

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（2016年7月1日設定）	
運用方針	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。 実質組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。	
主要運用対象	ベビーフンド	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）



eMAXIS 先進国債券 インデックス（為替ヘッジあり）

第7期（決算日：2023年1月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、去る1月26日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価 額			FTSE世界国債インデックス <small>(除く日本、為替ヘッジあり)</small>		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額		
		税 分	込 配	み 金	期 騰	落 率				期 騰	落 率
	円	円	円	騰	落	騰	落	率	率	率	百万円
3期(2019年1月28日)	9,557		0	△	0.0	385.22	0.6	97.8	—	—	73
4期(2020年1月27日)	10,106		0		5.7	409.73	6.4	97.6	—	—	181
5期(2021年1月26日)	10,459		0		3.5	427.41	4.3	98.3	—	—	282
6期(2022年1月26日)	9,990		0	△	4.5	410.80	△ 3.9	97.0	—	—	265
7期(2023年1月26日)	8,650		0	△	13.4	355.93	△ 13.4	97.3	—	—	553

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月26日	円 9,990	% —	410.80	% —	% 97.0	% —
1 月末	9,969	△ 0.2	409.98	△ 0.2	97.8	—
2 月末	9,757	△ 2.3	401.33	△ 2.3	97.1	—
3 月末	9,497	△ 4.9	390.67	△ 4.9	96.1	—
4 月末	9,290	△ 7.0	382.14	△ 7.0	95.2	—
5 月末	9,194	△ 8.0	378.13	△ 8.0	97.9	—
6 月末	8,952	△10.4	367.91	△10.4	103.5	—
7 月末	9,210	△ 7.8	378.91	△ 7.8	96.7	—
8 月末	8,899	△10.9	365.57	△11.0	100.1	—
9 月末	8,536	△14.6	350.26	△14.7	101.7	—
10 月末	8,514	△14.8	349.59	△14.9	101.0	—
11 月末	8,631	△13.6	354.67	△13.7	95.0	—
12 月末	8,465	△15.3	347.74	△15.4	95.3	—
(期 末) 2023年 1 月26日	8,650	△13.4	355.93	△13.4	97.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第7期：2022年1月27日～2023年1月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第7期首	9,990円
第7期末	8,650円
既払分配金	0円
騰落率	-13.4%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ13.4%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-13.4%）と同程度となりました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第7期：2022年1月27日～2023年1月26日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザー ファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

期間を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は 0.1% 程度でした。

マザーファンド保有による要因

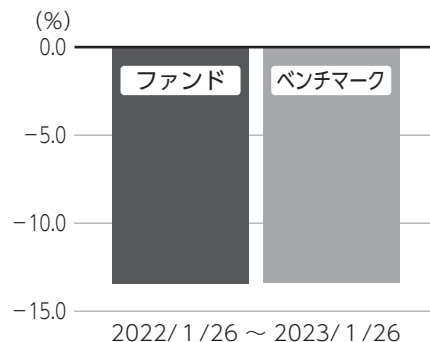
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：取引要因によるものです。

主なマイナス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第7期 2022年1月27日～2023年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	879

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）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）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ eMAXIS 先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザー ファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

2022年1月27日～2023年1月26日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	60	0.660	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(期中の日数÷年間日数)
（投信会社）	(27)	(0.297)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(27)	(0.297)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(6)	(0.066)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)その他費用	2	0.018	(b)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）	(1)	(0.014)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	62	0.678	

期中の平均基準価額は、9,020円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

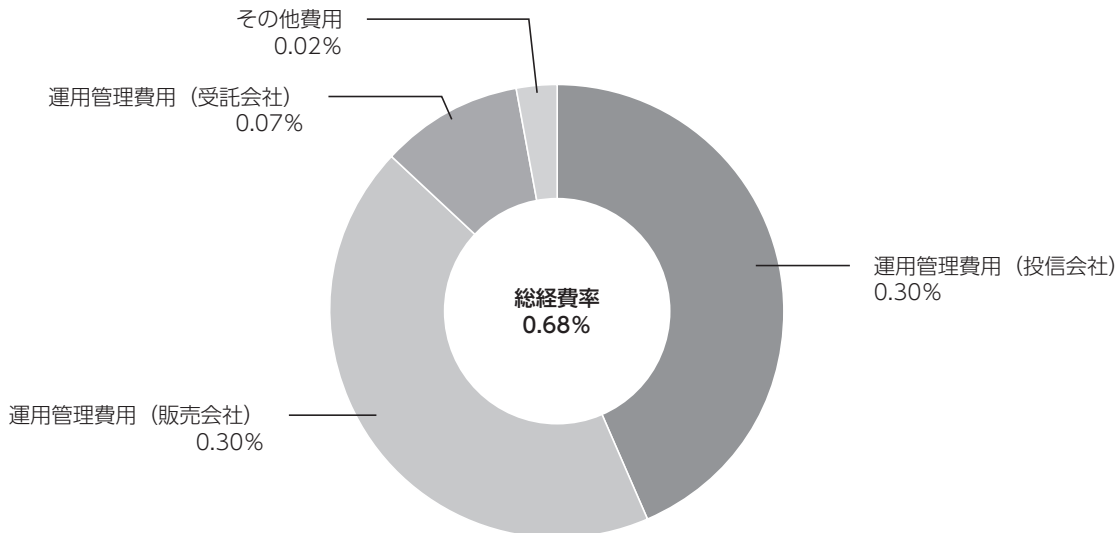
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（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0.68%**です。



(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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。

○売買及び取引の状況

(2022年1月27日～2023年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 432,489	千円 516,135	千口 156,186	千円 190,592

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >
該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,257,563	1,926,468	59.1	3,176,280	1,929,758	60.8
為替直物取引	375,138	316,037	84.2	416,856	299,523	71.9

平均保有割合 0.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 196,323	千円 552,028	千口 472,626	千円 552,028

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 552,028	% 97.7
コール・ローン等、その他	12,712	2.3
投資信託財産総額	564,740	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（227,032,959千円）の投資信託財産総額（231,499,166千円）に対する比率は98.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=129.27円	1 カナダドル=96.51円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ユーロ=141.09円
1 イギリスポンド=160.40円	1 スウェーデンクローネ=12.67円	1 ノルウェークローネ=13.06円	1 デンマーククローネ=18.96円
1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 オーストラリアドル=91.87円	1 ニュージーランドドル=83.78円	1 シンガポールドル=98.47円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 中国元=19.0141円	1 イスラエルシェケル=38.3249円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	564,740,280
コール・ローン等	12,711,989
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	552,028,291
(B) 負債	11,612,906
未払解約金	10,272,150
未払信託報酬	1,332,813
未払利息	5
その他未払費用	7,938
(C) 純資産総額(A-B)	553,127,374
元本	639,463,952
次期繰越損益金	△ 86,336,578
(D) 受益権総口数	639,463,952口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,650円

<注記事項>

- ①期首元本額 265,837,969円
 期中追加設定元本額 542,351,261円
 期中一部解約元本額 168,725,278円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8650円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は86,336,578円です。

③分配金の計算過程

項 目	2022年1月27日～ 2023年1月26日
費用控除後の配当等収益額	4,887,116円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	48,259,580円
分配準備積立金額	3,117,613円
当ファンドの分配対象収益額	56,264,309円
1万口当たり収益分配対象額	879円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2022年1月27日～2023年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,819
受取利息	6
支払利息	△ 1,825
(B) 有価証券売買損益	△ 26,912,186
売買益	8,674,468
売買損	△ 35,586,654
(C) 信託報酬等	△ 2,224,961
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 29,138,966
(E) 前期繰越損益金	△ 4,447,127
(F) 追加信託差損益金	△ 52,750,485
(配当等相当額)	(47,761,110)
(売買損益相当額)	(△100,511,595)
(G) 計(D+E+F)	△ 86,336,578
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 86,336,578
追加信託差損益金	△ 52,750,485
(配当等相当額)	(48,259,580)
(売買損益相当額)	(△101,010,065)
分配準備積立金	8,004,729
繰越損益金	△ 41,590,822

(注) (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) (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) (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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っています場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847
12期(2021年1月26日)	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	250,742
13期(2022年1月26日)	13,500	△4.0	410.80	△3.9	97.2	—	280,521
14期(2023年1月26日)	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—	230,844

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (<small>係(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月26日	円 13,500	% —	410.80	% —	97.2	—
1 月末	13,473	△ 0.2	409.98	△ 0.2	98.0	—
2 月末	13,189	△ 2.3	401.33	△ 2.3	98.6	—
3 月末	12,828	△ 5.0	390.67	△ 4.9	104.1	—
4 月末	12,541	△ 7.1	382.14	△ 7.0	101.4	—
5 月末	12,417	△ 8.0	378.13	△ 8.0	98.1	—
6 月末	12,077	△10.5	367.91	△10.4	103.7	—
7 月末	12,433	△ 7.9	378.91	△ 7.8	96.9	—
8 月末	12,007	△11.1	365.57	△11.0	100.9	—
9 月末	11,501	△14.8	350.26	△14.7	101.9	—
10 月末	11,479	△15.0	349.59	△14.9	101.3	—
11 月末	11,643	△13.8	354.67	△13.7	95.3	—
12 月末	11,424	△15.4	347.74	△15.4	95.5	—
(期 末) 2023年 1 月26日	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ13.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−13.4%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について**◎ 債券市況**

- ・ 先進国の債券市況は下落しました。
- ・ 先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 期間を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・ 組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは13.4%の下落になったため、カ
イ離は△0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通り
です。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・ 組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)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 ）	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、12,176円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年1月27日～2023年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 1,545,378	千アメリカドル 1,722,070
	カナダ	千カナダドル 85,453	千カナダドル 96,285
	メキシコ	千メキシコペソ 374,997	千メキシコペソ 454,329
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	千ユーロ 190,677	千ユーロ 209,914
	イタリア	千ユーロ 210,931	千ユーロ 251,294
	フランス	千ユーロ 254,535	千ユーロ 291,093
	オランダ	千ユーロ 42,187	千ユーロ 51,855
	スペイン	千ユーロ 141,665	千ユーロ 167,024
	ベルギー	千ユーロ 48,965	千ユーロ 59,678
	オーストリア	千ユーロ 32,516	千ユーロ 38,486
	フィンランド	千ユーロ 12,026	千ユーロ 14,644
	アイルランド	千ユーロ 14,706	千ユーロ 19,873
	イギリス	千イギリスポンド 118,808	千イギリスポンド 133,082
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 64,113	千スウェーデンクローネ 81,239
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 43,484	千ノルウェークローネ 61,275
	デンマーク	千デンマーククローネ 67,446	千デンマーククローネ 89,438
	ポーランド	千ポーランドズロチ 43,781	千ポーランドズロチ 56,888
	オーストラリア	千オーストラリアドル 69,174	千オーストラリアドル 77,621
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 7,288	千ニュージーランドドル 2,328	
シンガポール	千シンガポールドル 18,357	千シンガポールドル 21,011	
マレーシア	千マレーシアリンギット 59,063	千マレーシアリンギット 71,839	
中国	千中国元 825,716	千中国元 457,077	
イスラエル	千イスラエルシェケル 33,033	千イスラエルシェケル 44,571	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,257,563	1,926,468	59.1	3,176,280	1,929,758	60.8
為替直物取引	375,138	316,037	84.2	416,856	299,523	71.9

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 950,740	千アメリカドル 865,341	千円 111,862,707	% 48.5	% —	% 21.6	% 17.4	% 9.5
カナダ	千カナダドル 50,760	千カナダドル 47,524	4,586,585	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 287,850	千メキシコペソ 272,699	1,875,272	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	114,220	108,292	15,278,931	6.6	—	3.6	2.1	1.0
イタリア	132,870	123,630	17,443,094	7.6	—	4.2	2.4	1.0
フランス	149,270	138,057	19,478,581	8.4	—	5.2	2.6	0.7
オランダ	26,900	24,806	3,499,905	1.5	—	1.0	0.5	0.1
スペイン	86,280	81,013	11,430,142	5.0	—	2.9	1.6	0.4
ベルギー	32,120	29,871	4,214,536	1.8	—	1.3	0.5	0.0
オーストリア	21,450	19,615	2,767,565	1.2	—	0.7	0.4	0.2
フィンランド	9,250	7,967	1,124,187	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	11,430	10,094	1,424,297	0.6	—	0.4	0.1	0.0
イギリス	千イギリスポンド 79,850	千イギリスポンド 69,652	11,172,242	4.8	—	3.5	0.9	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 40,000	千スウェーデンクローネ 38,834	492,035	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 36,000	千ノルウェークローネ 34,163	446,174	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 41,620	千デンマーククローネ 39,580	750,451	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 38,650	千ポーランドズロチ 33,577	1,004,681	0.4	—	0.1	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 44,690	千オーストラリアドル 41,229	3,787,753	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 5,600	千ニュージーランドドル 5,013	420,041	0.2	—	0.1	0.1	—
シンガポール	千シンガポールドル 10,790	千シンガポールドル 10,573	1,041,131	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 39,590	千マレーシアリンギット 40,266	1,222,547	0.5	—	0.3	0.2	—
中国	千中国元 462,000	千中国元 468,755	8,912,969	3.9	—	1.8	1.5	0.6
イスラエル	千イスラエルシェケル 22,060	千イスラエルシェケル 21,380	819,390	0.4	—	0.1	0.2	0.1
合 計	—	—	225,055,227	97.5	—	50.5	32.2	14.7

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.125 T-NOTE 240215	0.125	5,800	5,528	714,657	2024/2/15
	0.25 T-NOTE 240315	0.25	5,000	4,758	615,092	2024/3/15
	0.25 T-NOTE 240515	0.25	8,000	7,564	977,887	2024/5/15
	0.25 T-NOTE 240615	0.25	6,500	6,129	792,334	2024/6/15
	0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,200	4,765	615,972	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250630	0.25	4,000	3,662	473,471	2025/6/30
	0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,000	4,561	589,655	2025/7/31
	0.25 T-NOTE 250831	0.25	1,900	1,728	223,464	2025/8/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	5,050	4,590	593,359	2025/9/30
	0.25 T-NOTE 251031	0.25	4,000	3,621	468,179	2025/10/31
	0.375 T-NOTE 240415	0.375	3,500	3,325	429,875	2024/4/15
	0.375 T-NOTE 240715	0.375	1,000	942	121,826	2024/7/15
	0.375 T-NOTE 240815	0.375	3,600	3,383	437,322	2024/8/15
	0.375 T-NOTE 240915	0.375	5,300	4,970	642,497	2024/9/15
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,000	3,685	476,430	2025/4/30
	0.375 T-NOTE 251130	0.375	4,000	3,626	468,805	2025/11/30
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	2,000	1,812	234,266	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	6,600	5,955	769,846	2026/1/31
	0.375 T-NOTE 270731	0.375	4,000	3,468	448,425	2027/7/31
	0.375 T-NOTE 270930	0.375	4,200	3,626	468,853	2027/9/30
	0.5 T-NOTE 260228	0.5	2,700	2,440	315,503	2026/2/28
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	4,200	3,687	476,700	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270531	0.5	500	437	56,608	2027/5/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,000	874	113,020	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	3,850	3,351	433,223	2027/8/31
	0.5 T-NOTE 271031	0.5	5,200	4,505	582,401	2027/10/31
	0.625 T-NOTE 241015	0.625	4,200	3,946	510,145	2024/10/15
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	2,700	2,425	313,608	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	4,000	3,540	457,656	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271130	0.625	4,500	3,914	506,046	2027/11/30
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	5,480	4,757	615,062	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	7,800	6,406	828,228	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	8,900	7,276	940,581	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 241115	0.75	5,600	5,260	680,024	2024/11/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	4,900	4,459	576,526	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260430	0.75	5,300	4,811	621,943	2026/4/30
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	5,200	4,711	609,001	2026/5/31
	0.75 T-NOTE 260831	0.75	6,000	5,405	698,785	2026/8/31
	0.75 T-NOTE 280131	0.75	4,300	3,750	484,815	2028/1/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	5,000	4,542	587,244	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 260930	0.875	3,000	2,709	350,316	2026/9/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	7,250	6,018	778,065	2030/11/15
	1 T-NOTE 241215	1.0	6,000	5,653	730,840	2024/12/15
	1 T-NOTE 280731	1.0	3,090	2,698	348,842	2028/7/31
	1.125 T-BOND 400515	1.125	4,220	2,833	366,243	2040/5/15
	1.125 T-BOND 400815	1.125	2,800	1,869	241,648	2040/8/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 250115	1.125	4,500	4,242	548,470	2025/1/15
	1.125 T-NOTE 261031	1.125	4,400	4,005	517,819	2026/10/31
	1.125 T-NOTE 270228	1.125	1,900	1,721	222,577	2027/2/28
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	4,400	3,906	504,977	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	2,900	2,545	329,091	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	11,590	9,797	1,266,480	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	3,850	2,268	293,257	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	5,700	5,206	672,998	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 261231	1.25	2,900	2,645	341,919	2026/12/31
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	5,590	4,984	644,401	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280430	1.25	4,000	3,561	460,342	2028/4/30
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	7,100	6,307	815,351	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	6,200	5,501	711,151	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	7,300	6,443	833,010	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	11,160	9,405	1,215,829	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	4,100	2,857	369,369	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	5,990	3,643	470,948	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	4,000	3,787	489,589	2025/1/31
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	3,400	3,133	405,043	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	2,620	2,325	300,637	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 281231	1.375	3,000	2,657	343,575	2028/12/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	10,230	8,660	1,119,521	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 240229	1.5	5,000	4,831	624,535	2024/2/29
	1.5 T-NOTE 240930	1.5	4,000	3,818	493,569	2024/9/30
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	2,000	1,905	246,340	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	4,000	3,807	492,155	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 250215	1.5	5,000	4,741	612,972	2025/2/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,631	598,681	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	4,700	4,324	558,975	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	6,300	5,626	727,361	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	3,300	2,906	375,766	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	4,500	2,922	377,819	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,120	1,986	256,731	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,500	3,269	422,594	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,950	1,812	234,283	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	4,000	3,711	479,773	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,200	2,040	263,747	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	3,400	3,038	392,784	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	7,280	6,358	821,905	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	4,900	3,597	465,058	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	4,850	4,665	603,056	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,000	4,804	621,026	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	6,200	5,905	763,372	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	2,800	2,608	337,205	2026/12/31
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	5,100	4,610	596,001	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	4,000	3,598	465,210	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	6,820	5,158	666,898	2041/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.875 T-BOND 510215	1.875	7,300	5,049	652,810	2051/2/15
	1.875 T-BOND 511115	1.875	7,350	5,064	654,664	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 260630	1.875	3,000	2,823	365,041	2026/6/30
	1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,700	2,537	327,964	2026/7/31
	1.875 T-NOTE 270228	1.875	5,700	5,317	687,361	2027/2/28
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,500	5,003	646,746	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	7,450	6,560	848,133	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	5,890	4,507	582,738	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	5,400	3,870	500,365	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	5,440	3,872	500,597	2051/8/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	4,000	3,872	500,638	2024/4/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,598	594,391	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,150	4,905	634,091	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,410	182,304	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,900	2,821	364,749	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,500	4,371	565,104	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	4,000	3,858	498,780	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	4,000	3,851	497,830	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,100	4,885	631,592	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,400	1,328	171,752	2026/5/31
	2.25 T-BOND 410515	2.25	4,140	3,325	429,856	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,500	1,915	247,658	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	4,800	3,646	471,383	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	4,490	3,386	437,833	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 240331	2.25	6,000	5,834	754,260	2024/3/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	3,100	3,010	389,184	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,300	2,220	287,054	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	3,000	2,896	374,479	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	3,600	3,471	448,720	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,400	6,123	791,617	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	3,250	3,102	401,041	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	3,981	514,663	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,000	3,776	488,246	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,200	3,955	511,375	2027/11/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	5,350	4,356	563,136	2042/2/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	2,560	1,997	258,216	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	6,500	5,052	653,199	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	2,400	2,341	302,716	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,600	4,458	576,303	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 260430	2.375	2,100	2,011	260,014	2026/4/30
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	5,800	5,511	712,497	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	2,650	2,479	320,552	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	4,100	3,834	495,660	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,780	3,069	396,781	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	1,900	1,532	198,169	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	2,570	2,072	267,920	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 240430	2.5	5,300	5,163	667,427	2024/4/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-NOTE 240515	2.5	3,700	3,602	465,715	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 240531	2.5	5,000	4,866	629,080	2024/5/31
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,700	2,614	337,999	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,000	2,884	372,918	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	4,500	4,301	556,083	2027/3/31
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,900	3,784	489,245	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 250415	2.625	3,100	3,005	388,527	2025/4/15
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	4,000	3,868	500,093	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	1,600	1,546	199,891	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 270531	2.625	4,900	4,705	608,271	2027/5/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	3,500	3,325	429,911	2029/2/15
	2.625 T-NOTE 290731	2.625	4,500	4,266	551,583	2029/7/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	300	258	33,430	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,900	2,495	322,545	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,820	1,534	198,354	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	3,400	2,866	370,517	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	8,000	7,839	1,013,367	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	5,000	4,864	628,827	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250515	2.75	4,000	3,887	502,496	2025/5/15
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	3,000	2,911	376,312	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	2,200	2,123	274,506	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 270731	2.75	6,000	5,788	748,276	2027/7/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,650	6,399	827,308	2028/2/15
	2.75 T-NOTE 290531	2.75	5,500	5,257	679,629	2029/5/31
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	8,300	7,838	1,013,258	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,070	2,688	347,561	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,800	1,557	201,400	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	200	172	22,335	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	3,000	2,597	335,735	2049/5/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	5,700	4,931	637,480	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 250615	2.875	6,800	6,628	856,819	2025/6/15
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	4,500	4,378	566,035	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	7,100	6,862	887,091	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,160	5,947	768,852	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 290430	2.875	4,500	4,333	560,173	2029/4/30
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	11,000	10,515	1,359,314	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,950	1,754	226,740	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	1,700	1,509	195,079	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	650	575	74,382	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,610	1,423	183,970	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,420	3,019	390,363	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,050	1,809	233,958	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,980	3,514	454,383	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	3,980	3,518	454,785	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	5,100	4,520	584,309	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	4,100	3,642	470,836	2052/8/15
	3 T-NOTE 240630	3.0	6,000	5,874	759,380	2024/6/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-NOTE 240731	3.0	6,000	5,873	759,319	2024/7/31
	3 T-NOTE 250715	3.0	4,100	4,005	517,833	2025/7/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	3,500	3,417	441,823	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,000	2,928	378,614	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	550	507	65,595	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,340	1,232	159,309	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,250	2,054	265,623	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,090	2,802	362,316	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	2,360	2,133	275,796	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	4,500	4,409	569,967	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	5,000	4,902	633,789	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	6,500	6,356	821,743	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	3,250	3,174	410,346	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	3,000	2,800	362,056	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 240831	3.25	4,500	4,421	571,512	2024/8/31
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	4,500	4,433	573,068	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	900	885	114,461	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	2,400	2,283	295,123	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,850	1,747	225,884	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,900	3,693	477,507	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	700	697	90,103	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	3,450	3,413	441,242	2025/9/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,100	1,082	139,914	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,300	1,276	164,959	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,900	1,923	248,587	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,210	2,212	285,954	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	910	943	121,913	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	2,980	3,022	390,686	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	1,500	1,531	197,957	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	3,060	3,126	404,157	2029/11/30
	4 T-BOND 421115	4.0	2,080	2,162	279,489	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	3,790	4,065	525,491	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	1,800	1,807	233,622	2025/12/15
	4 T-NOTE 291031	4.0	2,840	2,921	377,681	2029/10/31
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	1,700	1,738	224,767	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	2,400	2,455	317,483	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	4,740	5,004	646,919	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,500	1,634	211,299	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,410	1,530	197,799	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 240930	4.25	4,000	3,993	516,292	2024/9/30
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	1,000	1,008	130,350	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	390	430	55,632	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,680	1,855	239,824	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,260	292,156	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,580	1,742	225,253	2041/5/15
	4.375 T-NOTE 241031	4.375	5,000	5,005	647,056	2024/10/31
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,005	129,924	2036/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル		
国債証券	4.5 T-BOND 390815	4.5	900	1,009	130,490	2039/8/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,260	1,455	188,113	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	440	515	66,630	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	1,000	1,087	140,626	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	520	588	76,116	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,100	1,168	151,056	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	800	888	114,896	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	660	775	100,282	2030/5/15
小計					111,862,707	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	0.25	1,200	1,097	105,949	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,500	2,325	224,450	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	3,800	3,197	308,569	2030/12/1
	0.75 CAN GOVT 240201	0.75	500	482	46,555	2024/2/1
	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	1,750	1,665	160,731	2024/10/1
	1 CAN GOVT 260901	1.0	1,300	1,210	116,834	2026/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	600	555	53,632	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	850	811	78,358	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	3,200	2,994	288,992	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	1,870	1,684	162,580	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 240501	1.5	1,500	1,453	140,250	2024/5/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	958	92,541	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,150	1,094	105,635	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,350	2,127	205,314	2031/6/1
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	3,300	2,968	286,519	2031/12/1
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,180	1,660	160,219	2053/12/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,000	962	92,862	2028/6/1
	2 CAN GOVT 320601	2.0	2,250	2,103	203,022	2032/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	3,410	2,786	268,892	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,600	1,561	150,702	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	700	679	65,622	2029/6/1
	2.25 CAN GOVT 291201	2.25	1,000	969	93,586	2029/12/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	981	94,676	2024/6/1
	2.5 CAN GOVT 321201	2.5	1,300	1,266	122,216	2032/12/1
	2.75 CAN GOVT 240801	2.75	2,000	1,967	189,845	2024/8/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	970	935	90,319	2048/12/1
	2.75 CANADA GOWER 641201	2.75	870	831	80,236	2064/12/1
	3 CAN GOVT 241101	3.0	2,000	1,976	190,744	2024/11/1
	3.5 CAN GOVT 280301	3.5	100	103	9,941	2028/3/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	960	1,045	100,903	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	740	847	81,814	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	300	371	35,847	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	600	703	67,874	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	910	1,143	110,337	2033/6/1
小計					4,586,585	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	26,750	26,888	184,905	2024/12/5

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					償還年月日	
	利 率	額面金額	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,000	3,340	22,974	2036/11/20	
	5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	23,000	20,913	143,817	2025/3/6	
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	20,000	17,662	121,461	2027/3/4	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	41,350	37,605	258,602	2026/3/5	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	9,750	9,305	63,994	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	31,000	29,489	202,791	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,132	69,674	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	23,600	21,453	147,528	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	18,000	17,410	119,727	2024/9/5	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	16,500	15,291	105,153	2047/11/7	
	8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	6,000	5,567	38,286	2053/7/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	32,900	32,756	225,254	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,200	24,881	171,100	2038/11/18	
小 計					1,875,272		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,700	1,573	221,976	2026/8/15
		0 BUND 271115	—	2,150	1,941	273,995	2027/11/15
		0 BUND 281115	—	1,180	1,045	147,576	2028/11/15
		0 BUND 290815	—	2,300	2,008	283,439	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	3,000	2,596	366,352	2030/2/15
		0 BUND 300815	—	2,250	1,928	272,045	2030/8/15
		0 BUND 300815	—	1,200	1,030	145,404	2030/8/15
		0 BUND 310215	—	2,070	1,755	247,683	2031/2/15
		0 BUND 310815	—	2,100	1,761	248,593	2031/8/15
		0 BUND 310815	—	850	713	100,721	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	2,050	1,698	239,701	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	1,920	1,465	206,752	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	2,800	2,087	294,474	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	2,650	1,513	213,484	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	950	544	76,825	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	2,050	1,126	159,004	2052/8/15
		0 OBL 240405	—	2,200	2,135	301,289	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	3,500	3,353	473,151	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	3,000	2,846	401,573	2025/4/11
		0 OBL 251010	—	1,200	1,127	159,058	2025/10/10
		0 OBL 260410	—	3,200	2,979	420,443	2026/4/10
		0 OBL 261009	—	1,750	1,612	227,564	2026/10/9
		0 OBL 270416	—	2,000	1,824	257,418	2027/4/16
		0.2 SCHATS 240614	0.2	1,000	968	136,662	2024/6/14
		0.25 BUND 270215	0.25	2,300	2,130	300,612	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	2,620	2,367	334,074	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	3,470	3,110	438,867	2029/2/15
		0.4 SCHATS 240913	0.4	2,000	1,932	272,676	2024/9/13
		0.5 BUND 250215	0.5	3,150	3,030	427,512	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	3,450	3,272	461,708	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	3,260	3,030	427,503	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	2,000	1,845	260,445	2028/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 BUND 240815	1.0	2,500	2,443	344,805	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	3,200	3,092	436,285	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	980	822	116,094	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,480	2,067	291,730	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	961	135,643	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	963	136,002	2027/10/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,500	2,467	348,128	2024/5/15
		1.7 BUND 320815	1.7	2,700	2,603	367,369	2032/8/15
		1.75 BUND 240215	1.75	3,000	2,974	419,698	2024/2/15
		1.8 BUND 530815	1.8	450	417	58,876	2053/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	1,000	998	140,852	2029/11/15
		2.5 BUND 440704	2.5	2,430	2,565	361,997	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,100	3,307	466,703	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,030	2,359	332,890	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,070	2,508	353,910	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,970	2,515	354,877	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,300	1,473	207,842	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,820	2,294	323,754	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	980	1,331	187,795	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	2,170	2,702	381,232	2031/1/4
5.625 BUND 280104	5.625	1,850	2,149	303,311	2028/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	1,300	1,645	232,192	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,070	1,263	178,336	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240130	—	3,000	2,911	410,852	2024/1/30
		0 ITALY GOVT 240415	—	3,000	2,894	408,344	2024/4/15
		0 ITALY GOVT 241215	—	1,300	1,230	173,553	2024/12/15
		0 ITALY GOVT 260801	—	2,200	1,970	278,037	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,400	1,193	168,420	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,200	1,138	160,631	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,500	1,249	176,295	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,000	1,850	261,018	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	1,400	1,196	168,876	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,230	1,721	242,838	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	1,300	1,188	167,622	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	1,600	1,282	181,004	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	2,250	2,027	286,021	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	1,150	944	133,234	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,100	1,653	233,301	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,170	1,684	237,705	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,850	1,244	175,561	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	2,300	2,109	297,655	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	200	190	26,935	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,200	2,049	289,096	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	1,200	1,028	145,092	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,100	2,045	288,532	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,300	1,257	177,450	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,420	1,048	147,901	2036/3/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	3,280	3,171	447,432	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	1,640	1,025	144,649	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,550	2,425	342,261	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	1,831	258,418	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,240	1,037	146,334	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	1,050	644	90,891	2051/9/1
		1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	2,000	1,965	277,287	2024/7/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,430	1,010	142,618	2041/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,000	1,970	278,068	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	1,600	1,555	219,502	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,800	2,718	383,557	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	2,550	2,393	337,725	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	2,250	2,136	301,479	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,400	1,351	190,696	2026/7/15
		2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	1,050	702	99,123	2052/9/1
		2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	170	105	14,908	2072/3/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	400	383	54,152	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,660	1,349	190,389	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,500	2,160	304,836	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,460	1,072	151,292	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,500	1,488	210,054	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,150	1,132	159,846	2025/11/15
		2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	1,440	1,274	179,842	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	1,500	1,451	204,820	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,650	1,308	184,586	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,260	1,219	172,054	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	2,120	2,024	285,606	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	980	723	102,065	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,910	1,654	233,368	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,250	2,182	307,911	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,570	1,365	192,611	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	780	699	98,692	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,260	1,098	154,930	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,970	1,823	257,315	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,780	1,600	225,860	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	1,400	1,412	199,352	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,450	3,434	484,526	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,416	199,846	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	900	857	121,010	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	550	543	76,679	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,190	2,174	306,785	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,700	1,767	249,444	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,800	1,921	271,124	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,650	1,777	250,807	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,150	2,237	315,653	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,420	1,536	216,853	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,820	1,998	281,917	2039/8/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,420	1,563	220,633	2040/9/1	
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,980	3,298	465,412	2029/11/1	
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,500	1,713	241,743	2033/2/1	
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,270	3,808	537,284	2031/5/1	
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,720	1,965	277,266	2027/11/1	
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	900	1,031	145,576	2026/11/1	
		フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	2,500	2,430	342,922
0 O. A. T 240325	—			2,000	1,940	273,758	2024/3/25	
0 O. A. T 250225	—			1,250	1,184	167,076	2025/2/25	
0 O. A. T 250325	—			5,300	5,011	707,053	2025/3/25	
0 O. A. T 260225	—			4,200	3,892	549,188	2026/2/25	
0 O. A. T 270225	—			2,200	1,995	281,495	2027/2/25	
0 O. A. T 291125	—			4,800	4,074	574,818	2029/11/25	
0 O. A. T 301125	—			4,500	3,723	525,282	2030/11/25	
0 O. A. T 311125	—			3,450	2,772	391,121	2031/11/25	
0 O. A. T 320525	—			4,250	3,357	473,696	2032/5/25	
0.25 O. A. T 261125	0.25			4,450	4,099	578,389	2026/11/25	
0.5 O. A. T 250525	0.5			2,400	2,289	322,994	2025/5/25	
0.5 O. A. T 260525	0.5			5,100	4,785	675,125	2026/5/25	
0.5 O. A. T 290525	0.5			3,980	3,534	498,741	2029/5/25	
0.5 O. A. T 400525	0.5			2,560	1,727	243,727	2040/5/25	
0.5 O. A. T 440625	0.5			1,060	662	93,419	2044/6/25	
0.5 O. A. T 720525	0.5			1,160	490	69,240	2072/5/25	
0.75 O. A. T 280225	0.75			3,770	3,466	489,020	2028/2/25	
0.75 O. A. T 280525	0.75			4,170	3,821	539,176	2028/5/25	
0.75 O. A. T 281125	0.75			4,520	4,112	580,226	2028/11/25	
0.75 O. A. T 520525	0.75			2,340	1,371	193,459	2052/5/25	
0.75 O. A. T 530525	0.75			2,830	1,617	228,245	2053/5/25	
1 O. A. T 251125	1.0			4,300	4,127	582,374	2025/11/25	
1 O. A. T 270525	1.0			4,500	4,238	597,953	2027/5/25	
1.25 O. A. T 340525	1.25			4,700	4,026	568,057	2034/5/25	
1.25 O. A. T 360525	1.25			4,360	3,602	508,312	2036/5/25	
1.25 O. A. T 380525	1.25			600	478	67,542	2038/5/25	
1.5 O. A. T 310525	1.5			4,690	4,362	615,475	2031/5/25	
1.5 O. A. T 500525	1.5			3,410	2,517	355,182	2050/5/25	
1.75 O. A. T 241125	1.75			3,700	3,644	514,166	2024/11/25	
1.75 O. A. T 390625	1.75			2,740	2,353	332,119	2039/6/25	
1.75 O. A. T 660525	1.75			860	639	90,245	2066/5/25	
2 O. A. T 321125	2.0			3,300	3,130	441,720	2032/11/25	
2 O. A. T 480525	2.0			2,360	1,978	279,094	2048/5/25	
2.25 O. A. T 240525	2.25			3,800	3,781	533,485	2024/5/25	
2.5 O. A. T 300525	2.5			4,800	4,827	681,095	2030/5/25	
2.5 O. A. T 430525	2.5			650	606	85,544	2043/5/25	
2.75 O. A. T 271025	2.75			3,980	4,037	569,650	2027/10/25	
3.25 O. A. T 450525	3.25	2,750	2,894	408,433	2045/5/25			
3.5 O. A. T 260425	3.5	2,400	2,476	349,400	2026/4/25			
4 O. A. T 381025	4.0	2,070	2,351	331,771	2038/10/25			

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O. A. T 550425	4.0	1,450	1,758	248,112	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	1,640	2,033	286,886	2060/4/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	3,010	3,669	517,730	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,250	1,500	211,662	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	3,690	4,337	611,945	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,970	2,505	353,450	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	3,500	3,820	538,990	2025/10/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	1,000	931	131,362	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	600	547	77,277	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,330	1,158	163,465	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	1,500	1,264	178,348	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	750	615	86,872	2031/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	930	644	90,948	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,520	807	113,994	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,133	301,028	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,360	1,192	168,319	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,550	1,455	205,296	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	1,320	1,108	156,347	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,640	1,199	169,181	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,750	1,637	230,998	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,100	1,013	142,957	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	900	893	126,029	2024/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	420	390	55,110	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,250	1,254	177,013	2033/1/15
2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,530	1,641	231,633	2047/1/15		
3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,150	1,370	193,408	2042/1/15		
4 NETH GOVT 370115	4.0	1,650	1,940	273,717	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,400	1,606	226,592	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	1,300	1,255	177,069	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	2,000	1,896	267,581	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,346	331,107	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	3,700	3,413	481,677	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	900	808	114,022	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,100	1,832	258,506	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,500	1,986	280,312	2031/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 240730	0.25	1,200	1,158	163,402	2024/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	1,800	1,526	215,368	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	1,390	1,126	158,965	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,750	2,380	335,900	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	1,950	1,585	223,716	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,600	2,392	337,494	2027/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,450	1,027	144,911	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	900	591	83,393	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,470	832	117,467	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,100	1,474	208,092	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	2,630	2,334	329,332	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,900	1,810	255,468	2026/10/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,850	2,662	375,680	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,450	1,350	190,564	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,850	2,690	379,643	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,290	1,192	168,289	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	700	361	50,991	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,550	1,478	208,557	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,700	1,661	234,361	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	1,730	1,481	208,985	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,150	800	113,008	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,500	1,467	206,998	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,870	1,754	247,600	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,700	2,666	376,239	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,080	1,935	273,030	2033/7/30
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	1,500	1,430	201,784	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,390	1,209	170,627	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,204	310,995	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,620	1,481	209,087	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	700	691	97,550	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,160	1,124	158,641	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,500	2,531	357,163	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,590	1,745	246,239	2037/1/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,000	1,047	147,815	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,680	1,974	278,561	2041/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,430	1,713	241,690	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,100	1,236	174,446	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,450	204,622	2044/10/31
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,300	2,827	398,934	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,800	1,995	281,580	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,600	3,066	432,659	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	800	712	100,529	2027/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,370	1,150	162,327	2030/6/22
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	2,050	1,656	233,753	2032/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	600	390	55,073	2040/6/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	570	262	37,051	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,900	2,787	393,347	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,190	1,108	156,458	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	500	459	64,771	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,089	294,852	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,240	174,984	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,900	1,675	236,384	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	970	846	119,375	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	950	648	91,547	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	610	504	71,174	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	560	423	59,815	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,320	997	140,717	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,170	1,018	143,643	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	410	337	47,686	2066/6/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	2.25 BEL GOVT 570622	2.25	800	678	95,706	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	700	699	98,730	2024/6/22
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	500	484	68,374	2039/4/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,140	1,158	163,447	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	890	993	140,199	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	710	785	110,772	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,210	1,416	199,805	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,700	1,805	254,687	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,390	1,693	238,966	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,610	1,845	260,349	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	—	2,000	1,927	271,993	2024/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 250420	—	1,000	944	133,296	2025/4/20
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	200	172	24,393	2028/10/20
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,250	1,041	146,965	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,600	1,295	182,762	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	420	256	36,166	2040/10/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	400	284	40,206	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	540	498	70,299	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,150	1,018	143,629	2029/2/20
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	200	99	14,047	2071/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	800	752	106,122	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,150	1,054	148,831	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	740	461	65,089	2051/3/20
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	450	211	29,789	2120/6/30
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	500	428	60,452	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	400	387	54,702	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	900	698	98,577	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	310	207	29,221	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	680	669	94,481	2024/10/21
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	260	217	30,620	2049/5/23
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	500	492	69,444	2026/7/15
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	460	377	53,263	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	660	637	89,912	2034/5/23
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	630	661	93,375	2044/6/20		
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	400	494	69,727	2062/1/26		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	1,558	219,872	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,600	1,724	243,294	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,042	147,026	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	400	384	54,195	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 260915	—	420	384	54,209	2026/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	400	328	46,391	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	500	404	57,040	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	300	212	30,025	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	580	298	42,058	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	270	175	24,691	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	250	235	33,272	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,100	1,004	141,730	2027/9/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	480	420	59,287	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	610	400	56,489	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	280	241	34,097	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	480	67,741	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	236	33,360	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	300	286	40,444	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	160	125	17,735	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	900	810	114,403	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	480	472	66,695	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	598	84,391	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	450	467	65,923	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	750	602	84,987	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	700	637	89,975	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	1,200	1,010	142,637	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	700	567	80,090	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	550	415	58,613	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	430	287	40,493	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	900	833	117,536	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	550	526	74,334	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	820	756	106,697	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	554	78,215	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	960	718	101,378	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	280	242	34,184	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	620	525	74,211	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	540	538	76,007	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	606	85,515	2024/3/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,200	1,271	179,418	2025/3/13
小 計						76,661,241	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	3,200	3,093	496,246	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,100	1,007	161,654	2026/1/30
		0.125 GILT 280131	0.125	1,550	1,331	213,584	2028/1/31
		0.25 GILT 250131	0.25	150	140	22,553	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	2,550	1,983	318,094	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	2,000	1,802	289,135	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	1,670	1,348	216,223	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	1,830	1,556	249,604	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	1,720	662	106,285	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,050	1,933	310,126	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	1,900	1,350	216,650	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,330	642	103,051	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,630	1,404	225,280	2029/10/22
		0.875 GILT 330731	0.875	900	700	112,411	2033/7/31
		0.875 GILT 460131	0.875	1,810	1,026	164,700	2046/1/31
		1 GILT 240422	1.0	2,000	1,942	311,618	2024/4/22
		1 GILT 320131	1.0	2,950	2,422	388,631	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	800	556	89,192	2039/1/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当	期	末		償還年月日		
			利 率	額面金額		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
国債証券	1.125 GILT 731022	1.125	910	431	69,170	2073/10/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	1,300	1,198	192,183	2027/7/22	
	1.25 GILT 411022	1.25	2,520	1,697	272,328	2041/10/22	
	1.25 GILT 510731	1.25	1,720	1,001	160,577	2051/7/31	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,370	1,296	207,899	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	1,860	1,210	194,221	2047/7/22	
	1.5 GILT 530731	1.5	1,200	735	118,028	2053/7/31	
	1.625 GILT 281022	1.625	1,000	921	147,728	2028/10/22	
	1.625 GILT 541022	1.625	1,340	844	135,497	2054/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	1,570	930	149,245	2071/10/22	
	1.75 GILT 370907	1.75	1,500	1,185	190,122	2037/9/7	
	1.75 GILT 490122	1.75	440	300	48,252	2049/1/22	
	1.75 GILT 570722	1.75	1,180	763	122,458	2057/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	1,200	1,165	186,907	2025/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	1,030	812	130,358	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,050	1,039	166,717	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,900	1,774	284,595	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,310	1,269	203,568	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,130	1,138	182,582	2068/7/22	
	3.75 GILT 380129	3.75	500	505	81,127	2038/1/29	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,270	1,296	207,914	2052/7/22	
	4 GILT 600122	4.0	1,320	1,446	231,958	2060/1/22	
	4.125 GILT 270129	4.125	1,730	1,778	285,289	2027/1/29	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,160	1,215	195,002	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,680	1,813	290,854	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,610	1,730	277,577	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,070	1,146	183,894	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	910	976	156,553	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,230	1,334	214,020	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,280	1,402	224,927	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,130	1,268	203,523	2055/12/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	1,480	1,633	261,957	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	1,950	2,170	348,128	2042/12/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,184	190,017	2030/12/7	
	4.75 GILT 381207	4.75	1,340	1,519	243,694	2038/12/7	
	5 GILT 250307	5.0	1,830	1,897	304,435	2025/3/7	
	6 GILT 281207	6.0	620	709	113,871	2028/12/7	
小	計				11,172,242		
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ			
国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	5,300	4,557	57,743	2031/5/12	
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	8,500	7,927	100,447	2028/5/12	
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,200	5,711	72,370	2029/11/12	
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	5,877	74,472	2026/11/12	
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	3,100	3,182	40,317	2032/6/1	
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,199	91,213	2025/5/12	
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,550	4,378	55,470	2039/3/30	
小	計				492,035		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,353	43,800	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	5,400	4,893	63,909	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,743	35,833	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	6,300	6,147	80,289	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,091	53,429	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,500	3,292	42,993	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,650	2,556	33,385	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	2,800	2,642	34,514	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,450	4,442	58,018	2024/3/14
小計					446,174	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	3,500	3,338	63,289	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	7,700	6,259	118,680	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,000	2,895	54,897	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,900	6,315	119,733	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	3,300	2,916	55,289	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,500	5,385	102,104	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,720	12,471	236,455	2039/11/15
小計					750,451	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	4,000	3,257	97,479	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	1,000	896	26,822	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,400	3,164	94,699	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	1,800	1,279	38,284	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,761	112,537	2024/10/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	2,879	86,146	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,500	2,234	66,850	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,300	2,004	59,985	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,189	95,433	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	3,000	2,501	74,851	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,331	99,693	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,674	109,957	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,401	41,937	2029/4/25
小計					1,004,681	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	1,700	1,614	148,322	2024/11/21
	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	1,450	1,338	122,986	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	2,000	1,817	166,984	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	1,100	916	84,193	2030/12/21
	1 AUST GOVT 311121	1.0	3,500	2,846	261,496	2031/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,610	2,148	197,390	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,550	2,188	201,082	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	1,900	1,625	149,309	2032/11/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,450	919	84,467	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,400	1,332	122,454	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	1,770	1,669	153,392	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,000	994	91,357	2024/4/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	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		
オーストラリア	%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
国債証券	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,500	1,469	134,968	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,650	1,605	147,452	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,280	1,233	113,347	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,400	1,275	117,208	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	890	757	69,548	2041/5/21
	3 AUST GOVT 331121	3.0	1,700	1,618	148,668	2033/11/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,380	1,181	108,536	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,200	2,207	202,837	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,800	1,795	164,908	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,150	1,068	98,142	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 340521	3.75	1,100	1,119	102,859	2034/5/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	960	961	88,323	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,950	3,049	280,193	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,400	1,518	139,548	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	900	955	87,769	2027/4/21
小計					3,787,753	
ニュージーランド			千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券	1.75 NZ GOVT 410515	1.75	300	201	16,882	2041/5/15
	2 NZ GOVT 320515	2.0	800	674	56,536	2032/5/15
	2.75 NZ GOVT 250415	2.75	900	868	72,721	2025/4/15
	2.75 NZ GOVT 370415	2.75	700	586	49,114	2037/4/15
	2.75 NZ GOVT 510515	2.75	600	448	37,545	2051/5/15
	3 NZ GOVT 290420	3.0	800	755	63,314	2029/4/20
	3.5 NZ GOVT 330414	3.5	700	666	55,799	2033/4/14
	4.5 NZ GOVT 270415	4.5	800	813	68,127	2027/4/15
小計					420,041	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	1.25	550	520	51,261	2026/11/1
	1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	100	91	8,988	2031/7/1
	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	790	676	66,589	2050/3/1
	1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	460	399	39,292	2051/10/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,000	976	96,195	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	500	467	46,046	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	800	789	77,736	2025/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	250	237	23,398	2039/7/1
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	250	248	24,432	2028/5/1
	2.625 SINGAPORGOV 320801	2.625	400	394	38,815	2032/8/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	700	705	69,440	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	400	405	39,900	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	953	93,920	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	800	803	79,091	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	1,500	1,497	147,491	2024/9/1
	3 SINGAPORGOVT 720801	3.0	170	189	18,656	2072/8/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	632	62,242	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	570	585	57,632	2027/3/1
小計					1,041,131	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,500	1,385	42,060	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	1,000	30,387	2027/5/31
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	2,300	2,271	68,957	2032/7/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,300	2,318	70,385	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	800	762	23,146	2040/5/22
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	1,000	992	30,123	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,950	1,941	58,952	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	3,000	3,034	92,126	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,500	2,527	76,740	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,500	1,526	46,357	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,500	1,523	46,241	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,500	1,525	46,322	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,043	92,416	2025/9/15
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	3,100	2,976	90,358	2050/6/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	1,200	1,237	37,586	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	3,000	3,092	93,879	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	524	15,936	2030/4/15
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	2,500	2,680	81,389	2042/10/15
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,200	1,275	38,740	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	2,900	3,151	95,694	2037/4/7
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	700	773	23,479	2038/6/8
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	640	700	21,263	2048/7/6
小	計					1,222,547	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 240915	1.99	10,000	9,944	189,082	2024/9/15
		1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	4,000	3,962	75,344	2025/4/9
		2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	9,000	8,958	170,345	2025/5/25
		2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	10,000	9,960	189,389	2025/2/24
		2.28 CHINA GOVT 240317	2.28	10,000	10,008	190,295	2024/3/17
		2.28 CHINA GOVT 251125	2.28	12,000	11,920	226,650	2025/11/25
		2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	10,000	9,879	187,858	2027/1/20
		2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	4,000	3,948	75,071	2027/10/15
		2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	10,000	10,009	190,330	2024/9/2
		2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	8,000	7,923	150,666	2027/4/15
		2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	8,000	7,920	150,594	2027/7/25
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	5,000	4,868	92,567	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	5,000	4,921	93,574	2029/9/25
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	10,000	9,870	187,673	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	11,000	11,018	209,514	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	7,000	6,856	130,366	2032/8/15
		2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,028	95,614	2026/8/4
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	15,000	14,911	283,520	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	9,000	8,854	168,368	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	9,000	8,870	168,672	2032/5/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	8,000	7,989	151,919	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	7,000	6,935	131,871	2032/11/15
		2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	15,000	15,114	287,392	2024/4/8

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 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		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	15,000	15,082	286,783	2027/6/4
	2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	4,997	95,029	2031/11/18
	2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	2,000	2,018	38,385	2026/5/5
	2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	8,000	8,056	153,185	2028/10/14
	2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	9,000	9,096	172,959	2024/10/17
	2.99 CHINA GOVT 251015	2.99	3,000	3,039	57,796	2025/10/15
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	14,000	14,185	269,715	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	7,000	7,102	135,047	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	11,000	11,130	211,630	2031/5/27
	3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	11,000	11,165	212,308	2026/3/11
	3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	10,000	10,190	193,762	2026/12/5
	3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	3,000	2,915	55,440	2052/10/25
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	10,000	10,232	194,568	2029/11/21
	3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,193	174,797	2025/12/6
	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	7,000	7,158	136,107	2026/6/6
	3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	8,000	8,233	156,543	2028/11/22
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	13,000	13,473	256,178	2030/11/19
	3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	12,000	12,360	235,031	2027/12/3
	3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	6,000	6,212	118,116	2029/5/23
	3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	6,000	6,052	115,074	2052/4/15
	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	9,000	9,128	173,564	2050/3/16
	3.52 CHINA GOVT 270504	3.52	1,000	1,041	19,793	2027/5/4
	3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	4,000	4,164	79,192	2051/10/18
	3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,183	79,552	2028/8/16
	3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	9,000	9,180	174,562	2024/6/22
	3.59 CHINA GOVT 270803	3.59	7,000	7,327	139,320	2027/8/3
	3.6 CHINA GOVT 250906	3.6	9,000	9,297	176,777	2025/9/6
	3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	7,000	7,212	137,143	2025/6/7
	3.69 CHINA GOVT 240921	3.69	4,000	4,101	77,981	2024/9/21
	3.69 CHINA GOVT 280517	3.69	5,000	5,274	100,284	2028/5/17
	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	6,000	6,452	122,689	2051/4/12
	3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	2,000	2,065	39,274	2025/3/8
	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	10,000	10,919	207,630	2050/9/14
	3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	6,000	6,586	125,229	2049/7/22
	4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	9,000	10,246	194,827	2048/10/22
小 計					8,912,969	
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	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	4,000	3,751	143,779	2025/4/30
	0.5 ISRAEL FIXED 260227	0.5	1,800	1,661	63,659	2026/2/27
	1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	1,800	1,552	59,502	2030/3/31
	1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,500	1,278	48,982	2032/4/30
	1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	1,800	1,431	54,880	2037/5/31
	1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	1,800	1,731	66,359	2025/8/31
	2 ISRAEL FIXED BO 270331	2.0	2,500	2,408	92,310	2027/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	3,000	3,092	118,527	2024/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,650	1,761	67,507	2047/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,510	1,931	74,030	2042/1/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
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	千円	
国債証券	6.25	ISRAEL FIXED 261030			2026/10/30
小 計				29,849	
合 計				819,390	
				225,055,227	

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

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 225,055,227	% 97.2
コール・ローン等、その他	6,443,939	2.8
投資信託財産総額	231,499,166	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（227,032,959千円）の投資信託財産総額（231,499,166千円）に対する比率は98.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=129.27円	1 カナダドル=96.51円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ユーロ=141.09円
1 イギリスポンド=160.40円	1 スウェーデンクローネ=12.67円	1 ノルウェークローネ=13.06円	1 デンマーククローネ=18.96円
1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 オーストラリアドル=91.87円	1 ニュージーランドドル=83.78円	1 シンガポールドル=98.47円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 中国元=19.0141円	1 イスラエルシェケル=38.3249円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	453,943,495,513 円
コール・ローン等	1,956,314,371
公社債(評価額)	225,055,227,991
未収入金	225,260,171,381
未収利息	1,072,244,598
前払費用	599,537,172
(B) 負債	223,099,387,442
未払金	222,739,200,712
未払解約金	360,185,897
未払利息	833
(C) 純資産総額(A-B)	230,844,108,071
元本	197,648,585,205
次期繰越損益金	33,195,522,866
(D) 受益権総口数	197,648,585,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,680円

<注記事項>

- ①期首元本額 207,797,445,119円
期中追加設定元本額 295,149,205,041円
期中一部解約元本額 305,298,064,955円
また、1口当たり純資産額は、期末1.1680円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	90,390,214,009円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	16,938,050,283円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	11,836,613,756円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	11,450,242,548円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	10,221,600,661円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	9,817,843,855円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	8,049,330,980円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,379,885,493円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,139,379,769円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	3,938,003,291円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,708,138,293円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,424,810,611円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,292,590,386円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,280,758,521円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,269,914,309円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,002,113,906円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	1,973,203,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	823,298,571円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	801,899,314円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	767,455,615円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	764,138,227円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	472,626,962円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)	379,989,610円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01(適格機関投資家限定)	376,017,480円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	374,936,978円

○損益の状況 (2022年1月27日~2023年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	4,842,008,862 円
受取利息	4,843,719,322
その他収益金	132,461
支払利息	△ 1,842,921
(B) 有価証券売買損益	△ 37,798,191,329
売買益	65,309,182,456
売買損	△ 103,107,373,785
(C) 保管費用等	△ 31,203,396
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 32,987,385,863
(E) 前期繰越損益金	72,724,250,082
(F) 追加信託差損益金	56,205,214,325
(G) 解約差損益金	△ 62,746,555,678
(H) 計(D+E+F+G)	33,195,522,866
次期繰越損益金(H)	33,195,522,866

- (注) (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) (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) (G) 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。

MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	359,565,752円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	352,830,037円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	336,722,167円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	329,350,862円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	325,643,502円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	322,720,012円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	322,196,277円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	321,351,725円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	316,748,113円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	315,633,120円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	315,490,691円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	315,059,067円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	312,894,225円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	81,644,836円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	74,233,155円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,683,199円
ラップ向けインデックス f 先進国債券 (為替ヘッジあり)	735,357円
合計	197,648,585,205円