

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2007年2月16日から無期限です。	
運用方針	主として「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	原則として、年2回(5月、11月の25日(休業日の場合は翌営業日))決算を行い、収益の分配を行います。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。分配金額については、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。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

## 外国債券インデックス・オープン (SMA専用)

### 運用報告書(全体版)

第34期(決算日 2023年11月27日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

### 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル:0120-668001  
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

**【本運用報告書の記載について】**

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物率比	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第30期(2021年11月25日)	13,916	0	1.9	515.377	2.3	97.3	1.9	2,013
第31期(2022年5月25日)	13,699	0	△1.6	507.194	△1.6	97.6	1.5	1,842
第32期(2022年11月25日)	14,024	0	2.4	519.804	2.5	97.9	1.0	1,582
第33期(2023年5月25日)	14,060	0	0.3	523.477	0.7	98.4	0.5	1,201
第34期(2023年11月27日)	15,026	0	6.9	563.082	7.6	98.2	0.5	2,193

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物率比
		騰落率		騰落率		
(当期首) 2023年5月25日	円 14,060	% -	523.477	% -	% 98.4	% 0.5
5月末	14,131	0.5	527.860	0.8	98.0	0.9
6月末	14,688	4.5	548.017	4.7	98.0	1.0
7月末	14,365	2.2	534.743	2.2	98.1	0.8
8月末	14,749	4.9	550.428	5.1	98.2	0.6
9月末	14,525	3.3	542.874	3.7	97.4	1.3
10月末	14,501	3.1	541.404	3.4	97.7	0.9
(当期末) 2023年11月27日	15,026	6.9	563.082	7.6	98.2	0.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

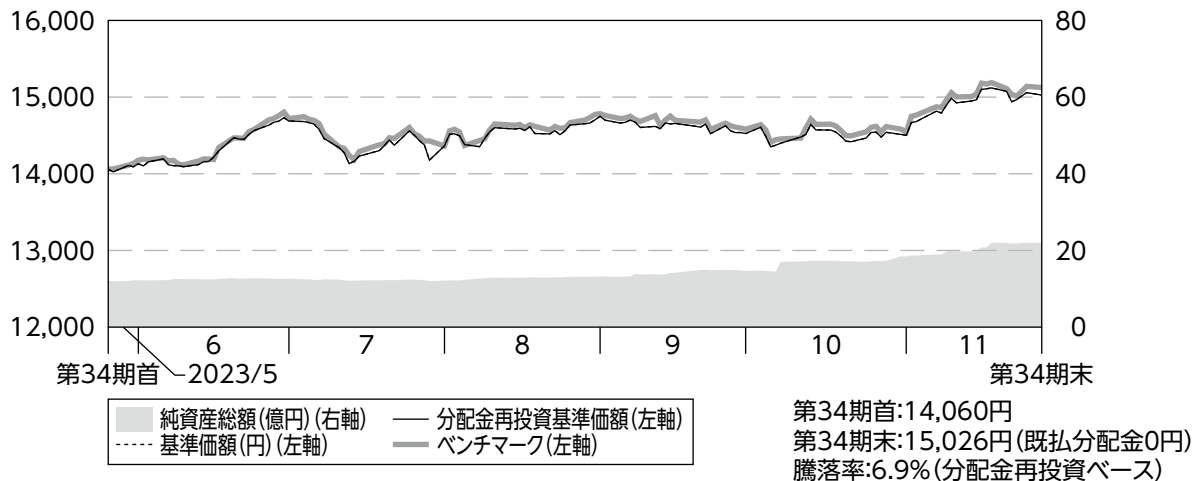
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

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

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

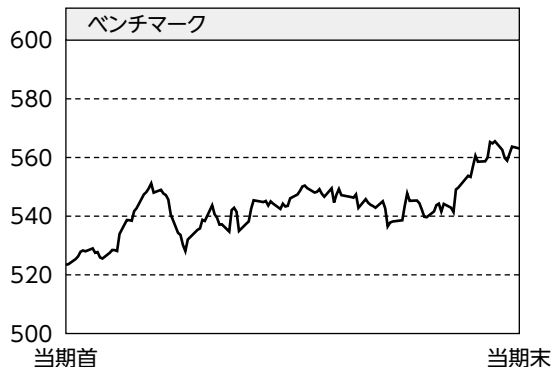


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2023年5月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は上昇(債券価格は下落)しました。米国の堅調な経済指標やインフレ圧力が継続する中、FRB(米連邦準備理事会)とECB(欧州中央銀行)高官らの発言を背景に、利上げ長期化観測が高まったことを受けて、主要国の長期金利は上昇しました。加えて、米長期金利については、大手格付会社による米国価格下げや8月初旬に発表された米財務省の定例入札増額なども、金利上昇を後押ししました。期末にかけては、欧米の軟調な経済指標や、11月初旬発表の米定例入札額が予想を下回ったことなどをを受けて、主要国の長期金利は下落しました。

外国為替市場では、主要通貨は対円で上昇しました。本邦と主要国の金利差拡大や日銀の金融正常化観測が後退したことなどにより、主要国との金融政策姿勢の違いが意識され、円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

### 【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

#### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

#### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

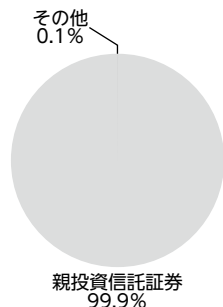
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

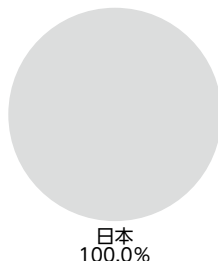
	当期末
	2023年11月27日
外国債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

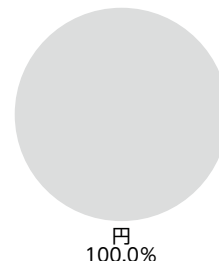
### ○資産別配分



### ○国別配分



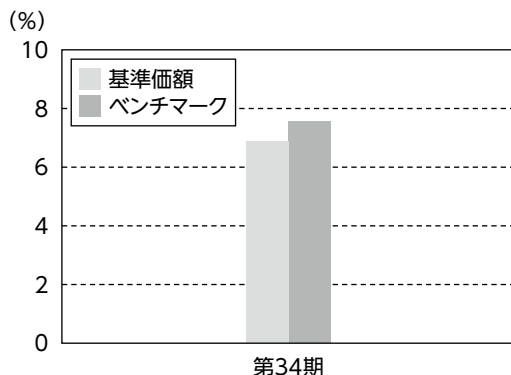
### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。  
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬(マイナス要因)等です。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第34期	
	2023年5月26日~2023年11月27日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	8,117

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

「外国債券インデックス マザーファンド」への投資を通じて日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年5月26日~2023年11月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	41円	0.280%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,493円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(16)	(0.112)	
(販売会社)	(20)	(0.140)	
(受託会社)	(4)	(0.028)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.020	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(2)	(0.017)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	44	0.300	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

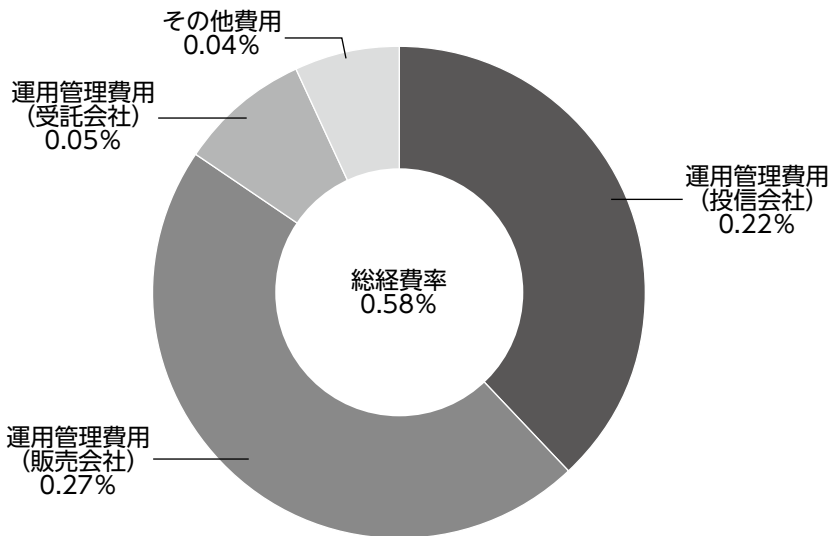
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## <参考情報>

### 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.58%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 325,898	千円 1,073,107	千口 59,105	千円 192,272

### 利害関係人<sup>\*</sup>との取引状況等

#### ■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A			売付額等C		
	うち利害関係人との取引状況B	B/A	うち利害関係人との取引状況D	D/C		
金 銭 信 託	百万円 0.068386	百万円 0.068386	% 100.0	百万円 0.068386	百万円 0.068386	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	418	20	4.8	420	22	5.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当 期					
	買付額等A			売付額等C		
	うち利害関係人との取引状況B	B/A	うち利害関係人との取引状況D	D/C		
為 替 直 物 取 引	百万円 19,950	百万円 95	% 0.5	百万円 6,354	百万円 3	% 0.0
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	283,684	25,137	8.9	283,459	25,553	9.0

<平均保有割合 0.5%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	当 期 首 (前 期 末)		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	379,436	646,229	2,191,947	

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、88,882,606千口です。

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	2,191,947	99.8
コール・ローン等、その他	5,222	0.2
投資信託財産総額	2,197,169	100.0

(注1) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(299,496,016千円)の投資信託財産総額(301,570,334千円)に対する比率は99.3%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=149.52円	1カナダドル=109.62円	1メキシコペソ=8.7392円
1ユーロ=163.41円	1イギリスポンド=188.35円	1スウェーデンクローナ=14.28円
1ノルウェークローネ=13.95円	1デンマーククローネ=21.92円	1ポーランドズロチ=37.4148円
1オーストラリアドル=98.35円	1ニュージーランドドル=90.89円	1シンガポールドル=111.61円
1マレーシアリンギット=31.9625円	1オフショア人民元=20.916円	1イスラエルシケル=39.9739円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年11月27日現在
(A)資 産	2,197,169,791円
コール・ローン等	5,115,900
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,191,947,102
未 収 入 金	106,789
(B)負 債	4,123,781
未 払 信 託 報 酬	4,083,006
未 払 利 息	4
そ の 他 未 払 費 用	40,771
(C)純 資 産 総 額(A-B)	2,193,046,010
元 本	1,459,531,556
次 期 繰 越 損 益 金	733,514,454
(D)受 益 権 総 口 数	1,459,531,556口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,026円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年 5月26日 至 2023年11月27日
(A)配 当 等 収 益	△707円
受 取 利 息	7
支 払 利 息	△714
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	104,139,141
売 買 益	110,533,535
売 買 損	△6,394,394
(C)信 託 報 酬 等	△4,123,777
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	100,014,657
(E)前 期 繰 越 損 益 金	62,528,140
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	570,971,657
(配 当 等 相 当 額)	(1,021,805,101)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△450,833,444)
(G) 計 (D+E+F)	733,514,454
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	733,514,454
追 加 信 託 差 損 益 金	570,971,657
(配 当 等 相 当 額)	(1,022,262,642)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△451,290,985)
分 配 準 備 積 立 金	162,542,797

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は854,532,592円、期中追加設定元本額は770,688,164円、期中一部解約元本額は165,689,200円です。

※分配金の計算過程

項	目	当	期
(A)	配当等収益額(費用控除後)		17,340,241円
(B)	有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)		78,869,075円
(C)	収益調整金額		1,022,262,642円
(D)	分配準備積立金額		66,333,481円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		1,184,805,439円
(F)	期末残存口数		1,459,531,556口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		8,117円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第23期（決算日 2023年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454,282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	2.1	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1	304,255
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9	306,130
第23期(2023年5月29日)	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4	0.8	269,104

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2022年 5月30日	30,737	—	509,621	—	97.2	1.9
5月末	30,959	0.7	512,002	0.5	97.1	1.9
6月末	31,703	3.1	527,332	3.5	97.7	1.4
7月末	31,929	3.9	528,619	3.7	98.4	0.8
8月末	31,545	2.6	523,319	2.7	97.7	1.4
9月末	31,260	1.7	516,025	1.3	97.5	1.5
10月末	32,175	4.7	531,092	4.2	97.1	1.7
11月末	31,207	1.5	516,243	1.3	97.7	1.2
12月末	29,688	△3.4	494,385	△3.0	97.4	1.6
2023年 1月末	30,038	△2.3	498,367	△2.2	97.4	1.5
2月末	30,402	△1.1	503,372	△1.2	97.6	1.4
3月末	30,785	0.2	507,635	△0.4	98.2	0.7
4月末	31,011	0.9	513,970	0.9	98.5	0.6
(当期末) 2023年 5月29日	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4	0.8

(注1)騰落率は期首比です。

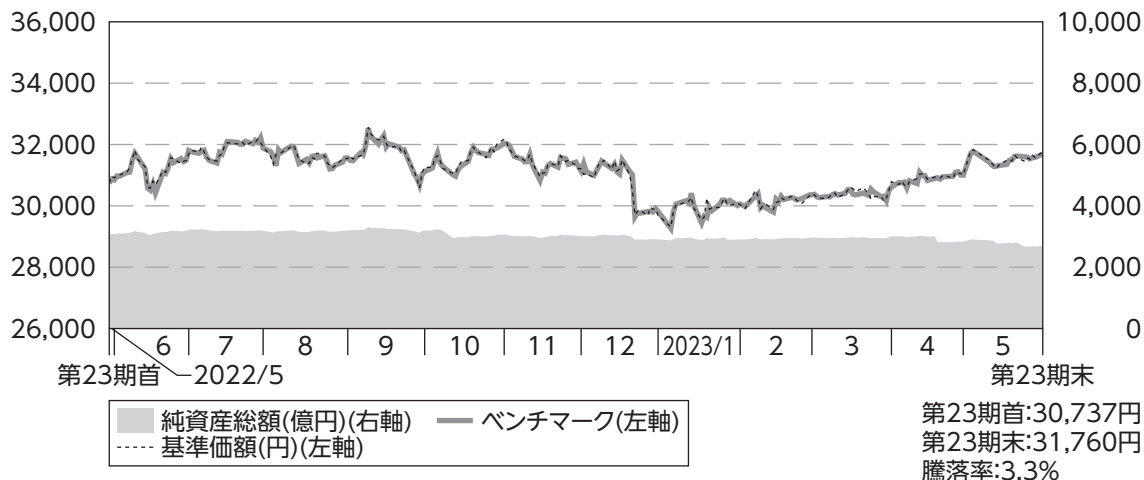
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



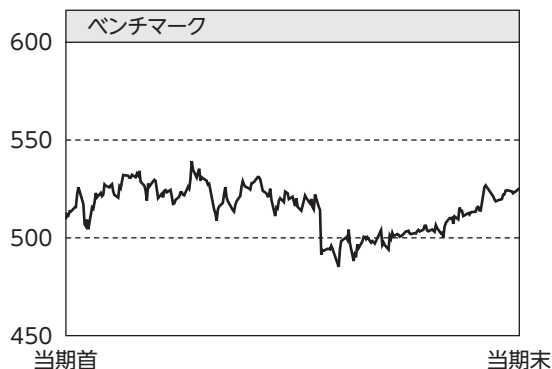
(注)ベンチマークは、2022年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

期初から2022年10月にかけて、欧米を中心にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要国の長期金利は上昇(債券価格は下落)する一方、主要通貨が対円で上昇し、基準価額はレンジ圏での推移となりました。2023年1月にかけては、日銀が長期金利変動許容幅を引き上げたことが実質的な利上げと受け止められると主要通貨は対円で急落し、基準価額も急落しました。その後は、米国で早期に利上げが停止するとの期待が後退したことや、ECB(欧州中央銀行)が大幅利上げを継続したことなどから、主要国通貨が対円で上昇し、基準価額は上昇傾向となりました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2022年10月にかけて、世界的にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要国の長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。その後は、主要中央銀行の利上げ長期化観測がある一方、利上げ継続による景気後退が懸念され、期末にかけて一進一退の展開となりました。

外国為替市場では、2022年10月にかけて、世界的にインフレ加速を背景とした利上げ織り込みが進んだことから、主要通貨は対円で上昇しました。2023年1月にかけて、日銀の長期金利変動許容幅引き上げが実質的な利上げと受け止められたことなどを背景に、主要通貨は対円で下落しました。その後は、米国で早期に利上げが停止するとの期待が後退して米ドル買いが優勢になったことや、ECBが大幅利上げを継続したことなどから、主要通貨は対円で上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。



## 当ファンドの組入資産の内容

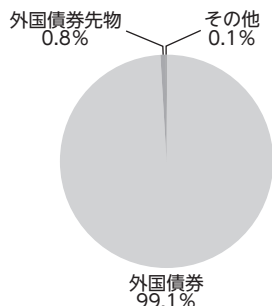
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	0.7%
2	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.6%
3	T 0.75% 11/15/24	アメリカ	0.5%
4	T 1.875% 02/15/32	アメリカ	0.5%
5	T 2.25% 11/15/24	アメリカ	0.5%
6	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.5%

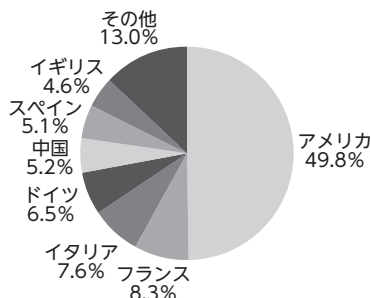
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.875% 05/15/32	アメリカ	0.5%
8	CGB 2.69% 08/12/26	中国	0.5%
9	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.5%
10	T 0.875% 11/15/30	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		858	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

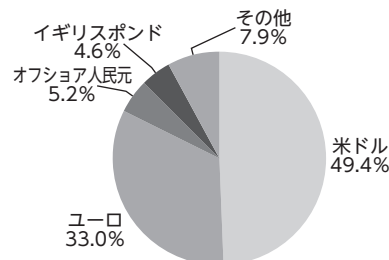
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

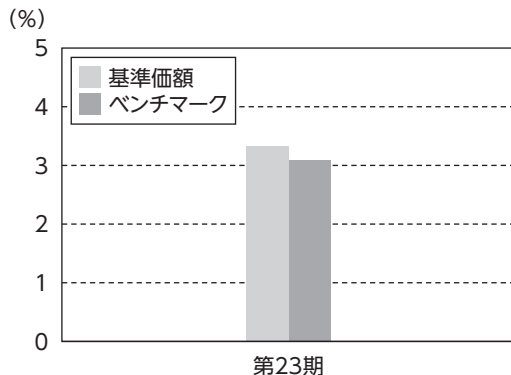


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

## 今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年5月31日~2023年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	9	0.028	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(9)	(0.028)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	9	0.029	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(31,058円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 291,181	千米ドル 450,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 22,550	千カナダドル 29,986
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 83,736	千メキシコペソ 119,338
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 39,655	千ユーロ 59,088
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,944	67,996
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	32,997	65,745
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	5,527	12,331
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	20,108	38,722
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	6,771	13,644
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	5,315	8,734
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,026	3,771
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	1,078	4,239
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 26,922	千イギリスポンド 31,463
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,276	千スウェーデンクローナ 24,806
ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 8,130	千ノルウェークローネ 29,819	
デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 7,718	千デンマーククローネ 24,394	
ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 8,717	千ポーランドズロチ 16,496	
オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 9,435	千オーストラリアドル 14,496	
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 8,548	千ニュージーランドドル 1,130	
シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,749	千シンガポールドル 5,246	
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,220	千マレーシアリンギット 14,219	
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 629,768	千オフショア人民元 214,171	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 4,293	千イスラエルシェケル 13,290	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 42,161	百万円 45,769	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 40,218	百万円 79	% 0.2	百万円 82,758	百万円 473	% 0.6
金 銭 信 託	0.427490	0.427490	100.0	0.427490	0.427490	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	847,555	80,237	9.5	851,183	80,321	9.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,054,670	千米ドル 938,245	千円 132,076,799	% 49.1	% —	% 20.9	% 18.3	% 9.9
カ ナ ダ	千カナダドル 56,670	千カナダドル 52,066	5,386,311	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 335,590	千メキシコペソ 311,521	2,492,327	0.9	—	0.5	0.3	0.2
ド イ ツ	千ユーロ 122,600	千ユーロ 113,353	17,098,288	6.4	—	3.5	2.0	0.9
イ タ リ ア	145,640	132,757	20,025,148	7.4	—	4.0	2.4	1.0
フ ラ ン ス	161,860	145,775	21,988,796	8.2	—	4.8	2.4	1.0
オ ラ ン ダ	30,620	27,405	4,133,806	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ス ペ イン	97,450	88,959	13,418,603	5.0	—	2.8	1.6	0.6
ベ ル ギ ー	36,050	32,542	4,908,759	1.8	—	1.2	0.5	0.1
オ ー ス ト リ ア	24,490	21,572	3,253,970	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	10,470	8,772	1,323,261	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ア イ ル ラ ン ド	12,120	10,394	1,567,952	0.6	—	0.4	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 88,580	千イギリスポンド 70,281	12,212,839	4.5	—	3.3	0.9	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 43,410	千スウェーデンクローナ 41,375	538,704	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 36,040	千ノルウェークローネ 33,237	421,449	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 44,580	千デンマーククローネ 41,319	836,728	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 43,230	千ポーランドズロチ 37,673	1,255,308	0.5	—	0.1	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 48,730	千オーストラリアドル 44,591	4,097,096	1.5	—	1.0	0.4	0.2
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 8,340	千ニューージーランドドル 7,401	630,503	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 11,790	千シンガポールドル 11,454	1,191,922	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 47,320	千マレーシアリンギット 48,208	1,469,405	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 679,750	千オフショア人民元 690,383	13,727,304	5.1	—	2.3	1.8	1.0
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 22,170	千イスラエルシェケル 20,645	779,396	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	264,834,684	98.4	—	49.0	33.0	16.5

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。















外国債券インデックス マザーファンド - 第23期 -

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
<b>国債証券</b>						
ACGB 0.25%	11/21/24	0.25	2,800	2,662	244,635	2024/11/21
ACGB 0.25%	11/21/25	0.25	2,100	1,940	178,310	2025/11/21
ACGB 0.5%	09/21/26	0.5	1,210	1,099	101,026	2026/9/21
ACGB 1%	11/21/31	1.0	2,780	2,238	205,696	2031/11/21
ACGB 1%	12/21/30	1.0	2,810	2,322	213,432	2030/12/21
ACGB 1.25%	05/21/32	1.25	2,440	1,984	182,310	2032/5/21
ACGB 1.5%	06/21/31	1.5	2,170	1,843	169,416	2031/6/21
ACGB 1.75%	06/21/51	1.75	1,670	997	91,696	2051/6/21
ACGB 1.75%	11/21/32	1.75	1,820	1,534	141,006	2032/11/21
ACGB 2.25%	05/21/28	2.25	1,480	1,398	128,488	2028/5/21
ACGB 2.5%	05/21/30	2.5	1,550	1,445	132,806	2030/5/21
ACGB 2.75%	05/21/41	2.75	1,180	976	89,680	2041/5/21
ACGB 2.75%	06/21/35	2.75	1,200	1,074	98,703	2035/6/21
ACGB 2.75%	11/21/27	2.75	1,930	1,874	172,248	2027/11/21
ACGB 2.75%	11/21/28	2.75	1,660	1,599	146,960	2028/11/21
ACGB 2.75%	11/21/29	2.75	1,460	1,391	127,877	2029/11/21
ACGB 3%	03/21/47	3.0	1,450	1,191	109,458	2047/3/21
ACGB 3%	11/21/33	3.0	1,840	1,721	158,140	2033/11/21
ACGB 3.25%	04/21/25	3.25	2,070	2,057	189,012	2025/4/21
ACGB 3.25%	04/21/29	3.25	1,680	1,655	152,094	2029/4/21
ACGB 3.25%	06/21/39	3.25	1,120	1,015	93,276	2039/6/21
ACGB 3.5%	12/21/34	3.5	1,450	1,408	129,449	2034/12/21
ACGB 3.75%	04/21/37	3.75	760	744	68,385	2037/4/21
ACGB 3.75%	05/21/34	3.75	1,490	1,487	136,677	2034/5/21
ACGB 4.25%	04/21/26	4.25	1,600	1,635	150,255	2026/4/21
ACGB 4.5%	04/21/33	4.5	2,690	2,860	262,800	2033/4/21
ACGB 4.75%	04/21/27	4.75	2,320	2,429	223,250	2027/4/21
小計					4,097,096	
<b>(ニュージーランド)</b>		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル			
<b>国債証券</b>						
NZGB 0.25%	05/15/28	0.25	590	483	41,203	2028/5/15
NZGB 0.5%	05/15/24	0.5	790	754	64,274	2024/5/15
NZGB 0.5%	05/15/26	0.5	670	596	50,811	2026/5/15
NZGB 1.5%	05/15/31	1.5	590	477	40,687	2031/5/15
NZGB 1.75%	05/15/41	1.75	390	253	21,609	2041/5/15
NZGB 2%	05/15/32	2.0	530	437	37,242	2032/5/15
NZGB 2.75%	04/15/25	2.75	850	817	69,676	2025/4/15
NZGB 2.75%	04/15/37	2.75	630	513	43,711	2037/4/15
NZGB 2.75%	05/15/51	2.75	520	374	31,866	2051/5/15
NZGB 3%	04/20/29	3.0	650	604	51,537	2029/4/20
NZGB 3.5%	04/14/33	3.5	600	556	47,420	2033/4/14
NZGB 4.25%	05/15/34	4.25	320	314	26,796	2034/5/15
NZGB 4.5%	04/15/27	4.5	840	843	71,861	2027/4/15
NZGB 4.5%	05/15/30	4.5	370	373	31,804	2030/5/15
小計					630,503	
<b>(シンガポール)</b>		千シンガポールドル	千シンガポールドル			
<b>国債証券</b>						
SIGB 0.5%	11/01/25	0.5	590	552	57,502	2025/11/1
SIGB 1.25%	11/01/26	1.25	810	759	79,079	2026/11/1
SIGB 1.625%	07/01/31	1.625	560	504	52,475	2031/7/1
SIGB 1.875%	03/01/50	1.875	770	673	70,110	2050/3/1
SIGB 1.875%	10/01/51	1.875	320	283	29,450	2051/10/1
SIGB 2.125%	06/01/26	2.125	630	610	63,512	2026/6/1
SIGB 2.25%	08/01/36	2.25	650	603	62,768	2036/8/1
SIGB 2.375%	06/01/25	2.375	900	882	91,845	2025/6/1
SIGB 2.375%	07/01/39	2.375	470	441	45,926	2039/7/1
SIGB 2.625%	05/01/28	2.625	510	501	52,171	2028/5/1
SIGB 2.625%	08/01/32	2.625	230	222	23,185	2032/8/1
SIGB 2.75%	03/01/46	2.75	640	655	68,196	2046/3/1
SIGB 2.75%	04/01/42	2.75	630	633	65,965	2042/4/1

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(マレーシア)</b>		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
<b>国債証券</b>						
MGs 2.875%	07/01/29	2.875	650	644	67,097	2029/7/1
SIGB 2.875%	09/01/27	2.875	280	278	28,976	2027/9/1
SIGB 2.875%	09/01/30	2.875	630	624	64,935	2030/9/1
SIGB 3%	08/01/72	3.0	220	256	26,659	2072/8/1
SIGB 3%	09/01/24	3.0	900	893	92,989	2024/9/1
SIGB 3.375%	09/01/33	3.375	660	682	71,014	2033/9/1
SIGB 3.5%	03/01/27	3.5	740	750	78,059	2027/3/1
小計					1,191,922	
<b>(中国オフショア)</b>						
<b>国債証券</b>		千オフショア人民元	千オフショア人民元			
CGB 1.99%	04/09/25	1.99	53,870	53,609	1,065,944	2025/4/9
CGB 2.18%	06/25/24	2.18	19,130	19,144	380,668	2024/6/25
CGB 2.28%	11/25/25	2.28	30,220	30,189	600,281	2025/11/25
CGB 2.29%	12/25/24	2.29	19,350	19,372	385,190	2024/12/25
CGB 2.35%	03/15/25	2.35	10,000	10,025	199,337	2025/3/15
CGB 2.44%	10/15/27	2.44	9,300	9,294	184,808	2027/10/15
CGB 2.46%	02/15/26	2.46	23,000	23,087	459,068	2026/2/15
CGB 2.47%	09/02/24	2.47	32,480	32,612	648,461	2024/9/2
CGB 2.48%	04/15/27	2.48	20,000	20,025	398,187	2027/4/15
CGB 2.5%	07/25/27	2.5	23,060	23,101	459,347	2027/7/25
CGB 2.6%	09/01/32	2.6	21,800	21,523	427,968	2032/9/1
CGB 2.62%	09/25/29	2.62	20,000	19,926	396,205	2029/9/25
CGB 2.68%	05/21/30	2.68	15,030	15,006	298,377	2030/5/21
CGB 2.69%	08/12/26	2.69	63,900	64,475	1,282,002	2026/8/12
CGB 2.69%	08/15/32	2.69	9,320	9,270	184,321	2032/8/15
CGB 2.75%	02/17/32	2.75	14,500	14,497	288,269	2032/2/17
CGB 2.75%	06/15/29	2.75	12,640	12,715	252,822	2029/6/15
CGB 2.79%	12/15/29	2.79	13,000	13,077	260,029	2029/12/15
CGB 2.8%	03/24/29	2.8	16,280	16,439	326,883	2029/3/24
CGB 2.8%	03/25/30	2.8	20,000	20,142	400,504	2030/3/25

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	4,000	4,011	79,764	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	29,530	29,983	596,189	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	11,300	11,470	228,073	2033/2/25
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	8,780	8,876	176,506	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	29,200	29,733	591,199	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	14,000	14,347	285,285	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	21,690	22,171	440,840	2031/5/27
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	18,800	19,167	381,109	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,400	8,409	167,204	2052/10/25
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,152	142,212	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	14,110	14,621	290,722	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	5,000	5,174	102,893	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	11,730	12,231	243,205	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	7,450	7,987	158,819	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	7,690	8,509	169,195	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	13,300	14,914	296,557	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	11,980	13,504	268,526	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	9,060	10,577	210,315	2048/10/22
小計				13,727,304	
(イスラエル)		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	3,090	2,920	110,250	2024/10/31
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	1,130	1,030	38,915	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,250	84,938	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	870	721	27,239	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	950	765	28,891	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	1,770	1,287	48,602	2037/5/31
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,240	1,173	44,304	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,600	1,491	56,321	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,700	2,497	94,266	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	500	373	14,083	2052/11/29
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,680	2,491	94,047	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,880	2,207	83,335	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,340	1,435	54,197	2026/10/30
小計				779,396	
合計				264,834,684	

(注) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	206	—
	US 5YR NOTE	441	—
	EURO-BOBL FU	281	—
	EURO-BUND	521	—
	US 10YR NOTE	334	—
	US LONG BOND	336	—

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 264,834,684	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,367,162	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	269,201,846	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(267,154,303千円)の投資信託財産総額(269,201,846千円)に対する比率は99.2%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=140.77円	1カナダドル=103.45円	1メキシコペソ=8.0005円
1ユーロ=150.84円	1イギリスポンド=173.77円	1スウェーデンクローナ=13.02円
1ノルウェークローネ=12.68円	1デンマーククローネ=20.25円	1ポーランドズロチ=33.3207円
1オーストラリアドル=91.88円	1ニュージーランドドル=85.19円	1シンガポールドル=104.06円
1マレーシアリンギット=30.4803円	1オフショア人民元=19.8836円	1イスラエルシケル=37.7506円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年5月29日現在
(A)資 産	271,928,254,990円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,391,791,580
公 社 債(評価額)	264,834,684,739
未 収 入 金	2,792,724,716
未 収 利 息	1,646,262,811
前 払 費 用	123,973,402
差 入 委 託 証 拠 金	138,817,742
(B)負 債	2,824,081,059
未 払 金	2,735,121,709
未 払 解 約 金	88,955,357
未 払 利 息	3,993
(C)純 資 産 総 額(A-B)	269,104,173,931
元 本	84,730,057,526
次 期 繰 越 損 益 金	184,374,116,405
(D)受 益 権 総 口 数	84,730,057,526口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,760円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29日
(A)配 当 等 収 益	6,423,558,602円
受 取 利 息	6,418,338,564
そ の 他 収 益 金	7,179,278
支 払 利 息	△1,959,240
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,532,433,209
売 買 益	31,031,886,319
売 買 損	△27,499,453,110
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△404,926,378
取 引 益	221,330,533
取 引 損	△626,256,911
(D)そ の 他 費 用	△88,230,471
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	9,462,834,962
(F)前 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	35,831,568,281
(H)解 約 差 損 益 金	△67,453,613,892
(I) 計 (E+F+G+H)	184,374,116,405
次 期 繰 越 損 益 金(I)	184,374,116,405

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は99,597,188,643円、期中追加設定元本額は17,028,370,443円、期中一部解約元本額は31,895,501,560円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

世界経済インデックスファンド	16,653,669,783円
DC世界経済インデックスファンド	13,184,067,694円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,920,469,122円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,720,116,147円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,190,036,966円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,580,386,141円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,275,353,515円
DC外国債券インデックス・オープン	2,274,794,254円
DCマイセクション25	1,930,541,444円
DCマイセクション50	1,720,181,642円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,593,367,193円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,342,784,846円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,215,426,950円
DCマイセクション75	1,198,108,349円
DCマイセクションS25	1,041,266,467円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,010,365,780円
DCマイセクションS50	846,961,932円
グローバル経済コア	764,656,981円
外国債券ファンド・シリーズ1	737,331,804円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	682,623,920円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	671,048,013円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	662,469,971円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	633,693,735円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	616,906,384円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	534,842,030円
DCマイセクションS75	485,504,531円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	428,641,695円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	390,788,925円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	382,628,500円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	379,663,298円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	371,830,524円
SMT 世界経済インデックス・オープン	333,019,308円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	240,472,462円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	198,399,331円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	189,630,949円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	189,364,287円
SMT インデックスバランス・オープン	181,206,599円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	145,975,185円
私募世界経済バッシブファンド(適格機関投資家専用)	120,543,223円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,307,742円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	97,418,953円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	58,753,413円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	58,021,628円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	57,398,276円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	55,445,945円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	55,087,701円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	51,400,460円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	35,849,178円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	32,046,114円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	31,406,702円

10資産分散投資ファンド	26,201,569円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	25,326,235円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	25,129,663円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	21,448,912円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	19,989,360円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	18,996,343円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	17,216,405円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,222,078円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,870,014円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,120,412円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,033,203円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	992,969円

## お知らせ

---

該当事項はありません。