

■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：2002年4月1日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、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標として運用を行います。
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。 パッシブ外国債券マザーファンド 外国の公社債
当ファンドの運用方法	■主としてマザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、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標として運用を行います。 ■外貨建資産に対する対円での為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、市況動向等により弾力的、機動的に対円での為替ヘッジを行う場合があります。 ■対象インデックス（ベンチマーク）との連動性を維持するため、債券先物取引等を利用することがあります。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、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には、制限を設けません。 パッシブ外国債券マザーファンド ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	■年1回（原則として毎年3月31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、経費控除後の繰越分も含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">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。)</div>

三井住友・ DC外国債券 インデックスファンド

【運用報告書(全体版)】

(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

第 **21** 期

決算日 2023年3月31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、外国の公社債への分散投資を行い、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標として運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。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）

三井住友・DC外国債券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。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) FTSE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	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
17期(2019年4月1日)	19,878	0	2.5	456.92	2.5	99.0	61,358
18期(2020年3月31日)	20,871	0	5.0	480.58	5.2	98.9	66,845
19期(2021年3月31日)	21,685	0	3.9	501.12	4.3	99.0	72,530
20期(2022年3月31日)	22,158	0	2.2	514.02	2.6	99.1	76,215
21期(2023年3月31日)	21,890	0	△1.2	507.64	△1.2	98.7	77,238

※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) FTSE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
		騰落率		騰落率	
(期首) 2022年3月31日	円	%		%	%
	22,158	—	514.02	—	99.1
4月末	22,202	0.2	514.17	0.0	99.1
5月末	22,067	△0.4	512.00	△0.4	99.0
6月末	22,586	1.9	527.33	2.6	99.1
7月末	22,734	2.6	528.62	2.8	99.2
8月末	22,460	1.4	523.32	1.8	99.1
9月末	22,261	0.5	516.03	0.4	99.0
10月末	22,906	3.4	531.09	3.3	98.9
11月末	22,219	0.3	516.24	0.4	99.0
12月末	21,125	△4.7	494.38	△3.8	98.7
2023年1月末	21,368	△3.6	498.37	△3.0	98.7
2月末	21,623	△2.4	503.37	△2.1	99.1
(期末) 2023年3月31日	円	%		%	%
	21,890	△1.2	507.64	△1.2	98.7

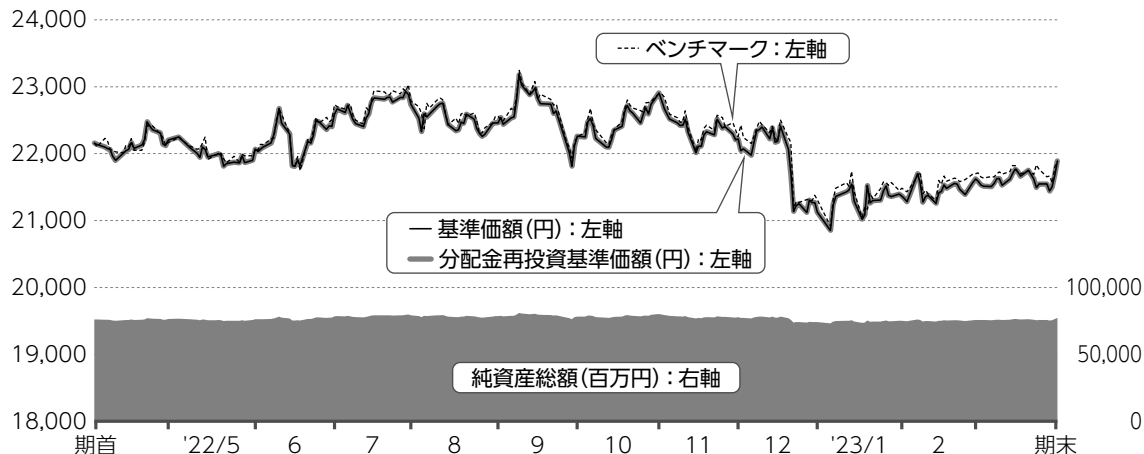
※騰落率は期首比です。

※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(2022年4月1日から2023年3月31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	22,158円
期末	21,890円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-1.2% (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。

※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(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、外国の公社債への分散投資を行い、FTSE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標と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っていません。

上昇要因

- 投資国通貨が対円で上昇したこと
- 保有債券から得られるインカムゲイン(利息収益)

下落要因

- 金利上昇(債券価格の下落)によるキャピタルロス

投資環境について(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

債券市場は下落しました。一方、為替市場は投資国通貨が対円で総じて上昇しました。

債券市場

主要国においてインフレ懸念が高まるなか、中銀の大幅利上げなどの金融引き締めが金利上昇要因となりました。

為替市場

F R B (米連邦準備制度理事会) や E C B (欧州中央銀行) などの海外中銀が金融引き締めを実施するなか、日銀が金融緩和の継続姿勢を堅持したことで、日本と海外との金利差拡大への思惑が強まり、投資国通貨の対円での上昇要因となりました。

ポートフォリオについて(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

当ファンド

期を通じて「パッシブ外国債券マザーファンド」を高位に組み入れました。

パッシブ外国債券マザーファンド

●デュレーション(投資資金の平均回収期間)

各国市場をいくつかの満期セクターに分割し、それぞれのセクター毎にデュレーション、利回り等の債券特性に近くなる銘柄の組み合わせを選択していくことにより、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した。また、インデックス構成銘柄の変更がある毎月末にはインデックス構成銘柄の変更

によるデュレーション等の変動にファンド特性値を合わせるべく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。

●国別・通貨別配分

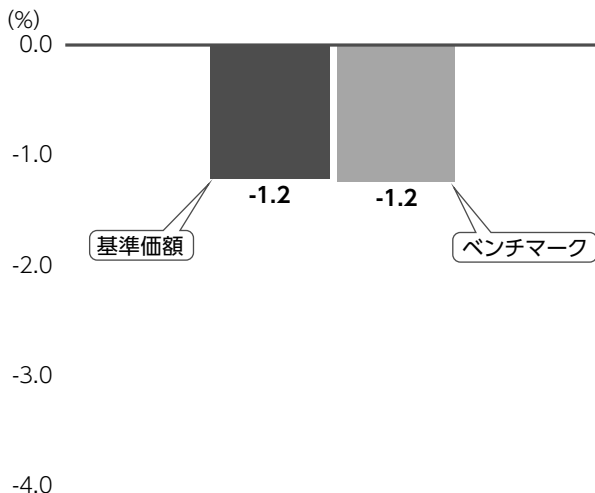
インデックスの国別配分に極力合わせて、リバランスを行いました。

●種別配分

インデックスに準拠し、すべて国債に投資を行いました。

ベンチマークとの差異について(2022年4月1日から2023年3月31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。

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

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-1.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率-1.2%と概ね同じとなりました。

上方乖離要因

- 為替の評価要因がプラスとなりました。

(当ファンドは、当日の投資信託協会が採用する仲値を採用し、ベンチマークは前日のロンドン時間午後4時時点のリフィニティブが提供するWM/Reutersの仲値を採用しているため、今期は両者の差異が上方乖離要因として影響しました。)

下方乖離要因

- 信託報酬等の支払い

分配金について(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第21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	13,907

※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、見送りといたしました。

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、「パッシブ外国債券マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

パッシブ外国債券マザーファンド

粘着的なインフレが懸念される一方、継続的な利上げの累積効果による景気減速が進むことが想定され、グローバルに利上げペースの鈍化から、金利の上昇圧力は後退する見通

しです。為替については、海外金利の上昇圧力の後退や、日銀による金融政策の修正観測が意識されるなか、投資国通貨は対円で上昇しづらい展開を予想します。このような環境下、引き続きベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、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。債券種別はベンチマークに準拠し、国債に投資していきま

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・DC外国債券インデックスファンド

1万口当たりの費用明細(2022年4月1日から2023年3月31日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	51円	0.231%	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22,103円です。</div>
（投信会社）	(19)	(0.088)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(24)	(0.110)	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）	(7)	(0.033)	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
（株式）	(-)	(-)	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
（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
（株式）	(-)	(-)	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
（公社債）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
(d) その他費用	8	0.034	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）	(6)	(0.028)	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）	(1)	(0.005)	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	59	0.265	

※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。

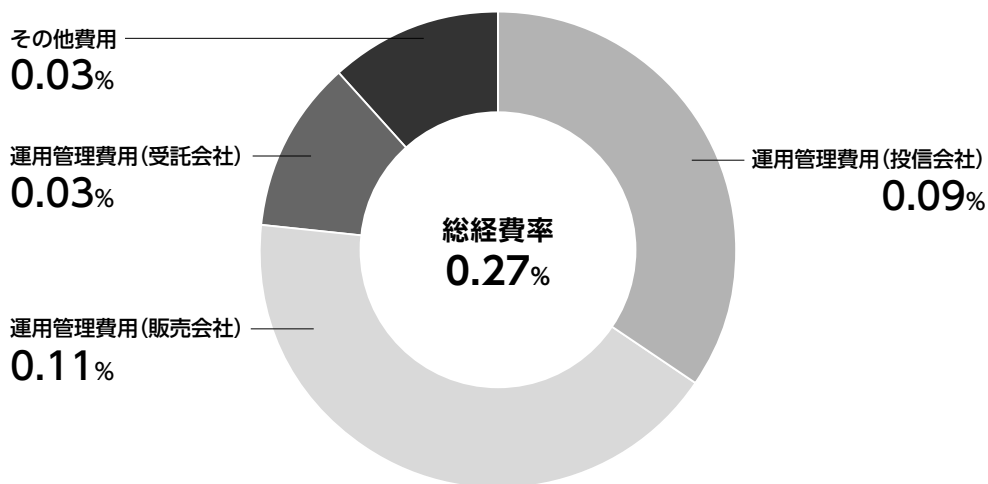
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.27%です。

三井住友・DC外国債券インデックスファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況(2022年4月1日から2023年3月31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
	千口	千円	千口	千円
パッシブ外国債券マザーファンド	1,810,173	5,486,355	1,223,553	3,717,335

■ 利害関係人との取引状況等(2022年4月1日から2023年3月31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 (2022年4月1日から2023年3月31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(2023年3月31日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
パッシブ外国債券マザーファンド	25,065,309	25,651,928	77,325,173

※パッシブ外国債券マザーファンドの期末の受益権総口数は31,108,673,813口です。

■ 投資信託財産の構成

(2023年3月31日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
パッシブ外国債券マザーファンド	77,325,173	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	37,996	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	77,363,170	100.0

※パッシブ外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産(93,317,968千円)の投資信託財産総額(93,772,477千円)に対する比率は99.5%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=133.53円、1カナダ・ドル=98.75円、1オーストラリア・ドル=89.69円、1シンガポール・ドル=100.60円、1ニュージーランド・ドル=83.71円、1イギリス・ポンド=165.56円、1イスラエル・シケル=37.099円、1デンマーク・クローネ=19.56円、1ノルウェー・クローネ=12.84円、1スウェーデン・クローナ=12.90円、1メキシコ・ペソ=7.383円、1オフショア・人民元=19.416円、1マレーシア・リンギット=30.232円、1ポーランド・ズロチ=31.169円、1ユーロ=145.72円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年3月31日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	77,363,170,673円
コール・ローン等	37,996,960
パッシブ外国債券	77,325,173,713
マザーファンド(評価額)	
(B) 負 債	125,159,854
未払解約金	34,922,329
未払信託報酬	88,138,395
その他未払費用	2,099,130
(C) 純資産総額(A-B)	77,238,010,819
元 本	35,284,283,220
次期繰越損益金	41,953,727,599
(D) 受益権総口数	35,284,283,220口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,890円

※当期における期首元本額34,396,126,627円、期中追加設定元本額4,965,986,712円、期中一部解約元本額4,077,830,119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2022年4月1日 至2023年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 19,861円
受 取 利 息	2,139
支 払 利 息	△ 22,000
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 733,745,395
売 買 損 益	102,156,932
売 買 損 益	△ 835,902,327
(C) 信 託 報 酬 等	△ 182,140,317
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 915,905,573
(E) 前期繰越損益金	11,422,132,963
(F) 追加信託差損益金	31,447,500,209
(配当等相当額)	(35,728,214,243)
(売買損益相当額)	(△ 4,280,714,034)
(G) 合 計(D+E+F)	41,953,727,599
次期繰越損益金(G)	41,953,727,599
追加信託差損益金	31,447,500,209
(配当等相当額)	(35,746,648,720)
(売買損益相当額)	(△ 4,299,148,511)
分配準備積立金	13,325,799,741
繰越損益金	△ 2,819,572,351

※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	1,461,368,676円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	35,746,648,720
(d) 分配準備積立金	11,864,431,065
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	49,072,448,461
1万口当たり当期分配対象額	13,907.74
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金(税引前)	0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。

パッシブ外国債券マザーファンド

第23期（2022年3月11日から2023年3月10日まで）

信託期間	無期限（設定日：2000年7月3日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ■主として日本を除く世界主要国の公社債に分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、これからの乖離を平均的に抑えていく運用を目指します。 ■ポートフォリオの見直しは適宜行い、各国の市場動向に対する感応度がベンチマークに近付くように調整を行います。 ■外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、市況動向等により弾力的、機動的に為替ヘッジを行う場合があります。

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) FTSE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	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率		
19期(2019年3月11日)	26,751	2.1	453.26	2.3	99.0	79,686
20期(2020年3月10日)	28,225	5.5	474.94	4.8	99.1	87,126
21期(2021年3月10日)	29,507	4.5	500.51	5.4	99.2	93,020
22期(2022年3月10日)	29,455	△0.2	497.73	△0.6	99.2	90,932
23期(2023年3月10日)	29,645	0.6	503.27	1.1	99.2	91,910

※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) FTSE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
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2022年 3月10日	円 29,455	% —	497.73	% —	% 99.2
3月末	30,441	3.3	514.02	3.3	99.0
4月末	30,507	3.6	514.17	3.3	99.1
5月末	30,327	3.0	512.00	2.9	99.0
6月末	31,047	5.4	527.33	5.9	99.1
7月末	31,256	6.1	528.62	6.2	99.1
8月末	30,886	4.9	523.32	5.1	99.0
9月末	30,618	3.9	516.03	3.7	98.9
10月末	31,512	7.0	531.09	6.7	98.9
11月末	30,573	3.8	516.24	3.7	98.9
12月末	29,074	△1.3	494.38	△0.7	98.6
2023年 1月末	29,415	△0.1	498.37	0.1	98.6
2月末	29,770	1.1	503.37	1.1	99.0
(期 末) 2023年 3月10日	29,645	0.6	503.27	1.1	99.2

※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 (2022年3月11日から2023年3月10日まで)

基準価額等の推移



期首	29,455円
期末	29,645円
騰落率	+0.6%

※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。

※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 (2022年3月11日から2023年3月10日まで)

当ファンドは、外国の公社債への分散投資を行い、FTSE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標として運用を行いました。

外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・ 投資国通貨が総じて対円で上昇したこと
- ・ 保有債券から得られるインカムゲイン（利息収益）

下落要因

- ・ 金利上昇（債券価格は下落）によるキャピタルロス

▶ 投資環境について (2022年3月11日から2023年3月10日まで)

債券市場は下落しました。一方、為替市場は投資国通貨が総じて対円で上昇しました。

債券市場

主要国においてインフレ懸念が高まる中、中銀の大幅利上げ等の金融引き締めが金利を押し上げ、債券市場は下落しました。

為替市場

F R B（米連邦準備制度理事会）や E C B（欧州中央銀行）等の海外中銀が金融引き締めを実施する中、日銀が金融緩和の継続姿勢を堅持したことで、日本と海外との金利差拡大への思惑が強まり、投資国通貨は総じて対円で上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2022年3月11日から2023年3月10日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）

各国市場をいくつかの満期セクターに分割し、それぞれのセクター毎にデュレーション、利回り等の債券特性に近くなる銘柄の組み合わせを選択していくことにより、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した。また、インデックス構成銘柄の変更がある毎月末には、インデックス構成銘柄の変更によるデュレーション等の変動にファンド特性値を合わせるべく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。

国別配分・通貨別配分

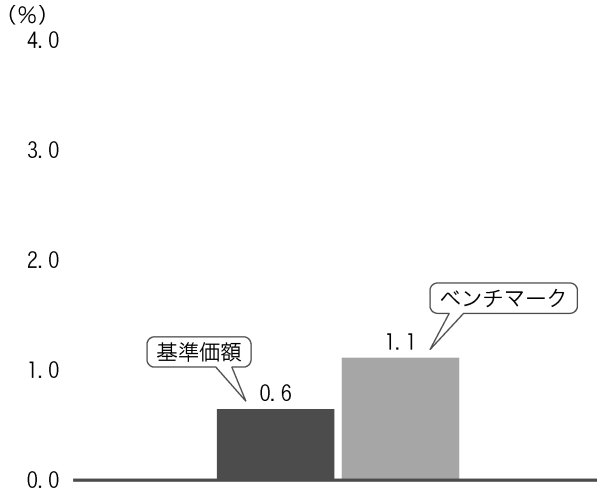
インデックスの配分に極力合わせて、リバランスを行いました。

種別配分

インデックスに準拠し、すべて国債に投資を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2022年3月11日から2023年3月10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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+0.6%となり、ベンチマークの騰落率+1.1%を0.5%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・為替の評価要因がマイナスとなったこと
当ファンドでは、当日の投資信託協会が採用する仲値を採用する一方で、ベンチマークは前日のロンドン時間午後4時時点のリフィニティブが提供するWM/Reutersの仲値を採用しているため、今期は両者の差異が下方乖離要因として影響しました。

2 今後の運用方針

粘着的なインフレが懸念される一方、継続的な利上げの累積効果による景気減速が進むことが想定され、グローバルに利上げペースの鈍化から、金利の上昇圧力は後退する見通しです。

為替については、海外金利の上昇圧力の後退や、日銀による金融政策の修正観測が意識される中、投資国通貨は対円で上昇しづらいつ展開を予想します。

このような環境下、引き続きベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、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。債券種別はベンチマークに準拠し、国債に投資していきます。

■ 1万口当たりの費用明細(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用	9円	0.029%	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）	(9)	(0.028)	
（その他）	(0)	(0.001)	
合計	9	0.029	

期中の平均基準価額は30,410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。

パッシブ外国債券マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2022年3月11日から2023年3月10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 84,074	千アメリカ・ドル 81,896
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 4,969	千カナダ・ドル 4,473
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 2,175	千オーストラリア・ドル 1,581
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 944	千シンガポール・ドル 1,167
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,506	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 6,950	千イギリス・ポンド 4,682
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 3,223	千イスラエル・シケル 5,100
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 597	千デンマーク・クローネ 3,320
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 1,399	千ノルウェー・クローネ 4,445
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 722	千スウェーデン・クローナ 4,412
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 14,743	千メキシコ・ペソ 16,564
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 172,775	千オフショア・人民元 9,073
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,867	千マレーシア・リンギット 1,618
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 9,874	千ポーランド・ズロチ 10,214
国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	アイルランド	国債証券	30	492
	オランダ	国債証券	1,244	2,087
	ベルギー	国債証券	996	1,612
	フランス	国債証券	6,688	10,272
	ドイツ	国債証券	8,083	8,790
	スペイン	国債証券	3,540	4,831
	イタリア	国債証券	7,096	10,357
	フィンランド	国債証券	461	669
	オーストリア	国債証券	1,259	1,385

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

パッシブ外国債券マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等(2022年3月11日から2023年3月10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 (2022年3月11日から2023年3月10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(2023年3月10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 379,220	千アメリカ・ドル 336,366	千円 45,749,156	% 49.8	% -	% 21.7	% 18.5	% 9.6	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 20,481	千カナダ・ドル 18,954	1,864,506	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 17,633	千オーストラリア・ドル 16,057	1,438,554	1.6	-	1.0	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 4,090	千シンガポール・ドル 3,874	389,591	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 2,900	千ニュージーランド・ドル 2,465	204,648	0.2	-	0.1	0.1	-	
イギリス	千イギリス・ポンド 30,647	千イギリス・ポンド 26,359	4,277,923	4.7	-	3.4	0.8	0.4	
イスラエル	千イスラエル・シケル 8,500	千イスラエル・シケル 7,982	300,957	0.3	-	0.1	0.2	-	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 15,931	千デンマーク・クローネ 15,276	295,750	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 15,450	千ノルウェー・クローネ 14,389	183,754	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 15,540	千スウェーデン・クローナ 14,675	186,375	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 116,660	千メキシコ・ペソ 107,881	800,231	0.9	-	0.5	0.2	0.2	
中国	千オフショア・人民元 220,500	千オフショア・人民元 221,991	4,328,470	4.7	-	2.1	1.8	0.8	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 17,050	千マレーシア・リンギット 16,978	510,448	0.6	-	0.4	0.2	0.0	

パッシブ外国債券マザーファンド

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
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 16,210	千ポーランド・ズロチ 13,774	423,438	0.5	—	0.1	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	4,676	4,055	584,179	0.6	—	0.4	0.2	0.0
オランダ	10,780	9,670	1,393,093	1.5	—	0.9	0.5	0.1
ベルギー	13,024	11,724	1,688,887	1.8	—	1.3	0.4	0.1
フランス	58,714	52,713	7,593,448	8.3	—	4.9	2.6	0.7
ドイツ	44,116	40,794	5,876,395	6.4	—	3.4	2.1	0.9
スペイン	34,529	31,684	4,564,083	5.0	—	2.9	1.5	0.6
イタリア	52,721	48,037	6,919,776	7.5	—	4.1	2.2	1.2
フィンランド	3,870	3,274	471,684	0.5	—	0.3	0.1	0.0
オーストリア	8,646	7,635	1,099,940	1.2	—	0.6	0.4	0.1
合 計	—	—	91,145,296	99.2	—	50.3	33.1	15.8

※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。

B 個別銘柄開示 外国(外貨建)公社債

区 分	銘 柄	種 類	期				末		償還年月日
			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	3.1250	720	622	84,661	2043/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,320	1,095	149,017	2043/05/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	690	644	87,660	2043/08/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,050	998	135,819	2043/11/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,950	1,889	256,965	2024/05/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	990	886	120,564	2044/05/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,580	2,481	337,455	2024/08/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	970	903	122,887	2044/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,090	936	127,426	2044/08/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,530	2,417	328,799	2024/11/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,200	1,135	154,460	2025/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,160	975	132,722	2044/11/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,460	1,121	152,560	2045/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,320	1,247	169,608	2025/05/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	960	805	109,572	2045/05/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,350	1,266	172,244	2025/08/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	780	639	87,038	2045/08/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,640	1,541	209,601	2025/11/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,120	939	127,787	2045/11/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	950	873	118,812	2026/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	580	443	60,313	2046/02/15		
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,650	1,509	205,251	2026/05/15		

パッシブ外国債券マザーファンド

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	2.5000	1,280	978	133,121	2046/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,890	1,712	232,908	2026/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,260	914	124,435	2046/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,140	1,963	267,115	2026/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	990	811	110,394	2046/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,170	2,004	272,631	2027/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,200	1,005	136,737	2047/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,440	1,393	189,528	2024/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,170	1,128	153,452	2024/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,710	1,658	225,636	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,930	1,785	242,801	2027/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,130	947	128,833	2047/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,920	1,846	251,197	2024/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	950	911	123,999	2024/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,200	1,151	156,548	2024/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,600	1,468	199,717	2027/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,210	969	131,794	2047/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,130	2,031	276,305	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	750	716	97,501	2024/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,330	1,271	172,917	2024/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,570	1,257	171,039	2047/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,840	1,683	228,993	2027/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,100	2,000	272,108	2024/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,230	1,171	159,394	2024/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,084	1,036	141,009	2025/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,090	1,953	265,670	2028/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,400	1,175	159,905	2048/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,390	1,334	181,504	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,400	1,339	182,170	2025/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,240	1,190	161,958	2025/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,886	1,768	240,590	2028/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,620	1,392	189,414	2048/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,460	1,400	190,546	2025/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,310	1,252	170,301	2025/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,470	1,408	191,607	2025/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,350	2,198	299,071	2028/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,690	1,420	193,203	2048/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,150	2,051	279,060	2025/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	940	901	122,680	2025/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	600	575	78,258	2025/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,800	1,703	231,754	2028/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	1,500	1,351	183,756	2048/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,000	955	129,962	2025/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,320	1,252	170,292	2025/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,390	1,316	179,109	2026/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,140	1,966	267,526	2029/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,160	1,820	247,555	2049/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,280	1,244	169,319	2024/02/29	

パッシブ外国債券マザーファンド

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	2.5000	1,270	1,197	162,854	2026/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,550	1,449	197,135	2026/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,900	1,837	249,867	2024/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,030	965	131,383	2026/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,000	1,807	245,900	2029/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,590	1,309	178,088	2049/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	1,750	1,625	221,080	2026/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,090	1,042	141,830	2024/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,160	1,068	145,272	2026/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,630	1,498	203,752	2026/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,350	1,288	175,216	2024/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,060	1,779	242,014	2029/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,910	1,381	187,877	2049/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	870	784	106,656	2026/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,140	1,077	146,540	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	860	813	110,703	2024/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	590	535	72,882	2026/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,400	3,209	436,574	2024/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,320	1,196	162,687	2026/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,330	1,155	157,207	2029/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	1,412	192,100	2049/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	1,700	1,538	209,299	2026/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,640	1,545	210,199	2024/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,820	1,542	209,835	2030/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,080	1,418	192,873	2050/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,360	2,085	283,669	2027/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,310	1,199	163,142	2025/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	920	793	107,989	2027/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	760	690	93,924	2026/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,070	1,856	252,527	2027/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,380	1,282	174,476	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,320	2,172	295,480	2025/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,510	1,426	193,958	2024/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,690	2,126	289,217	2030/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,920	1,074	146,175	2050/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,300	1,176	159,973	2025/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,460	930	126,625	2040/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,690	1,442	196,217	2027/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,750	1,592	216,645	2025/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,650	1,412	192,125	2027/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,220	2,004	272,602	2025/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,420	1,208	164,415	2027/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,810	1,627	221,405	2025/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,650	1,393	189,582	2027/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,580	2,814	382,818	2030/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,040	1,756	238,923	2050/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,010	640	87,047	2040/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,750	1,482	201,638	2027/08/31	

パッシブ外国債券マザーファンド

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	0.2500	1,190	1,066	145,090	2025/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,000	894	121,720	2025/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,680	228,510	2027/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	3,750	2,997	407,647	2030/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,380	1,468	199,783	2050/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,890	3,161	430,061	2031/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,370	1,558	212,015	2051/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,050	931	126,631	2026/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,840	1,560	212,224	2028/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,680	1,498	203,762	2025/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,030	1,807	245,872	2025/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,450	2,073	282,014	2027/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,290	1,089	148,136	2027/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,100	1,811	246,390	2028/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	830	548	74,534	2040/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,370	983	133,726	2041/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,750	1,553	211,240	2026/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	2,400	2,023	275,175	2027/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,900	1,694	230,401	2025/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,610	1,530	208,165	2024/03/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,500	1,339	182,238	2026/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,050	1,775	241,536	2028/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,860	3,241	440,935	2031/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	680	605	82,305	2026/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,530	1,870	254,379	2051/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,800	1,556	211,708	2028/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,110	845	115,041	2041/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,250	3,054	415,377	2024/06/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,110	985	134,003	2026/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	800	711	96,817	2026/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,050	1,764	240,056	2028/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,950	1,682	228,802	2028/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,300	1,226	166,810	2024/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,880	3,143	427,499	2031/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,300	1,958	266,324	2028/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,750	1,862	253,261	2051/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,470	1,021	138,882	2041/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,200	1,055	143,523	2026/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	1,850	1,567	213,211	2028/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,620	2,448	332,966	2024/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	2,000	1,761	239,614	2026/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,430	2,263	307,891	2024/09/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,020	1,728	235,029	2028/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,050	1,810	246,192	2026/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	290	270	36,767	2024/10/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,730	1,133	154,232	2051/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,810	3,100	421,709	2031/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,780	1,582	215,229	2026/10/31	

パッシブ外国債券マザーファンド

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	1.2500	860	766	104,282	2026/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,240	1,926	261,973	2028/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,430	1,035	140,854	2041/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	1,200	1,119	152,263	2024/12/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,350	1,167	158,792	2028/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,510	1,408	191,514	2025/01/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,120	1,886	256,577	2026/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,340	2,008	273,108	2028/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,630	3,073	418,014	2032/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,830	1,600	217,678	2029/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	870	671	91,302	2042/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,920	1,379	187,641	2052/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,280	1,127	153,340	2029/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,250	1,205	163,922	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	3,000	2,820	383,560	2025/03/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,360	1,317	179,222	2024/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,330	1,203	163,731	2029/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,250	1,194	162,480	2025/04/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,640	1,526	207,607	2027/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,350	1,256	170,964	2029/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,470	3,189	433,806	2032/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,980	1,916	260,676	2024/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,000	957	130,194	2025/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,130	1,061	144,369	2027/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	520	460	62,624	2042/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,650	1,360	184,984	2052/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,850	1,727	235,011	2027/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,380	2,198	299,063	2029/05/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	490	470	64,050	2025/07/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	1,100	1,045	142,208	2029/06/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,440	2,215	301,346	2032/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,100	2,022	275,127	2025/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,340	1,256	170,908	2027/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,700	1,557	211,838	2029/07/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	400	360	49,077	2042/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,100	930	126,618	2052/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,250	1,179	160,377	2029/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	2,200	2,137	290,694	2025/09/15	
US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	1,000	989	134,519	2025/10/15	
US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	1,950	1,935	263,275	2027/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	1,200	1,182	160,814	2029/09/30	
US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	3,300	3,348	455,493	2032/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	600	590	80,276	2027/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,200	1,191	162,012	2029/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	900	887	120,691	2029/11/30	
US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	250	246	33,577	2042/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,200	1,227	166,908	2052/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	2,300	2,263	307,811	2025/12/15	

パッシブ外国債券マザーファンド

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	4.1250	1,500	1,478	201,048	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	1,850	1,819	247,999	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	700	676	91,470	2033/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	1,300	1,258	171,140	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,500	1,475	200,699	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	800	771	104,964	2030/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	200	194	26,441	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	700	670	91,137	2053/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,830	1,735	236,047	2024/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	1,670	1,566	213,011	2024/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,500	1,558	211,926	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,050	1,132	154,078	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	740	779	106,049	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	190	215	29,343	2030/05/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	570	622	84,717	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	290	310	42,180	2036/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.0000	310	347	47,307	2037/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	290	305	41,491	2038/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	330	351	47,807	2038/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	350	331	45,047	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	370	382	52,071	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	590	628	85,465	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	670	703	95,632	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	610	659	89,651	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	390	408	55,545	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	720	708	96,368	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	900	928	126,264	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	320	350	47,709	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	360	376	51,249	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,120	1,077	146,566	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	470	411	56,022	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	390	340	46,302	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	950	810	110,279	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	370	302	41,143	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,130	921	125,318	2042/11/15
	小 計			379,220	336,366	45,749,156	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 450	千カナダ・ドル 514	50,578	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	240	292	28,776	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	210	253	24,900	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	350	389	38,327	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	510	538	52,989	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	1,250	1,222	120,229	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	651	627	61,775	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	450	421	41,426	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	724	679	66,829	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	434	394	38,799	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,246	986	97,074	2051/12/01

パッシブ外国債券マザーファンド

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	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	310	291	28,701	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	570	540	53,176	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	446	436	42,953	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	820	787	77,491	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,380	1,206	118,711	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	880	833	81,972	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,120	1,030	101,339	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,100	897	88,281	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	840	758	74,571	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	920	880	86,578	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,250	1,096	107,899	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	580	428	42,139	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	360	330	32,523	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	940	818	80,551	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	770	696	68,553	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	389	38,274	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	300	293	28,865	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	600	565	55,664	2032/12/01
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	380	351	34,548	2064/12/01
	小 計			20,481	18,954	1,864,506	—
				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7500	570	597	53,549	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	570	564	50,572	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	651	640	57,391	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	621	662	59,317	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	900	896	80,301	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	849	869	77,879	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	580	570	51,070	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	349	312	27,977	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	470	455	40,776	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	400	364	32,665	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	510	479	42,998	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	560	467	41,856	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	440	422	37,870	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	820	779	69,858	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	720	669	59,995	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	613	510	45,764	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	880	744	66,727	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	870	823	73,761	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	740	599	53,751	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	870	715	64,074	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	590	362	32,496	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	700	643	57,622	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	960	769	68,935	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	740	667	59,828	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,010	850	76,154	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	500	467	41,920	2033/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	150	149	13,436	2034/05/21
	小 計			17,633	16,057	1,438,554	—

パッシブ外国債券マザーファンド

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	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 330	千シンガポール・ドル 329	33,154	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	360	356	35,828	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	260	250	25,191	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	180	170	17,135	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	230	229	23,091	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	320	310	31,188	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	330	321	32,279	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	290	276	27,847	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	270	257	25,899	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	250	221	22,253	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	270	260	26,184	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	130	115	11,581	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	210	168	16,987	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	180	165	16,672	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	210	182	18,391	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	80	65	6,556	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	60	56	5,666	2032/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	130	136	13,679	2072/08/01
小 計				4,090	3,874	389,591	—
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	千ニュージーランド・ドル 600	千ニュージーランド・ドル 572	47,562	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	580	466	38,727	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	400	33,231	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	120	85	7,094	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.5000	500	437	36,300	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	405	33,655	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.2500	100	97	8,076	2034/05/15
小 計				2,900	2,465	204,648	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 450	千イギリス・ポンド 502	81,506	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	690	720	116,985	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	550	560	90,971	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	617	637	103,440	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	540	584	94,866	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	660	683	110,850	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	730	740	120,219	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	540	552	89,608	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	575	605	98,335	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	700	751	121,958	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	620	631	102,536	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	500	510	82,857	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	565	599	97,365	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	690	694	112,767	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	480	489	79,458	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	720	678	110,040	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	810	709	115,105	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	620	569	92,364	2068/07/22

パッシブ外国債券マザーファンド

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	2.7500	470	460	74,792	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	660	598	97,158	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	430	410	66,685	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	570	407	66,107	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	960	890	144,520	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	710	424	68,973	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	560	421	68,395	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.7500	520	304	49,457	2057/07/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	660	594	96,496	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	250	224	36,386	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	263	42,714	2071/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	840	811	131,673	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	390	243	39,597	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	470	268	43,538	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	410	343	55,706	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	610	568	92,317	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	510	398	64,741	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	720	455	73,945	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	280	94	15,320	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	300	129	21,036	2050/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	660	595	96,585	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	550	462	75,044	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	520	353	57,373	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	940	708	114,904	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	300	265	43,026	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	580	302	49,030	2046/01/31
	UK GILT	国債証券	1.2500	330	173	28,208	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	690	640	103,957	2025/01/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	1,030	853	138,444	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.5000	40	22	3,602	2053/07/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	1,010	802	130,210	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	470	195	31,677	2073/10/22
	UK GILT	国債証券	4.1250	400	401	65,190	2027/01/29
	UK GILT	国債証券	3.7500	300	289	47,002	2038/01/29
	UK GILT	国債証券	3.2500	350	334	54,324	2033/01/31
	UK GILT	国債証券	3.7500	100	93	15,221	2053/10/22
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	500	328	53,314	2039/01/31
	小 計			30,647	26,359	4,277,923	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.7500	550	515	19,451	2025/08/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	1,800	1,694	63,903	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	1,850	1,975	74,486	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	840	765	28,864	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	410	336	12,688	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	300	218	8,225	2037/05/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,115	79,751	2025/04/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.3000	450	360	13,586	2032/04/30
小 計			8,500	7,982	300,957	—	

パッシブ外国債券マザーファンド

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 4,850	千デンマーク・クローネ 5,866	113,585	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	1,344	1,294	25,058	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	2,867	2,558	49,531	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	3,860	3,303	63,959	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	1,080	552	10,701	2052/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	780	611	11,845	2031/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	1,150	1,088	21,068	2024/11/15
	小計			15,931	15,276	295,750	-
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ 2,180	千ノルウェー・クローネ 2,166	27,667	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	2,230	2,153	27,501	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	610	577	7,376	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,690	1,590	20,312	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	2,060	1,933	24,691	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,840	1,677	21,422	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	1,970	1,729	22,079	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,000	854	10,916	2031/09/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.1250	1,870	1,706	21,786	2032/05/18	
小計			15,450	14,389	183,754	-	
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 1,800	千スウェーデン・クローナ 2,023	25,703	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,200	1,175	14,929	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,920	2,871	36,468	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	2,820	2,634	33,453	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,950	1,765	22,427	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	2,410	2,138	27,160	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	1,940	1,599	20,316	2031/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	465	5,917	2033/11/11
小計			15,540	14,675	186,375	-	
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	千メキシコ・ペソ 11,880	千メキシコ・ペソ 11,654	86,447	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	12,870	11,890	88,201	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	10.0000	5,770	6,129	45,466	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	11,490	11,009	81,666	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	7,660	7,159	53,106	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	13,810	12,605	93,500	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	9,110	7,822	58,025	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	3,610	3,226	23,934	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	13,520	11,936	88,543	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	8,330	7,314	54,258	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	11,610	11,064	82,074	2024/09/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.5000	4,000	3,417	25,351	2027/03/04
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.5000	3,000	2,649	19,653	2033/05/26
	小計			116,660	107,881	800,231	-
中国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 21,000	千オフショア・人民元 21,043	410,305	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	25,000	25,039	488,230	2024/09/02

パッシブ外国債券マザーファンド

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	2.9100	28,000	28,212	550,104	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	19,000	20,473	399,195	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	31,400	31,838	620,790	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	6,000	6,001	117,019	2024/03/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	8,000	7,972	155,445	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	14,200	14,084	274,634	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2400	19,000	18,891	368,357	2025/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	8,000	7,900	154,042	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	12,000	11,880	231,640	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,900	3,873	75,519	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	5,000	4,852	94,610	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	7,000	6,959	135,703	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	2,991	58,333	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,000	2,993	58,360	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	7,000	6,983	136,174	2026/02/15
	小 計			220,500	221,991	4,328,470	-
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 640	千マレーシア・リンギット 634	19,090	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	340	352	10,587	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	530	543	16,327	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	810	820	24,667	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	450	454	13,652	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,050	1,026	30,872	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	870	868	26,124	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	810	818	24,604	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	470	506	15,214	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,570	1,586	47,704	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	460	459	13,828	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	640	673	20,250	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	860	857	25,769	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	560	594	17,887	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	800	752	22,614	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.4780	110	110	3,311	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.0590	140	141	4,252	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8820	340	343	10,316	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9060	380	384	11,555	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9000	620	626	18,849	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8990	500	504	15,172	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	2.6320	1,450	1,312	39,445	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.6420	260	272	8,183	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8280	950	918	27,618	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.7620	220	231	6,950	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	4.8930	320	345	10,376	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.7570	900	838	25,217	2040/05/22
	小 計			17,050	16,978	510,448	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	千ポーランド・ズロチ 1,040	千ポーランド・ズロチ 885	27,218	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	1,792	55,092	2029/10/25

パッシブ外国債券マザーファンド

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	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,460	1,375	42,273	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,050	1,836	56,448	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	770	543	16,709	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,400	2,757	84,753	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,170	815	25,057	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,476	45,388	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,520	2,293	70,494	2027/05/25
	小 計			16,210	13,774	423,438	—
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	436	454	65,436	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	300	300	43,286	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	460	441	63,585	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	410	323	46,546	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	510	477	68,843	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	245	35,333	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	220	197	28,472	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	200	167	24,153	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	170	149	21,550	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	240	213	30,793	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	210	140	20,227	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.4000	260	186	26,800	2035/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	270	239	34,503	2027/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	320	258	37,282	2030/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	200	153	22,181	2031/10/18
	IRISH GOVT	国債証券	0.5500	170	105	15,182	2041/04/22
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	480	533	76,790	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	630	699	100,800	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	680	757	109,111	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	440	423	60,936	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	580	570	82,116	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	740	729	105,088	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	690	644	92,828	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	630	578	83,378	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	670	609	87,755	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	580	517	74,496	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	423	60,977	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	550	373	53,871	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	410	331	47,771	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	530	472	68,054	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	420	195	28,140	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	510	401	57,795	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	300	193	27,830	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	230	193	27,921	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	400	365	52,711	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	610	490	70,590	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	200	167	24,123	2054/01/15
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	778	864	124,489	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	720	834	120,212	2035/03/28

パッシブ外国債券マザーファンド

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	
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	660	724	104,375	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	370	384	55,317	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	360	381	54,979	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	570	564	81,266	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	380	393	56,670	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	350	338	48,763	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	700	662	95,498	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	740	625	90,032	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	310	253	36,495	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	692	645	93,039	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	470	324	46,780	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	230	167	24,184	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	541	491	70,734	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	400	382	55,129	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	220	166	24,000	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	230	179	25,790	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	403	358	51,705	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	410	340	49,017	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	600	526	75,844	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	350	240	34,576	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	460	371	53,443	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	290	174	25,202	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	140	121	17,483	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	230	92	13,283	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	440	335	48,351	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	370	285	41,126	2032/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4000	260	159	22,907	2053/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	100	97	14,031	2033/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.3000	250	237	34,149	2054/06/22
フ ラ ン ス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	1,200	1,281	184,572	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	1,400	1,585	228,399	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	1,310	1,593	229,531	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	840	962	138,630	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	900	998	143,832	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	680	731	105,320	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	1,380	1,581	227,776	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	620	693	99,903	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	1,819	1,835	264,335	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	1,880	1,851	266,692	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	1,020	995	143,351	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	1,600	1,578	227,396	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,760	1,713	246,763	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	2,060	1,989	286,635	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,720	1,618	233,125	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,123	1,059	152,565	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	1,920	1,709	246,205	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,422	1,306	188,218	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,510	1,180	170,062	2036/05/25

パッシブ外国債券マザーファンド

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	1.7500	520	341	49,256	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	1,700	1,529	220,347	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	1,080	869	125,188	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,460	1,339	192,886	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	1,090	834	120,274	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	1,800	1,599	230,454	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,290	1,050	151,342	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	2,040	1,795	258,645	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,410	1,361	196,184	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	1,180	790	113,823	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,810	1,551	223,547	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,720	1,608	231,685	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,540	1,259	181,440	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	1,130	590	84,990	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,490	1,356	195,375	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,870	1,482	213,607	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	920	577	83,149	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	350	131	18,900	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	560	320	46,124	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,680	1,290	185,849	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	890	787	113,460	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,170	882	127,143	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	850	758	109,332	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	1,160	1,050	151,328	2032/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	140	121	17,470	2043/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	300	292	42,163	2026/09/24
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	400	366	52,812	2054/05/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	0.7500	1,000	509	73,341	2053/05/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	790	904	130,349	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	750	843	121,544	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	590	647	93,267	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	730	890	128,300	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	1,140	1,365	196,717	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	690	828	119,382	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,108	1,273	183,438	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	677	813	117,174	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	709	908	130,869	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	710	770	110,926	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,046	1,024	147,540	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	910	890	128,344	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,110	1,095	157,775	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	925	878	126,490	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	870	842	121,334	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,020	969	139,624	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	960	892	128,591	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,060	959	138,165	2026/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,240	1,120	161,361	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	791	715	103,049	2027/08/15

パッシブ外国債券マザーファンド

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	1.2500	1,120	854	123,042	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	690	618	89,100	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	890	778	112,214	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	990	857	123,586	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	850	716	103,219	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,150	584	84,240	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	750	625	90,038	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	620	449	64,701	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,050	864	124,597	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	920	808	116,404	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	500	412	59,428	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	550	447	64,507	2031/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	740	520	75,037	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	440	224	32,346	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	810	695	100,115	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	840	675	97,363	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	330	265	38,289	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	500	241	34,854	2052/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,000	794	114,431	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	330	260	37,509	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7000	1,130	1,043	150,353	2032/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.1000	200	192	27,733	2029/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	250	209	30,133	2053/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	250	242	34,950	2033/02/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	0.4000	550	526	75,853	2024/09/13
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.5000	400	394	56,767	2025/03/13
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,180	1,139	164,216	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,610	1,527	220,085	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,010	945	136,170	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,010	933	134,425	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	200	185	26,669	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	730	666	95,975	2026/04/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	830	747	107,740	2026/10/09
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,070	952	137,235	2027/04/16
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	1.3000	600	560	80,805	2027/10/15
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	2.2000	200	194	28,000	2028/04/13
ス ペ イ ン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	850	966	139,245	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	710	466	67,151	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	850	998	143,863	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	820	852	122,771	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	710	795	114,618	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	810	889	128,171	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	989	1,017	146,586	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	970	1,046	150,794	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	630	685	98,698	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	600	706	101,831	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	930	934	134,604	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	910	900	129,774	2024/10/31

パッシブ外国債券マザーファンド

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	1.6000	910	877	126,404	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	880	854	123,071	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	991	897	129,219	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	945	905	130,475	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	690	583	84,088	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	510	450	64,915	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	1,010	940	135,537	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	990	920	132,534	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	710	632	91,124	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	925	850	122,450	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	990	898	129,479	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	600	481	69,389	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	919	830	119,679	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	920	823	118,655	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	790	642	92,504	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	440	421	60,711	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.6000	830	694	100,035	2029/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	680	557	80,237	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	770	690	99,481	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	700	360	51,944	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	980	920	132,532	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	850	726	104,709	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	670	608	87,613	2026/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	560	537	77,438	2024/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.1000	730	558	80,462	2031/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	210	97	14,104	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	540	458	66,093	2028/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	540	361	52,135	2037/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	780	608	87,624	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	160	97	14,020	2042/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	990	773	111,484	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9000	340	216	31,213	2052/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	600	550	79,258	2032/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.8000	300	294	42,407	2026/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.9000	300	298	42,934	2039/07/30
イ タ リ ア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	563	628	90,467	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	980	1,090	157,042	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,110	1,154	166,358	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	820	685	98,805	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	550	352	50,785	2037/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.2500	970	1,041	149,965	2029/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	1,070	1,208	174,098	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	820	911	131,279	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	670	701	101,109	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	1,050	997	143,705	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	840	881	126,960	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	870	891	128,350	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	830	872	125,630	2040/09/01

パッシブ外国債券マザーファンド

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	600	611	88,067	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,008	145,203	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	670	684	98,631	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	970	970	139,830	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	920	889	128,160	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	800	784	113,038	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	620	506	73,033	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	800	762	109,794	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	1,040	842	121,409	2032/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	860	820	118,221	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	716	668	96,288	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	600	443	63,905	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	640	497	71,660	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	600	547	78,817	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	430	292	42,180	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	810	680	98,096	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	690	646	93,120	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	972	952	137,164	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	570	479	69,051	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	680	631	90,918	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,010	973	140,292	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	540	446	64,371	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,010	926	133,443	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	970	924	133,205	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	540	508	73,273	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	450	435	62,746	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	580	519	74,825	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	550	491	70,731	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	990	934	134,630	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7500	590	575	82,914	2024/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	570	539	77,725	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	560	463	66,834	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3500	840	700	100,918	2030/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	990	930	133,970	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	800	715	103,096	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	730	584	84,130	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	540	382	55,046	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	550	374	53,992	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	510	488	70,440	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	780	687	98,997	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	670	609	87,850	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8000	450	300	43,296	2041/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	530	300	43,271	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	900	702	101,150	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	680	510	73,478	2031/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	430	383	55,171	2026/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.2500	520	434	62,527	2028/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	430	251	36,207	2045/04/30

パッシブ外国債券マザーファンド

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	0.0000	660	634	91,390	2024/04/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	220	126	18,229	2072/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	660	551	79,448	2028/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	1,150	880	126,797	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	450	395	57,016	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	650	529	76,291	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	680	511	73,718	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	220	136	19,686	2052/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	260	233	33,650	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	300	279	40,295	2029/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	230	197	28,452	2038/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.6500	1,000	947	136,425	2027/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	200	191	27,519	2035/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	200	198	28,562	2026/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	600	590	85,130	2029/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4000	300	301	43,363	2033/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	100	97	14,099	2053/10/01
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	260	264	38,148	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	340	334	48,118	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	210	192	27,740	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	170	167	24,142	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	290	240	34,640	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.8750	200	188	27,201	2025/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	184	26,621	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	180	128	18,489	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	133	19,240	2027/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.1250	160	128	18,524	2034/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	130	112	16,228	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	280	236	34,129	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	150	142	20,561	2024/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	120	80	11,529	2036/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	120	72	10,376	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	180	142	20,508	2030/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	130	58	8,386	2052/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	150	116	16,777	2031/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	90	13,017	2043/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	300	258	37,301	2032/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	436	489	70,551	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	540	589	84,901	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	360	376	54,303	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	180	204	29,414	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	280	276	39,883	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	430	395	56,997	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	430	418	60,337	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	460	437	62,995	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	550	505	72,763	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	290	207	29,906	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	320	287	41,472	2027/04/20

パッシブ外国債券マザーファンド

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	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	300	267	38,560	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	680	582	83,932	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	350	334	48,227	2024/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	300	241	34,718	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	220	122	17,694	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.1000	40	28	4,113	2117/09/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	380	220	31,766	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	130	53	7,749	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	200	112	16,261	2040/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	650	505	72,882	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7000	90	39	5,664	2071/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	340	317	45,712	2025/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	180	147	21,297	2032/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.8500	110	83	12,085	2049/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.0000	100	96	13,877	2026/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.9000	300	290	41,869	2033/02/20
小 計				231,076	209,590	30,191,489	-
合 計				-	-	91,145,296	-

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2023年3月10日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 91,145,296	% 99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	799,200	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	91,944,497	100.0

※期末における外貨建資産(91,891,753千円)の投資信託財産総額(91,944,497千円)に対する比率は99.9%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=136.01円、1カナダ・ドル=98.37円、1オーストラリア・ドル=89.59円、1シンガポール・ドル=100.55円、1ニュージーランド・ドル=83.02円、1イギリス・ポンド=162.29円、1イスラエル・シェケル=37.702円、1デンマーク・クローネ=19.36円、1ノルウェー・クローネ=12.77円、1スウェーデン・クローナ=12.70円、1メキシコ・ペソ=7.417円、1オフショア・人民元=19.498円、1マレーシア・リンギット=30.064円、1ポーランド・ズロチ=30.74円、1ユーロ=144.05円です。

パッシブ外国債券マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年3月10日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	91,944,497,090円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	150,820,934
公 社 債 (評 価 額)	91,145,296,877
未 収 利 息	609,373,384
前 払 費 用	39,005,895
(B) 負 債	33,969,208
未 払 解 約 金	33,966,281
そ の 他 未 払 費 用	2,927
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	91,910,527,882
元 本	31,003,299,604
次 期 繰 越 損 益 金	60,907,228,278
(D) 受 益 権 総 口 数	31,003,299,604口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	29,645円

※当期における期首元本額30,871,719,132円、期中追加設定元本額2,100,803,346円、期中一部解約元本額1,969,222,874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。

※期末における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	25,544,577,202円
SMAM・年金パッシブ外国債券ファンド<非課税適格機関投資家限定>	5,457,736,930円
SMAM・外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	985,472円

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2022年3月11日 至2023年3月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,000,476,042円
受 取 利 息	2,000,535,615
そ の 他 収 益 金	2,530
支 払 利 息	△ 62,103
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,387,623,631
売 買 益	12,868,517,103
売 買 損	△ 14,256,140,734
(C) そ の 他 費 用 等	△ 27,067,090
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	585,785,321
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	60,061,156,783
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 4,021,072,887
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,281,359,061
(H) 合 計 (D + E + F + G)	60,907,228,278
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	60,907,228,278

※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。