,422	275,873	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,900	2,989	340,374	2023/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,200	2,336	266,090	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	9,000	9,866	1,123,541	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	3,030	345,026	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,000	1,032	117,623	2023/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,100	1,169	133,143	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,600	4,874	555,020	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,070	235,806	2023/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,947	563,333	2028/08/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	5,400	6,674	760,020	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,100	2,228	253,716	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	3,939	448,642	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	4,000	4,286	488,110	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,000	1,042	118,663	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,324	378,613	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	3,244	369,486	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	4,098	466,672	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	2,087	237,658	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,900	1,975	224,963	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,673	304,422	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,400	4,667	531,440	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,864	326,135	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,938	334,661	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,800	4,720	537,567	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,700	3,834	436,688	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	8,500	8,980	1,022,639	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	13,300	13,919	1,584,984	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,800	3,933	447,898	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,100	4,399	500,966	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,703	193,990	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	6,200	6,348	722,867	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	850	870	99,159	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,450	4,545	517,646	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	3,786	431,189	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	7,100	7,171	816,561	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,900	3,981	453,352	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	5,500	5,596	637,244	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	4,125	469,782	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	2,111	240,404	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	204	23,256	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	813	92,675	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,500	4,551	518,256	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	2,876	327,552	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,992	226,938	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,500	1,477	168,222	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,500	1,455	165,773	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,400	2,466	280,822	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,000	1,015	115,648	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	5,000	4,988	568,012	2023/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,507	171,670	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,000	1,013	115,377	2025/01/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,000	3,035	345,651	2023/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,000	4,052	461,437	2022/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,500	7,058	803,782	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	4,380	498,795	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,092	352,086	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,884	328,451	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	7,700	7,673	873,747	2023/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,938	334,576	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,888	328,932	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,400	2,334	265,857	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	4,300	4,273	486,654	2023/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,400	4,227	481,412	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,300	3,205	365,054	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,700	4,481	510,350	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	8,800	8,264	941,070	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	3,986	453,963	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	8,000	7,943	904,510	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,939	220,853	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	7,800	7,417	844,602	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	5,700	5,651	643,503	2023/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	7,000	6,704	763,460	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	3,013	343,118	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	8,500	8,310	946,339	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	5,799	660,393	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	6,700	6,486	738,606	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,943	221,297	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,912	331,679	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,100	2,020	230,047	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,924	788,471	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,000	2,978	339,205	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	7,700	7,608	866,382	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,800	1,797	204,644	2022/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,300	3,367	383,459	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,436	505,128	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,700	4,843	551,576	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,600	3,511	399,810	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	5,900	5,777	657,865	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,473	509,412	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,400	4,371	497,836	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,100	3,087	351,521	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,200	5,179	589,808	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	4,215	480,061	2026/11/30

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	6,000	6,013	684,709	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	800	876	99,752	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,199	136,616	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,000	1,278	145,611	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	630	71,782	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	431	49,154	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	254	28,937	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	300	416	47,400	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	428	48,775	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	700	986	112,314	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	600	870	99,178	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	1,273	145,037	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	666	75,883	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	836	95,260	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	1,334	151,986	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	426	48,545	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,500	1,974	224,875	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	1,213	138,156	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	954	108,695	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,297	261,632	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	300	344	39,255	2042/11/15
	小 計		—	644,020	672,251	76,549,238	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 330	29,439	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	500	723	64,494	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	1,450	2,125	189,361	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,500	2,085	185,799	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,300	1,769	157,641	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,020	180,018	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,100	2,175	193,856	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,040	92,680	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,400	1,724	153,699	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,900	2,944	262,354	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	600	594	52,939	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,100	1,113	99,213	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,200	1,223	108,985	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	733	65,392	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,900	2,039	181,729	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,027	91,601	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,025	180,497	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	5,900	5,890	524,934	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,640	235,318	2025/09/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	1,035	92,243	2064/12/01
	小 計		—	32,300	35,262	3,142,202	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	5.5000	千オーストラリア・ドル 1,400	千オーストラリア・ドル 1,495	122,163	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	2,500	2,618	213,996	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,459	119,252	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	1,100	1,429	116,785	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,388	113,484	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	2,650	2,977	243,307	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,200	1,498	122,415	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	894	73,104	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,100	1,182	96,619	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	2,550	3,011	246,042	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	2,800	2,936	239,952	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,200	1,379	112,699	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	216	17,711	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	3,100	3,386	276,711	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	1,850	1,991	162,760	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,900	2,884	235,724	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	800	718	58,668	2051/06/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	600	576	47,100	2025/11/21	
	小 計		—	29,350	32,046	2,618,502	—
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,500	千シンガポール・ドル 1,659	138,592	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	700	738	61,688	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	550	45,967	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	454	37,967	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,200	1,237	103,345	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	750	874	73,055	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	802	67,015	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,200	1,258	105,135	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	700	749	62,629	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	200	200	16,737	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	100	99	8,324	2026/11/01
	小 計		—	7,950	8,624	720,460	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 650	千イギリス・ポンド 889	134,884	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	943	143,123	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	1,300	1,485	225,342	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,050	1,519	230,485	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,200	1,922	291,748	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,700	3,383	513,335	2055/12/07

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,500	2,583	391,933	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,092	165,754	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,350	2,256	342,300	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,555	236,044	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,631	247,546	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,250	1,923	291,837	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,100	1,584	240,337	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,700	3,479	527,862	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	1,098	166,655	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	2,102	318,974	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	2,315	351,327	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	2.2500	2,700	2,785	422,543	2023/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,450	3,024	458,881	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	600	636	96,588	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,650	2,505	380,078	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	1,100	1,159	175,957	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	2,644	401,252	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,300	1,357	205,930	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,700	1,901	288,431	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	900	1,002	152,139	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	1,200	1,246	189,055	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	0.7500	2,650	2,666	404,607	2023/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	900	962	146,054	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	800	810	122,993	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	850	1,011	153,498	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	602	91,426	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	1,000	1,018	154,472	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	800	804	122,031	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,749	265,471	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	500	499	75,711	2023/01/31
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,500	1,475	223,897	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.6250	600	575	87,304	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,600	1,523	231,175	2031/07/31
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	800	817	124,058	2039/01/31
	小 計		—	48,450	64,546	9,793,053	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	4,100	5,358	196,456	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,900	2,980	109,271	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	3,300	4,218	154,657	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	1,500	1,651	60,548	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.1500	6,600	6,609	242,309	2023/07/31
小 計		—	18,400	20,818	763,243	—	

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 9,800	千デンマーク・クローネ 17,825	309,272	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5000	3,000	3,122	54,178	2023/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	3,000	3,261	56,594	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	10,100	10,600	183,919	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	4,000	4,231	73,409	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	2,000	2,051	35,595	2052/11/15
小 計			—	31,900	41,093	712,971	—
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 4,000	千ノルウェー・クローネ 4,052	51,341	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	4,000	4,153	52,618	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	3,000	3,034	38,441	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,500	3,506	44,431	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	9,000	9,267	117,416	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	4,200	4,265	54,049	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	2,000	1,974	25,014	2030/08/19
小 計			—	29,700	30,253	383,313	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローナ 4,600	千スウェーデン・クローナ 7,008	88,373	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	7,000	7,230	91,179	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	5,000	5,450	68,724	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	6,400	6,720	84,743	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	4,000	4,184	52,767	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	6,000	6,323	79,737	2029/11/12
小 計			—	33,000	36,917	465,525	—
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 34,000	千メキシコ・ペソ 34,633	189,418	2023/12/07
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	32,000	34,470	188,523	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	25,000	25,308	138,414	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	23,000	24,601	134,551	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	40,000	42,603	233,005	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	5,000	5,131	28,066	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	18,000	18,440	100,855	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	19,000	18,056	98,755	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	5,000	5,036	27,546	2047/11/07
小 計			—	201,000	208,282	1,139,138	—
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 6,000	千オフショア・人民元 5,998	107,077	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	8,000	7,983	142,519	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5600	8,000	8,013	143,052	2023/10/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	8,000	8,014	143,063	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	3,000	3,161	56,434	2051/04/12

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	6,000	6,063	108,237	2031/05/27
	小 計		-	39,000	39,234	700,385	-
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 7,700	千マレーシア・リンギット 7,780	210,259	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	5,000	5,301	143,269	2030/04/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	3.9550	5,300	5,481	148,119	2025/09/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,400	6,767	182,876	2046/03/15
	MALAYSIA GOVT	国債証券	3.4780	2,500	2,535	68,507	2024/06/14
	小 計		-	26,900	27,865	753,031	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 6,100	千ポーランド・ズロチ 7,141	198,867	2029/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,843	162,726	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,000	3,989	111,096	2023/01/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,463	124,281	2024/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,800	2,599	72,395	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,544	43,010	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,400	2,311	64,375	2023/04/25
	小 計		-	27,600	27,894	776,753	-
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	800	954	123,183	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.9000	500	528	68,167	2023/03/20
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	500	545	70,415	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	727	93,860	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	1,000	1,324	170,837	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	1,000	1,064	137,300	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	360	46,461	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	700	752	97,038	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	1,000	1,126	145,385	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	564	72,852	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	1,600	1,748	225,540	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	603	77,818	2050/05/15
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	958	123,661	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,800	2,916	376,262	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	500	524	67,674	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	2,288	295,292	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	600	779	100,557	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,600	1,663	214,625	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,069	137,918	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,600	2,698	348,141	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,700	1,750	225,850	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,784	230,184	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	428	55,245	2027/07/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ベルギー	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,000	1,014	130,818	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,619	208,889	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	523	67,474	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,869	241,198	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,900	1,946	251,163	2030/07/15
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,100	1,516	195,651	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,637	211,238	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	1,200	2,039	263,141	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	700	854	110,206	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	500	709	91,559	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	1,300	1,357	175,149	2023/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	800	865	111,716	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	1,362	175,811	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	271	34,990	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	839	108,246	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,433	184,932	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	1,251	161,404	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,800	1,923	248,129	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	850	1,040	134,248	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	743	95,885	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,068	137,839	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	1,300	1,342	173,207	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	728	94,016	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	400	468	60,377	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	1,075	138,783	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	400	456	58,888	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	1,300	1,413	182,384	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	500	630	81,285	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	700	715	92,343	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	300	296	38,243	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	200	179	23,130	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	1,300	1,299	167,677	2031/10/22
	フランス	FRANCE OAT.	国債証券	8.5000	600	674	87,003
FRANCE O. A. T.		国債証券	6.0000	3,000	3,768	486,237	2025/10/25
FRANCE O. A. T.		国債証券	5.5000	2,750	3,930	507,016	2029/04/25
FRANCE O. A. T.		国債証券	5.7500	400	650	83,935	2032/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.7500	2,200	3,538	456,439	2035/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	1,370	2,714	350,245	2055/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	2,000	3,224	415,982	2038/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.2500	1,000	1,091	140,819	2023/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.5000	2,300	4,061	523,914	2041/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	1,400	2,924	377,282	2060/04/25

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	2,500	2,937	378,928	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	3,850	4,568	589,355	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	1,700	2,727	351,905	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	4,200	4,344	560,535	2023/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	3,400	3,640	469,662	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	2,600	2,780	358,660	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	3,500	4,295	554,105	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	2,900	3,004	387,578	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	2,050	2,172	280,225	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,550	2,926	377,502	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,500	3,650	470,928	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,400	3,873	499,740	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	800	1,078	139,136	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	2,400	2,481	320,117	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,800	2,244	289,578	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	2,500	2,691	347,259	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	2,200	2,962	382,254	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	2,000	2,016	260,125	2023/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,528	455,223	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,200	3,623	467,408	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,500	3,751	483,973	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,800	4,868	628,103	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,400	2,933	378,459	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	800	843	108,825	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,933	249,452	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,500	4,562	588,626	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,349	432,140	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,100	3,161	407,889	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,900	3,928	506,837	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,925	248,462	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	100	85	11,006	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,800	3,794	489,546	2031/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	1,200	1,374	177,354	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	1,000	1,403	181,086	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	1,000	1,385	178,769	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,600	2,171	280,141	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	500	779	100,539	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	900	1,399	180,605	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	600	994	128,290	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,800	2,985	385,124	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	950	1,715	221,346	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,650	3,211	414,261	2040/07/04

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	700	1,205	155,578	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,200	3,550	458,051	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	2,100	2,154	277,937	2023/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.0000	2,000	2,091	269,821	2023/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	1,300	1,341	173,019	2023/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	3,600	3,794	489,575	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	2,200	2,319	299,207	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,500	4,144	534,649	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,500	2,595	334,900	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,359	175,442	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	2,050	2,175	280,653	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,100	3,246	418,859	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	2,300	2,399	309,520	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,400	3,606	465,276	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,650	2,229	287,661	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	2,236	288,582	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	900	947	122,196	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	800	843	108,852	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,500	3,627	468,043	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,700	2,725	351,594	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,348	173,967	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,800	3,896	502,699	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	5,800	6,015	776,070	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,000	2,073	267,522	2031/08/15
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,900	1,918	247,477	2023/04/14
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,600	1,621	209,245	2023/10/13
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,300	1,322	170,562	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	600	612	78,995	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	3,500	3,579	461,762	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,800	1,845	238,067	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	800	822	106,123	2026/10/09
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	2,200	3,145	405,814	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	500	524	67,616	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,500	2,341	302,086	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,650	2,489	321,166	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,500	2,567	331,249	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	3,000	3,342	431,182	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	2,543	328,131	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	1,800	2,129	274,725	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	643	83,008	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.4000	2,250	2,401	309,860	2023/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	2,031	262,038	2028/10/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,000	1,863	240,463	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	1,400	1,544	199,213	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	2,100	2,297	296,368	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	1,700	1,816	234,333	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	2,400	2,635	339,945	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	1,700	1,952	251,878	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	2,600	2,854	368,260	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.4000	2,000	2,188	282,335	2023/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	1,400	1,975	254,813	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	1,300	2,083	268,744	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	2,700	2,905	374,890	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	1,200	1,308	168,817	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	500	604	77,965	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	2,600	2,836	365,973	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	2,200	2,400	309,703	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	1,250	1,720	221,900	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	1,600	1,751	225,897	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	2,900	3,191	411,758	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	2,700	3,119	402,432	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	700	713	92,056	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	1,025	132,348	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	400	420	54,241	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	300	288	37,206	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	1,000	1,013	130,761	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	3,000	3,264	421,127	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	400	376	48,626	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	1,010	130,389	2031/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	9.0000	300	352	45,450	2023/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	400	537	69,286	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	1,700	2,302	297,071	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,000	2,558	330,131	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	2,300	2,458	317,128	2023/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	2,200	2,352	303,507	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	2,200	3,227	416,432	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	1,700	2,548	328,738	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	2,070	3,004	387,672	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	2,600	3,555	458,644	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,800	2,798	361,010	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,500	2,709	349,610	2023/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,000	1,161	149,896	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,700	2,685	346,446	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,800	2,132	275,073	2026/03/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,104	142,505	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,600	2,555	329,716	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	2,300	2,542	328,015	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	4,400	5,384	694,671	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	600	645	83,335	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	1,500	1,972	254,456	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	2,700	2,840	366,509	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,300	1,399	180,534	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,200	1,276	164,695	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	1,550	1,866	240,804	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,000	2,035	262,584	2023/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	500	565	72,906	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	800	840	108,412	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6500	2,000	2,037	262,857	2023/10/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	600	701	90,518	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	1,100	1,262	162,858	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	2,300	2,534	327,027	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	3,000	3,148	406,207	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	1,400	1,910	246,476	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	1,500	1,640	211,703	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,800	1,881	242,711	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	1,300	1,603	206,925	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	3,900	4,271	551,098	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,000	2,034	262,434	2023/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,000	1,050	135,474	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,300	1,501	193,720	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	2,100	2,300	296,831	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	850	1,069	137,943	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,100	1,607	207,330	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	3,000	3,529	455,340	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	1,000	1,087	140,346	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	900	1,132	146,103	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	2,700	2,735	352,865	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	1,700	1,749	225,674	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	1,800	1,822	235,113	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	200	205	26,475	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	900	1,032	133,224	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	1,000	1,064	137,364	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	800	825	106,504	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	1,000	1,015	131,003	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	1,500	1,470	189,698	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	2,000	2,001	258,234	2031/04/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	600	699	90,303	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	483	62,356	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	1,000	1,499	193,450	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,000	1,029	132,841	2023/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,064	137,280	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	500	542	69,955	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	300	386	49,852	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	400	422	54,531	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	848	109,416	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	300	303	39,114	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,381	178,195	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	500	806	104,054	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	500	616	79,560	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	1,526	196,928	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	600	983	126,904	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.7500	1,000	1,045	134,881	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	300	388	50,150	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	800	853	110,086	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	1,068	137,830	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	953	123,061	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	900	1,152	148,632	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	1,100	1,111	143,447	2023/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	800	840	108,394	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	700	748	96,547	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	580	74,863	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	912	117,734	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	1,100	1,197	154,455	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	200	280	36,199	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	150	148	19,188	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	800	806	104,036	2031/02/20
小 計			—	410,340	483,645	62,395,101	—
合 計			—	—	—	160,912,922	—

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	160,912,922	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,496,304	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	164,409,226	100.0

※期末における外貨建資産（162,014,412千円）の投資信託財産総額（164,409,226千円）に対する比率は98.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.87円、1カナダ・ドル=89.11円、1オーストラリア・ドル=81.71円、1シンガポール・ドル=83.54円、1イギリス・ポンド=151.72円、1イスラエル・シェケル=36.661円、1デンマーク・クローネ=17.35円、1ノルウェー・クローネ=12.67円、1スウェーデン・クローナ=12.61円、1メキシコ・ペソ=5.469円、1オフショア・人民元=17.851円、1マレーシア・リンギット=27.023円、1ポーランド・ズロチ=27.846円、1ユーロ=129.01円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	164,409,226,262円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,578,784,960
公 社 債(評価額)	160,912,922,160
未 収 利 息	888,434,735
前 払 費 用	29,084,407
(B) 負 債	2,015,915,423
未 払 金	1,724,888,171
未 払 解 約 金	291,025,136
そ の 他 未 払 費 用	2,116
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	162,393,310,839
元 本	81,412,102,331
次 期 繰 越 損 益 金	80,981,208,508
(D) 受 益 権 総 口 数	81,412,102,331口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,947円

※当期における期首元本額84,615,543,547円、期中追加設定元本額10,172,463,204円、期中一部解約元本額13,375,904,420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条の第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条の第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2020年12月18日 至2021年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,166,650,876円
受 取 利 息	3,167,076,148
支 払 利 息	△ 425,272
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,840,609,519
売 買 益	10,688,072,440
売 買 損	△ 6,847,462,921
(C) そ の 他 費 用 等	△ 61,469,784
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	6,945,790,611
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,074,312,782
(F) 解 約 差 損 益 金	△12,777,364,915
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,738,470,030
(H) 合 計(D + E + F + G)	80,981,208,508
次 期 繰 越 損 益 金(H)	80,981,208,508

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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	24,487,844,372円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,563,065,943円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	760,198,503円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,603,737,345円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,119,007,643円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	155,624,983円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,495,736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)	6,821,569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>	117,631,749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)	29,780,404円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548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)	100,943,914円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,438,731,860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)	215,809,603円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,547,910,459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)	146,490,369円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,874,996,538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)	247,645,688円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,113,488円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,237,337,020円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,454,990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)	331,971,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	112,630,498円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,013,857円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,175,759円
イオン・バランス戦略ファンド	117,794,452円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	96,352,849円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	49,304,278円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	119,676,115円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	104,874,447円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	34,468,587円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	117,826,123円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,046,403,883円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	227,846,301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>	648,746,322円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	12,061,797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>	960,695,213円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	35,271,630円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,134,108,974円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	23,882,832円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	404,802,053円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,248,709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>	51,663,081円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	163,477,935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>	141,011,485円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	3,442,227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>	295,647,332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>	2,390,473,483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>	321,381,894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>	44,105,389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>	1,395,550,617円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,335,907,258円		

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。