

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券および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等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%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、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券および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。このほか、日本を含む先進国の公社債に直接投資することがあります。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	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ます。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	<p>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。</p> <p>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。）</p>	

※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
 イーマックス

eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第5期（決算日：2020年1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御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）」は、去る1月27日に第5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。

MUFG

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）

お客さまのお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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			合成ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	円		%		%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	—	—	—	10,000	—	—	—	1
1期(2016年1月26日)	10,141	0	1.4		10,163	1.6	96.9	0.0	537
2期(2017年1月26日)	10,150	0	0.1		10,223	0.6	97.7	—	167
3期(2018年1月26日)	10,188	0	0.4		10,309	0.8	98.5	0.1	153
4期(2019年1月28日)	10,246	0	0.6		10,417	1.1	98.3	0.1	259
5期(2020年1月27日)	10,601	0	3.5		10,827	3.9	97.5	0.0	199

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		合 成 ベ ン チ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年1月28日	10,246	% —	10,417	% —	98.3	0.1
1月末	10,256	0.1	10,427	0.1	98.2	0.1
2月末	10,257	0.1	10,434	0.2	99.3	0.1
3月末	10,385	1.4	10,567	1.4	98.5	0.0
4月末	10,330	0.8	10,515	0.9	98.5	0.0
5月末	10,433	1.8	10,624	2.0	96.9	0.0
6月末	10,545	2.9	10,741	3.1	98.1	0.0
7月末	10,570	3.2	10,771	3.4	97.8	0.1
8月末	10,801	5.4	11,012	5.7	97.1	0.0
9月末	10,702	4.5	10,913	4.8	99.3	0.0
10月末	10,610	3.6	10,823	3.9	99.5	0.0
11月末	10,585	3.3	10,802	3.7	98.6	0.0
12月末	10,532	2.8	10,752	3.2	99.7	0.3
(期 末) 2020年1月27日	10,601	3.5	10,827	3.9	97.5	0.0

(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5期：2019年1月29日～2020年1月27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5期首	10,246円
第5期末	10,601円
既払分配金	0円
騰落率	3.5%

※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

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

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（3.9%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

主に外国債券市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	6.3%	50.0%
日本債券インデックスマザーファンド	1.5%	49.5%

第5期：2019年1月29日～2020年1月27日

▶ 投資環境について

▶ 国内債券市況

国内債券市況は上昇しました。

期の前半は、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから国内債券市況は上昇しました。期の後半は、日本銀行による追加緩和期待の後退や米中貿易交渉の進展などから国内債券市況は下落しましたが、期を通して見ると国

内債券市況は上昇しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では上昇しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして国内債券、日本を除く先進国債券の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動するよう運用を行いました。

当期の資産配分は、国内債券およびヘッジ付先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%となるように調整を行いました。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グ

ループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶ 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 債券バランス（2資産均等型）

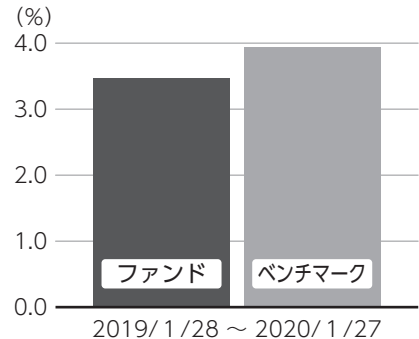
基準価額の騰落率は3.5%の上昇となり、ベンチマークの3.9%の上昇を0.4%下回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

日本債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶ 日本債券インデックスマザーファンド

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：評価時価差異要因*によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

主なマイナス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

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5期 2019年1月29日～2020年1月27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	600

(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 債券バランス（2資産均等型）

資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

▶ 日本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。

▶ 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。

2019年1月29日～2020年1月27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	45	0.433	(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）	(20)	(0.189)	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）	(20)	(0.189)	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)	(0.054)	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) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	1	0.009	(c) 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)	(0.005)	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	46	0.442	

期中の平均基準価額は、10,507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。

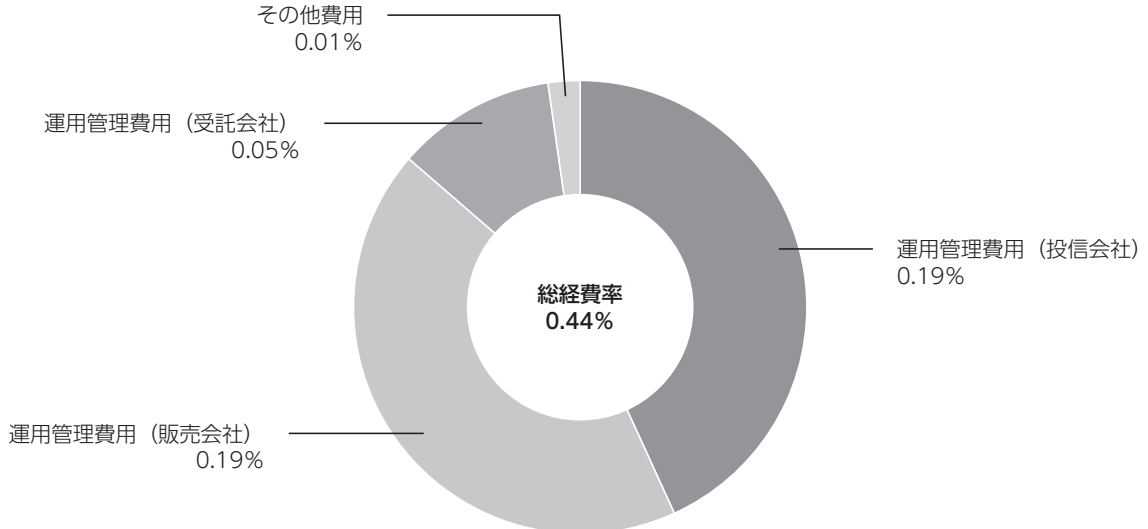
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.44%**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

(2019年1月29日～2020年1月27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
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	239,413	318,435	267,773	354,165
日本債券インデックスマザーファンド	234,483	320,008	257,693	350,951

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月29日～2020年1月27日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

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			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 2,814,608	百万円 690,127	24.5	百万円 2,822,336	百万円 683,467	24.2
為替直物取引	52,690	12,879	24.4	56,324	22,555	40.0

平均保有割合 0.0%

※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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 270,170	百万円 89,154	33.0	百万円 230,357	百万円 50,004	21.7

平均保有割合 0.0%

※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。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1,648	百万円 503	百万円 2,584

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 3,700

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、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年1月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	102,174	73,815	99,739
日本債券インデックスマザーファンド	95,606	72,396	98,574

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	99,739	49.8
日本債券インデックスマザーファンド	98,574	49.2
コール・ローン等、その他	1,928	1.0
投資信託財産総額	200,241	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（234,687,280千円）の投資信託財産総額（238,131,874千円）に対する比率は98.6%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=109.06円	1 カナダドル=82.94円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ユーロ=120.30円
1 イギリスポンド=142.51円	1 スウェーデンクローネ=11.40円	1 ノルウェークローネ=12.05円	1 デンマーククローネ=16.10円
1 ポーランドズロチ=28.27円	1 オーストラリアドル=74.30円	1 シンガポールドル=80.60円	1 南アフリカランド=7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年1月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	200,241,551
コール・ローン等	1,467,702
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	99,739,082
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	98,574,582
未収入金	460,185
(B) 負債	944,726
未払解約金	510,522
未払信託報酬	430,382
その他未払費用	3,822
(C) 純資産総額(A-B)	199,296,825
元本	188,006,374
次期繰越損益金	11,290,451
(D) 受益権総口数	188,006,374口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,601円

<注記事項>

- ①期首元本額 253,106,128円
 期中追加設定元本額 625,679,444円
 期中一部解約元本額 690,779,198円
 また、1口当たり純資産額は、期末10,601円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年1月29日～ 2020年1月27日
費用控除後の配当等収益額	2,068,458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	9,065,195円
分配準備積立金額	156,798円
当ファンドの分配対象収益額	11,290,451円
1万口当たり収益分配対象額	600円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

*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る場合があります。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。

○損益の状況（2019年1月29日～2020年1月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 201
受取利息	2
支払利息	△ 203
(B) 有価証券売買損益	1,241,375
売買益	3,448,813
売買損	△ 2,207,438
(C) 信託報酬等	△ 880,697
(D) 当期損益金(A+B+C)	360,477
(E) 前期繰越損益金	25,762
(F) 追加信託差損益金	10,904,212
(配当等相当額)	(8,285,907)
(売買損益相当額)	(2,618,305)
(G) 計(D+E+F)	11,290,451
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	11,290,451
追加信託差損益金	10,904,212
(配当等相当額)	(8,814,805)
(売買損益相当額)	(2,089,407)
分配準備積立金	2,225,256
繰越損益金	△ 1,839,017

- (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。

日本債券インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年5月13日

[計算期間：2018年5月15日～2019年5月13日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第18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18期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	NOMURA-BPI 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果を NOMURA-BPI 総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主 要 運 用 対 象	NOMURA-BPI 総合に採用されている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は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2	457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1	608,830

(注) NOMURA-BPI 総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2018年5月14日	円	%		%	%	%
	13,283	—	381.82	—	98.4	0.3
5月末	13,306	0.2	382.50	0.2	99.3	0.4
6月末	13,312	0.2	382.67	0.2	100.9	0.4
7月末	13,288	0.0	381.98	0.0	99.4	0.3
8月末	13,216	△0.5	379.89	△0.5	98.6	0.4
9月末	13,184	△0.7	378.99	△0.7	98.6	0.1
10月末	13,208	△0.6	379.64	△0.6	99.2	0.4
11月末	13,263	△0.2	381.24	△0.2	98.8	0.4
12月末	13,360	0.6	384.13	0.6	99.6	0.1
2019年1月末	13,415	1.0	385.58	1.0	99.6	0.1
2月末	13,443	1.2	386.43	1.2	99.5	0.1
3月末	13,538	1.9	389.14	1.9	99.9	0.1
4月末	13,495	1.6	387.94	1.6	99.8	0.1
(期 末) 2019年5月13日	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1

(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

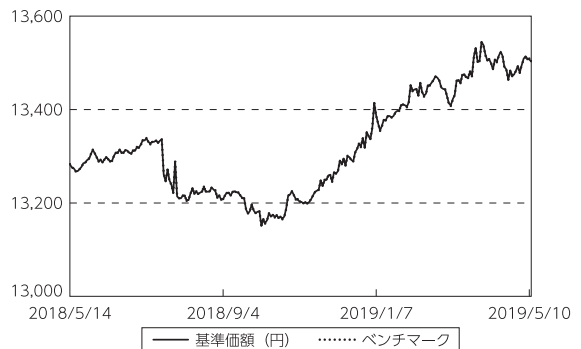
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.7%の上昇となりました。

◎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(1.7%)とほぼ同程度となりました。

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。

●投資環境について

- ・国内債券市況は、日本銀行による金融緩和策の柔軟化を受けて下落する局面もありましたが、期の後半にかけ世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから、期を通じて見ると上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
 - ・ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました[※]。
- [※]一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 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1.7%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 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)

- ・ポートフォリオ要因

(主なマイナス要因)

- ・評価時価差異要因[※]

[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

○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。

○1万口当たりの費用明細

(2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,322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

(2018年5月15日～2019年5月13日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	213,627,146	155,720,266 (100,000)
	地方債証券	8,762,826	6,473,202
	特殊債券	14,732,314	13,122,127 (598,998)
	社債券	12,843,825	6,478,771 (400,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)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		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 14,041	百万円 15,421	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月15日～2019年5月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	249,966	70,625	28.3	181,794	26,887	14.8

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1,000	百万円 802	百万円 1,741

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 3,200

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モルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2019年5月13日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 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			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	463,721,000	506,833,740	83.2	—	54.4	18.2	10.6	
地方債証券	30,807,350 (30,807,350)	32,542,061 (32,542,061)	5.3 (5.3)	— (—)	3.2 (3.2)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)	
特殊債券 (除く金融債)	33,348,097 (33,348,097)	35,968,864 (35,968,864)	5.9 (5.9)	— (—)	4.0 (4.0)	1.2 (1.2)	0.8 (0.8)	
金融債券	3,200,000 (3,200,000)	3,214,444 (3,214,444)	0.5 (0.5)	— (—)	0.1 (0.1)	0.3 (0.3)	0.2 (0.2)	
普通社債券	28,573,000 (28,573,000)	29,238,091 (29,238,091)	4.8 (4.8)	0.0 (0.0)	2.0 (2.0)	2.5 (2.5)	0.3 (0.3)	
合 計	559,649,447 (95,928,447)	607,797,202 (100,963,461)	99.8 (16.6)	0.0 (0.0)	63.7 (9.3)	23.8 (5.5)	12.4 (1.7)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第390回利付国債 (2年)	0.1	4,750,000	4,764,250	2020/7/1
第391回利付国債 (2年)	0.1	4,700,000	4,715,181	2020/8/1
第392回利付国債 (2年)	0.1	2,500,000	2,508,625	2020/9/1
第393回利付国債 (2年)	0.1	900,000	903,303	2020/10/1
第394回利付国債 (2年)	0.1	2,850,000	2,860,887	2020/11/1
第395回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,008,080	2020/12/1
第396回利付国債 (2年)	0.1	2,700,000	2,711,502	2021/1/1
第397回利付国債 (2年)	0.1	1,900,000	1,908,512	2021/2/1
第398回利付国債 (2年)	0.1	4,950,000	4,973,166	2021/3/1
第399回利付国債 (2年)	0.1	1,500,000	1,507,350	2021/4/1
第124回利付国債 (5年)	0.1	2,430,000	2,437,095	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	4,400,000	4,415,796	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	2,960,000	2,972,580	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	3,870,000	3,889,001	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	3,850,000	3,871,483	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	3,100,000	3,119,406	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	4,950,000	4,984,254	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	4,010,000	4,040,395	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	3,650,000	3,680,149	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	4,380,000	4,419,858	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	4,610,000	4,655,085	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	4,480,000	4,526,860	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	1,450,000	1,466,167	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	4,700,000	4,754,614	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	8,000,000	8,098,320	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	800,000	810,360	2024/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	475,000	713,331	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	870,000	1,268,964	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	733,000	1,077,561	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	1,098,000	1,628,729	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	1,175,000	1,686,559	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,070,000	1,512,412	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,190,000	1,618,602	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,250,000	1,587,175	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,570,000	1,479,693	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	2,090,000	2,319,147	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	2,030,000	2,181,965	2058/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,396,203	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	3,700,000	3,751,615	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,136,000	2,169,748	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,100,000	2,127,468	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	6,860,000	7,010,439	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	3,469,000	3,562,940	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,190,000	1,217,810	2021/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第315回利付国債 (10年)	1.2	3,633,000	3,737,557	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	2,280,000	2,340,807	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,957,000	2,015,475	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	2,480,000	2,548,249	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,719,000	1,775,830	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	1,980,000	2,040,291	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,598,875	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,470,000	1,514,805	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,730,593	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	2,800,000	2,884,224	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,835,000	3,959,790	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	730,000	752,885	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,540,000	2,628,823	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	3,700,000	3,809,631	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	5,860,000	6,093,462	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	3,330,000	3,470,892	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,060,000	1,095,552	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	5,040,000	5,218,819	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	6,550,000	6,794,904	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,330,000	4,501,554	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	4,970,000	5,149,864	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	4,080,000	4,234,591	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	940,000	964,985	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,730,000	3,854,470	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,660,000	4,822,261	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	4,850,000	5,025,909	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	3,770,000	3,887,020	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,480,000	2,525,508	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	4,760,000	4,848,869	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	3,660,000	3,728,002	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	4,190,000	4,268,897	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	4,790,000	4,881,201	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	3,600,000	3,667,788	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	5,600,000	5,703,936	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	4,190,000	4,266,383	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	6,750,000	6,867,450	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	7,750,000	7,881,440	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	6,380,000	6,485,142	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	5,400,000	5,486,076	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	1,800,000	1,826,712	2029/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	98,031	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	123,469	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	146,644	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	169,039	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	135,897	2031/5/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第6回利付国債(30年)	2.4	169,000	218,143	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	164,000	210,900	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	142,000	174,215	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	116,000	136,145	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	185,000	209,697	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	137,000	166,898	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	220,000	281,067	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	205,000	259,562	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	493,000	654,122	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	346,000	465,722	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	302,000	407,591	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	327,000	437,503	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	427,000	566,056	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	303,000	402,568	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	495,000	675,283	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	379,000	505,673	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	570,000	781,145	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	554,000	760,919	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	411,000	565,741	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	742,000	998,464	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	884,000	1,207,711	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	860,000	1,194,316	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	911,000	1,270,817	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,450,000	2,003,305	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,496,000	2,046,916	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,358,000	1,840,578	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,739,000	2,402,585	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,644,000	2,180,782	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	2,116,000	2,904,654	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,549,000	3,406,789	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,829,000	2,454,499	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,057,000	2,724,722	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,185,000	1,547,882	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,540,000	2,050,032	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,220,000	1,599,029	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	1,150,000	1,483,189	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,520,000	1,962,183	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,320,000	1,705,598	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,290,000	1,670,253	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,190,000	1,485,381	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,550,000	1,935,810	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,770,000	2,255,971	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,310,000	1,606,977	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	2,580,000	3,166,072	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	970,000	1,045,068	2046/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,510,000	1,436,206	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	1,660,000	1,661,992	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	980,000	1,004,980	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	1,870,000	2,014,513	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	1,500,000	1,614,855	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	1,490,000	1,602,986	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	1,440,000	1,548,100	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	2,320,000	2,492,329	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	710,000	743,242	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	3,050,000	3,357,958	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	1,600,000	1,673,872	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	500,000	494,855	2049/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	117,663	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	217,947	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	536,650	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	209,142	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	225,463	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	509,673	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	255,949	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	479,303	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	157,235	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	628,810	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	302,042	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	477,762	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	480,822	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	348,372	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	545,440	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	943,569	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	477,687	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	179,467	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	599,324	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	695,906	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	358,729	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	651,728	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	224,326	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	236,781	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	462,037	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	56,654	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	358,863	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	398,524	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	758,029	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	475,284	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	766,573	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	566,489	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	602,524	2026/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	523,363	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	945,383	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	479,154	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,291,235	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	552,839	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,432,000	1,677,845	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	390,000	455,874	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	615,000	723,756	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	1,017,000	1,218,335	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	320,000	378,115	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	343,000	409,799	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	470,000	557,570	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,345,000	1,601,760	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,060,000	1,276,526	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	700,269	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	530,000	650,500	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	640,000	779,648	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	359,958	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	870,000	1,047,741	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	711,000	862,954	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	567,000	685,287	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	800,000	951,440	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	800,000	954,408	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	1,096,000	1,329,228	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	711,000	872,084	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,340,000	1,630,002	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,382,000	1,686,841	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,320,000	1,616,472	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	1,154,000	1,425,443	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	1,346,000	1,668,165	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,210,000	1,486,485	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	776,000	947,759	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	791,439	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	810,000	953,337	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	989,000	1,200,289	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	913,755	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,368,000	1,696,402	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	750,000	921,367	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	1,454,000	1,825,453	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	890,000	1,096,364	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	440,000	536,830	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,014,000	1,240,385	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	450,000	545,049	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,682,000	2,042,133	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	480,000	576,883	2031/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第132回利付国債 (20年)	1.7	1,187,000	1,429,599	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,740,000	2,117,371	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	1,885,000	2,298,814	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	600,000	724,080	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	650,000	776,152	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	1,132,000	1,368,871	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	400,000	473,336	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	119,629	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,397,000	2,904,277	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	2,220,000	2,694,858	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	1,090,000	1,337,767	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,980,000	2,380,811	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	350,000	416,080	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,410,000	2,935,958	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	2,260,000	2,758,013	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	2,160,000	2,609,409	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	4,820,000	5,760,960	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	2,220,000	2,656,674	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	2,620,000	3,099,853	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	2,340,000	2,700,172	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,740,000	3,163,357	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	3,490,000	4,085,638	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	2,760,000	3,189,483	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	3,330,000	3,740,022	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	2,330,000	2,386,502	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	1,840,000	1,820,422	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	2,420,000	2,512,250	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	2,070,000	2,181,117	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	3,530,000	3,778,794	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	2,590,000	2,723,385	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	2,710,000	2,846,448	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	2,730,000	2,864,206	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	2,800,000	2,884,448	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,730,000	1,779,633	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	2,500,000	2,661,000	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	2,450,000	2,512,793	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	200,000	201,108	2039/3/20
小 計		463,721,000	506,833,740	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,251	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	13,655	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	105,072	2038/9/17
第12回東京都公募公債 (20年)	2.31	100,000	118,887	2027/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	118,397	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	96,173	2029/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	97,294	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	143,282	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	84,870	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	117,852	2033/3/18
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	101,177	2020/6/19
第687回東京都公募公債	1.12	100,000	101,499	2020/9/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	102,533	2021/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	175,079	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	102,389	2022/6/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	103,220	2023/6/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	103,271	2024/3/19
第749回東京都公募公債	0.436	300,000	307,917	2025/9/19
第750回東京都公募公債	0.444	200,000	205,456	2025/12/19
第752回東京都公募公債	0.126	100,000	100,632	2025/12/19
第754回東京都公募公債	0.06	120,000	120,244	2026/3/19
第755回東京都公募公債	0.06	300,000	300,612	2026/3/19
第758回東京都公募公債	0.03	300,000	300,000	2026/6/19
第765回東京都公募公債	0.21	300,000	304,227	2027/3/19
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	101,358	2020/10/29
平成25年度第4回北海道公募公債	0.85	100,000	103,357	2023/6/28
平成25年度第7回北海道公募公債	0.8	150,000	154,923	2023/8/30
平成25年度第9回北海道公募公債	0.7	300,000	308,898	2023/10/31
平成27年度第9回北海道公募公債	0.486	200,000	205,884	2025/10/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	101,287	2026/2/26
平成28年度第12回北海道公募公債	0.165	300,000	302,850	2026/12/28
平成29年度第15回北海道公募公債	0.23	117,000	118,388	2028/2/28
第29回1号宮城県公募公債	0.68	100,000	102,957	2023/10/25
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	80,000	89,459	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	80,000	112,272	2036/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	115,766	2034/9/20
第189回神奈川県公募公債	0.89	400,000	410,016	2022/3/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	102,544	2022/6/20
第226回神奈川県公募公債	0.195	300,000	303,876	2027/3/19
第228回神奈川県公募公債	0.205	200,000	202,662	2027/6/18
第5回大阪府公募公債 (20年)	2.16	100,000	121,438	2030/5/28
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	200,000	238,236	2033/9/27
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	70,969	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,242	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	102,560	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	57,471	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	57,545	2022/3/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	109,632	2023/9/27
第380回大阪府公募公債	0.762	100,000	103,424	2024/1/30
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	206,342	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	400,000	410,948	2024/9/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	112,785	2025/2/26
第394回大阪府公募公債	0.489	200,000	205,382	2025/3/28
第414回大阪府公募公債	0.037	100,000	99,977	2026/11/27
第416回大阪府公募公債	0.185	108,000	109,162	2027/1/29
第429回大阪府公募公債	0.197	103,000	103,927	2028/2/25
第431回大阪府公募公債	0.165	300,000	301,782	2028/4/26
平成21年度第3回京都府公募公債 (20年)	2.19	100,000	121,117	2029/9/20
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	143,976	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	235,710	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	102,521	2023/3/22
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	108,649	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債 (18年)	1.26	200,000	225,154	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	53,991	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,523	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,871	2028/5/26
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	109,338	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債 (20年)	1.64	300,000	352,368	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	118,498	2032/11/19
平成27年度第6回兵庫県公募公債	0.56	200,000	206,628	2025/8/18
第3回静岡県公募公債 (15年)	1.368	100,000	111,060	2027/10/29
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	101,391	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	101,347	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	102,223	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	103,823	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	133,952	2023/10/24
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	124,812	2025/5/21
平成27年度第5回静岡県公募公債	0.578	100,000	103,401	2025/6/20
平成30年度第9回静岡県公募公債	0.239	100,000	101,437	2028/6/20
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	102,432	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	102,404	2021/9/30
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	300,000	333,669	2026/11/13
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	102,539	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	102,681	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	102,705	2022/11/30
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)	1.314	300,000	332,136	2027/12/13
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	102,937	2024/8/26
平成26年度第12回愛知県公募公債	0.515	100,000	102,695	2024/10/25
平成27年度第18回愛知県公募公債	0.22	100,000	101,282	2026/2/16
平成28年度第1回愛知県公募公債	0.08	100,000	100,347	2026/4/28
平成28年度第8回愛知県公募公債	0.065	108,000	108,274	2026/8/26
平成22年度第5回広島県公募公債	1.0	200,000	203,040	2020/11/25
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	27,306	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	102,404	2021/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,909	2025/11/25
平成29年度第5回広島県公募公債	0.245	100,000	101,540	2028/1/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第4回埼玉県公募公債(20年)		2.18	200,000	235,460	2027/9/21
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	102,660	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債		1.2	100,000	102,624	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債		0.801	100,000	102,732	2022/10/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	101,797	2025/1/28
平成27年度第6回埼玉県公募公債		0.505	200,000	206,180	2025/9/29
平成29年度第8回埼玉県公募公債		0.245	200,000	203,080	2028/1/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	(30年)	2.62	70,000	96,492	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	(30年)	2.28	80,000	105,876	2038/9/17
平成22年度第3回福岡県公募公債		1.11	100,000	101,410	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債		0.94	20,000	20,271	2020/10/28
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	(15年)	1.491	100,000	110,994	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募公債		0.441	100,000	102,363	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債		0.654	100,000	103,243	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債		0.464	100,000	102,867	2025/12/25
第2回千葉県公募公債(20年)		2.26	100,000	116,356	2026/9/18
第9回千葉県公募公債(20年)		1.84	80,000	94,954	2030/10/11
平成22年度第11回千葉県公募公債		1.26	80,000	81,703	2021/1/25
平成22年度第12回千葉県公募公債		1.28	100,000	102,271	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債		1.33	100,000	102,463	2021/3/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	20,567	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	20,613	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債		0.81	100,000	102,829	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債		0.58	82,500	84,338	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債		0.67	100,000	102,967	2023/11/24
平成28年度第5回千葉県公募公債		0.15	100,000	100,912	2026/12/25
平成28年度第8回千葉県公募公債		0.22	200,000	202,980	2027/3/25
第7回群馬県公募公債		1.08	400,000	406,572	2020/11/25
第15回群馬県公募公債		0.08	200,000	200,750	2026/11/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債		0.06	100,000	100,223	2026/10/30
平成24年度第1回大分県公募公債		0.8	100,260	103,006	2022/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債		0.476	203,400	209,388	2025/10/30
第90回共同発行市場公募地方債		1.12	30,000	30,456	2020/9/25
第91回共同発行市場公募地方債		0.9	175,000	177,250	2020/10/23
第94回共同発行市場公募地方債		1.24	100,000	102,095	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債		1.28	100,000	102,271	2021/2/25
第99回共同発行市場公募地方債		1.17	200,000	204,912	2021/6/25
第100回共同発行市場公募地方債		1.21	100,000	102,633	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債		1.05	100,000	102,376	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債		1.0	100,000	102,426	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債		1.01	300,000	308,364	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債		1.05	170,000	175,215	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債		0.89	100,000	102,668	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債		0.77	100,000	102,495	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	102,722	2022/9/22

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	200,000	205,124	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,563	2023/3/24
第126回共同発行市場公募地方債	0.81	210,000	217,287	2023/9/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,957	2023/10/25
第129回共同発行市場公募地方債	0.71	200,000	206,416	2023/12/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,502	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	206,276	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	300,000	309,960	2024/6/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,364	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,700	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	205,272	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	102,294	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,416	2025/5/23
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	309,351	2025/9/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,900	2025/12/25
第163回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	300,666	2026/10/23
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	303,456	2027/1/25
第172回共同発行市場公募地方債	0.225	200,000	202,856	2027/7/23
第178回共同発行市場公募地方債	0.23	200,000	202,732	2028/1/25
平成24年度第2回堺市公募公債	0.715	200,000	205,078	2022/12/19
平成25年度第1回長崎県公募公債	0.81	200,000	206,948	2023/9/27
平成23年度第1回滋賀県公募公債	1.02	100,000	102,575	2021/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債	0.65	100,000	102,885	2023/11/29
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,364	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	56,045	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	39,202	2021/11/25
平成24年度第1回浜松市公募公債	0.844	100,000	103,079	2023/1/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	166,643	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	224,682	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	122,088	2028/9/21
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,256	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,076	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	200,000	218,182	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	400,000	475,876	2028/12/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	97,360	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	102,666	2021/12/20
第1回京都市公募公債(20年)	2.14	200,000	223,740	2024/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	58,834	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	102,376	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	102,721	2022/10/21
平成26年度第4回京都市公募公債	0.544	100,000	102,842	2024/10/17
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	2.08	300,000	356,511	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	119,246	2030/9/13
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	97,513	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	226,754	2025/12/19

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第17回横浜市公募公債 (20年)	2.07	80,000	94,993	2028/12/20
第20回横浜市公募公債 (20年)	2.1	80,000	96,229	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,003	2023/2/20
第25回横浜市公募公債 (20年)	1.72	100,000	118,903	2032/7/16
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	206,670	2025/6/16
第27回横浜市公募公債 (20年)	1.599	60,000	70,724	2033/5/20
平成22年度第8回札幌市公募公債 (30年)	2.277	80,000	107,232	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	300,000	363,213	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募公債	0.961	100,000	108,493	2029/9/20
平成27年度第9回札幌市公募公債	0.19	100,000	101,054	2025/12/19
第3回川崎市公募公債 (15年)	1.82	100,000	102,910	2020/12/21
第44回川崎市公募公債 (5年)	0.162	130,400	130,616	2020/6/19
第17回北九州市公募公債 (20年)	1.529	100,000	117,576	2034/6/20
平成22年度第2回北九州市公募公債	1.26	100,000	102,019	2020/12/24
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	300,000	309,879	2023/12/26
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	109,102	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	102,434	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	200,000	205,478	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,478	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.371	100,000	115,371	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	103,258	2023/12/27
平成28年度第4回広島市公募公債	0.165	100,000	101,026	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	300,000	304,092	2028/2/25
平成22年度第2回千葉市公募公債	0.92	100,000	101,312	2020/10/22
平成24年度第1回相模原市公募公債	0.71	200,000	205,046	2022/12/20
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	87,050	88,460	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	98,410	100,946	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000	101,755	2023/4/26
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	102,406	2025/4/24
平成27年度第4回福井県公募公債	0.085	200,000	200,762	2026/4/27
平成23年度第1回徳島県公募公債	1.02	100,000	102,575	2021/11/30
平成27年度第1回徳島県公募公債	0.476	300,000	308,736	2025/11/27
平成29年度第2回徳島県公募公債	0.19	108,000	109,193	2027/11/30
平成24年度第1回山梨県公募公債	0.8	200,000	205,464	2022/10/28
平成24年度第2回岡山県公募公債	0.68	100,000	102,573	2023/3/29
平成26年度第1回岡山市公募公債	0.33	100,000	101,770	2025/1/30
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	200,186	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000	120,509	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,741	2024/3/19
小 計		30,807,350	32,542,061	
特殊債券(除く金融債)				
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,487	2021/2/26
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	240,668	2029/5/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,796	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,913	2029/10/31

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	135,299	2040/2/29
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,561	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	544,000	552,274	2020/6/30
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	354,000	358,927	2020/7/31
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	101,445	2020/9/30
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	300,000	304,152	2020/10/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	400,000	405,856	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	571,000	582,562	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	121,451	2031/1/31
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	400,000	410,576	2021/4/30
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	93,136	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	660,000	676,744	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	124,936	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,575	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	239,654	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	139,627	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	212,000	217,609	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	109,000	111,935	2022/3/18
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000	119,496	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	200,000	255,464	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	12,000	12,353	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	301,000	309,810	2022/9/30
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	100,000	103,022	2022/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	201,000	207,562	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	100,000	102,722	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	115,745	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	153,000	156,520	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	103,815	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	223,000	231,953	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	103,688	2023/9/29
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	200,000	206,728	2024/2/29
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	222,000	229,434	2024/3/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	103,377	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	116,445	2034/8/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.391	200,000	205,214	2025/4/30
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.44	105,000	108,215	2025/8/29
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	130,000	133,196	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	101,294	2026/2/27
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	301,000	302,348	2026/3/31
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	100,454	2026/4/30
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	101,929	2020/7/15
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.576	600,000	608,826	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.502	300,000	304,293	2021/12/24
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.46	300,000	304,227	2022/2/25
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	300,000	321,396	2022/7/15

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	101,348	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,399	2020/9/14
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	30,738	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,534	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	51,483	2021/12/14
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	102,759	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	103,229	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,462	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,931	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	165,404	2023/12/18
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	103,511	2024/6/14
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,350	2024/7/16
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	247,560	2024/9/13
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.005	203,000	203,755	2026/10/16
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	200,000	202,676	2027/6/14
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	400,000	405,952	2027/8/13
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	104,134	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,244	2023/2/24
第31回政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	103,150	2024/9/13
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,990	2025/9/16
第41回政府保証日本政策金融公庫債券	0.01	300,000	301,215	2026/9/15
第211回政府保証預金保険機構債券	0.1	100,000	100,353	2021/10/19
第3回政府保証新関西国際空港債券	0.644	100,000	103,536	2024/6/26
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	0.001	400,000	400,556	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	400,000	410,876	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,675	2023/12/18
第39回政府保証日本政策投資銀行	0.145	106,000	107,583	2027/3/15
第47回政府保証日本政策投資銀行	0.001	700,000	700,595	2021/3/26
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	120,000	139,372	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	133,415	2032/5/20
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.52	100,000	117,312	2026/6/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	200,000	233,262	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	46,298	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	151,690	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	194,474	2047/3/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	118,694	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)	2.83	400,000	541,956	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	500,000	687,540	2034/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	200,000	225,138	2025/3/21
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	150,000	183,432	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	60,564	2030/5/10
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.19	100,000	122,827	2031/3/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	60,231	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	118,230	2032/6/18
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	200,000	240,178	2044/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	134,970	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	114,011	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	60,615	2029/6/28
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,773	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	109,974	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	109,224	2023/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.043	200,000	240,648	2030/6/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	56,117	2024/9/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.851	300,000	355,680	2030/10/28
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	250,000	303,920	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	101,403	2020/6/26
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	98,448	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	101,568	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	95,509	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	173,650	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	119,727	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	51,019	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	102,156	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	236,224	2032/6/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	354,177	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	74,449	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	59,975	2033/1/28
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.035	300,000	307,725	2021/11/26
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	114,212	2035/6/28
F63回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.579	100,000	109,338	2025/6/20
F77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.519	200,000	221,444	2026/10/20
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.491	100,000	102,839	2025/10/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	337,377	2027/8/20
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.314	100,000	107,361	2025/3/7
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	115,169	2030/3/19
F124回地方公共団体金融機構債券	1.418	200,000	221,518	2027/6/4
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	115,696	2031/7/30
F132回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.09	100,000	106,508	2025/7/30
F149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	107,276	2025/12/19
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.052	300,000	324,375	2027/10/29
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	109,239	2029/2/28
F306回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.605	100,000	104,527	2028/3/22
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	96,966	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	95,336	2030/10/29
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	14,814	15,475	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	15,066	15,808	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	16,087	16,935	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	15,463	16,363	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	88,468	88,901	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	185,444	186,148	2033/1/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	15,482	16,320	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	13,424	13,831	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	13,795	14,416	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	15,230	15,965	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	16,024	16,841	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	13,827	14,442	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	10,313	10,363	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	16,474	17,308	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	10,102	10,145	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	14,537	15,257	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	17,123	18,251	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	21,656	21,842	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	14,989	15,736	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	17,481	18,465	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	11,460	11,652	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	15,977	16,332	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	18,480	18,997	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	18,609	19,162	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	56,379	57,884	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	12,964	13,367	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	13,009	13,495	2039/7/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.28	50,448	54,778	2044/6/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	13,237	13,590	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	29,680	30,780	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	15,892	16,538	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	31,601	33,967	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	33,133	35,485	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	33,307	35,534	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	15,585	16,318	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	36,164	38,414	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	14,914	15,527	2041/2/10
第39回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.15	300,000	361,014	2029/9/20
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	37,597	39,596	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	16,291	17,211	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	14,731	15,517	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	43,613	46,577	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.29	100,000	122,422	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	42,917	46,143	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	36,338	38,904	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	32,515	34,844	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	101,349	108,611	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	33,471	35,716	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	33,912	36,085	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	14,619	15,392	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	36,757	39,172	2046/8/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	39,787	42,232	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	41,395	43,929	2046/10/10
第54回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.09	300,000	303,516	2020/6/19
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	45,768	48,570	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	137,271	145,784	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	46,867	49,810	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	48,803	51,688	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	50,111	52,791	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.13	290,000	353,191	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	50,054	52,446	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	52,441	54,994	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	47,725	50,239	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	53,046	56,204	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	97,321	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	322,035	338,606	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	33,527	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	48,601	50,804	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	105,676	110,524	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	52,341	54,751	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	55,458	57,956	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	111,082	115,886	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	113,650	118,644	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	119,649	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	60,612	63,098	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	186,129	192,946	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	125,628	130,062	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	64,257	66,182	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	134,486	137,481	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	230,658	238,707	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	230,676	240,018	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	154,754	160,860	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.892	100,000	120,406	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441	300,000	331,977	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	400,755	416,372	2050/12/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	268,926	271,790	2051/12/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	272,931	276,896	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	174,556	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.801	100,000	119,884	2032/9/17
第124回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.428	200,000	222,376	2027/12/20
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	560,022	566,451	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,339	95,443	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,061	96,434	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	95,185	96,317	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,334	193,283	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,634	193,582	2053/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	192,584	194,831	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	194,182	195,962	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	194,944	197,452	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	97,784	99,267	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	98,357	100,074	2053/11/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.129	180,000	200,962	2035/11/20
第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.484	200,000	205,238	2025/12/19
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	56,020	2025/6/20
第25回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		0.22	300,000	303,378	2027/6/18
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	84,538	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	30,874	2021/12/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	51,212	2021/9/17
第27回西日本高速道路		0.58	600,000	619,020	2025/9/2
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	202,816	2026/2/12
第30回西日本高速道路		0.17	300,000	301,464	2026/5/22
第17回韓国輸出入銀行		0.16	100,000	100,009	2019/12/27
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	100,195	2021/6/28
小	計		33,348,097	35,968,864	
金融債券					
い第781号商工債券		0.24	100,000	100,212	2020/6/26
第310回信金中金債		0.225	200,000	200,504	2020/9/25
第311回信金中金債		0.225	200,000	200,550	2020/10/27
第315回信金中金債		0.075	400,000	400,284	2021/2/26
第322回信金中金債		0.03	300,000	299,892	2021/9/27
第327回信金中金債		0.06	200,000	200,082	2022/2/25
第332回信金中金債		0.09	300,000	300,405	2022/7/27
第336回信金中金債		0.1	300,000	300,555	2022/11/25
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,444	2023/1/27
第11号商工債券(10年)		0.66	100,000	102,573	2024/9/20
第211号商工債券(3年)		0.07	300,000	300,075	2020/8/27
第223号商工債券(3年)		0.11	300,000	300,306	2021/8/27
第2回信金中金債(10年)		0.52	300,000	308,562	2025/9/26
小	計		3,200,000	3,214,444	
普通社債券					
第567回東京電力		1.958	100,000	109,763	2030/7/29
第568回東京電力		1.155	100,000	101,179	2020/9/8
第499回中部電力		1.194	50,000	52,006	2023/6/23
第500回中部電力		0.875	100,000	103,122	2024/5/24
第518回中部電力		0.19	200,000	200,128	2023/1/25
第528回中部電力		0.13	200,000	199,144	2023/11/24
第496回関西電力		0.908	100,000	103,371	2025/2/25
第499回関西電力		0.68	200,000	204,252	2026/1/23
第508回関西電力		0.455	200,000	201,000	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	100,000	100,714	2027/7/23
第512回関西電力		0.32	200,000	200,320	2024/10/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第381回中国電力	0.953	100,000	103,371	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	102,605	2025/7/25
第402回中国電力	0.25	200,000	199,838	2024/10/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	103,252	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	105,078	2026/6/25
第310回北陸電力	0.748	200,000	205,444	2025/6/25
第322回北陸電力	0.38	200,000	200,156	2027/6/25
第481回東北電力	0.803	200,000	206,060	2025/7/25
第490回東北電力	0.22	100,000	100,133	2023/2/24
第494回東北電力	0.425	100,000	100,552	2027/6/25
第253回四国電力	1.0	100,000	103,263	2023/6/23
第371回九州電力	1.43	100,000	104,540	2022/12/22
第429回九州電力	0.909	200,000	206,382	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,063	2021/10/25
第437回九州電力	0.685	100,000	102,192	2026/1/23
第460回九州電力	0.18	200,000	199,890	2023/2/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	50,941	2020/12/25
第316回北海道電力	1.164	400,000	404,840	2020/6/25
第333回北海道電力	0.25	300,000	299,448	2023/6/23
第344回北海道電力	0.18	200,000	199,798	2022/9/22
第12回新関西国際空港	1.067	300,000	327,558	2029/9/20
第38回関西国際空港	1.112	50,000	51,394	2021/12/20
第7回大和ハウス工業	0.06	200,000	199,792	2021/6/18
第5回日揮	0.2	500,000	500,850	2022/10/13
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	100,205	2024/9/13
第10回アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,092	2022/6/13
第11回アサヒグループホールディングス	0.23	100,000	100,247	2024/6/13
第3回コカ・コーラウエスト	0.524	300,000	303,642	2022/6/17
第24回味の素	0.19	100,000	100,263	2024/3/8
第3回 キューピー	0.23	100,000	100,015	2026/2/13
第6回ヒューリック	0.494	300,000	300,054	2028/10/20
第6回J. フロント リテイリング	0.435	200,000	201,562	2027/8/4
第4回トヨタ紡織	0.21	300,000	302,151	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	200,000	199,394	2023/3/8
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	303,843	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,153	2024/7/19
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	100,848	2028/3/23
第1回電通	0.11	300,000	300,126	2023/10/25
第2回電通	0.24	200,000	200,798	2025/10/24
第2回大塚ホールディングス	0.26	100,000	100,149	2026/3/6
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	102,734	2022/12/2
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	199,824	2026/4/17
第23回ジェイ エフ イー ホールディングス	0.09	300,000	299,637	2022/5/23
第1回リクルートホールディングス	0.09	300,000	300,210	2022/3/9
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	102,399	2021/9/17

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第48回日本精工	0.16	200,000	200,266	2023/11/29
第15回パナソニック	0.19	300,000	300,600	2021/9/17
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,167	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	200,000	200,866	2028/3/17
第1回村田製作所	0.08	300,000	300,042	2022/1/24
第29回三菱重工業	0.662	300,000	306,876	2024/9/3
第34回三菱重工業	0.104	100,000	99,914	2022/8/29
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,062	2019/8/7
第7回J A三井リース	0.2	200,000	200,198	2022/9/15
第9回J A三井リース	0.22	100,000	100,147	2023/1/26
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,049	2019/8/5
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,165	2021/8/2
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.25	200,000	200,344	2022/10/31
第13回アイシン精機	0.827	100,000	103,107	2023/9/20
第1回明治安田生命2018基金	0.315	300,000	299,994	2023/9/25
第15回バン・パシフィック・インターナショナル	0.11	300,000	299,622	2022/3/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	102,983	2022/3/9
第33回丸井	0.04	200,000	199,732	2021/10/25
第48回クレディセゾン	1.038	200,000	206,778	2023/10/20
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	300,000	299,298	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	103,532	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.2	100,000	112,987	2026/10/30
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.56	100,000	102,402	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.46	100,000	120,518	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行	2.22	200,000	214,756	2022/10/27
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.78	100,000	116,165	2026/4/27
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.341	100,000	113,362	2026/6/15
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	101,816	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	102,400	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	224,788	2026/6/1
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	113,692	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	115,924	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	112,333	2026/9/11
第15回芙蓉総合リース	0.33	100,000	100,376	2024/12/6
第47回日産フィナンシャルサービス	0.23	200,000	199,358	2022/12/20
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	100,102	2022/10/18
第23回東京センチュリーリース	0.2	200,000	200,154	2023/4/13
第26回東京センチュリーリース	0.04	100,000	99,843	2021/10/15
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	201,324	2021/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	299,670	2021/3/19
第42回ホンダファイナンス	0.05	100,000	99,814	2022/6/20
第77回トヨタファイナンス	0.145	200,000	199,844	2024/7/25
第87回トヨタファイナンス	0.04	300,000	299,955	2022/4/19
第23回リコーリース	0.05	200,000	199,742	2021/9/24
第27回リコーリース	0.16	100,000	100,031	2022/7/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第30回リコーリース	0.16	200,000	200,134	2022/1/21
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	102,615	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,754	2021/6/18
第70回日立キャピタル	0.2	200,000	200,142	2022/12/20
第194回オリックス	0.19	400,000	399,812	2023/11/8
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	200,000	200,176	2023/11/27
第63回三菱UFJリース	0.19	100,000	99,866	2023/10/18
第65回三菱UFJリース	0.1	100,000	99,958	2022/2/25
第66回三菱UFJリース	0.21	300,000	300,132	2024/4/11
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	110,997	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	200,000	200,128	2022/8/10
第58回三井不動産	0.1	300,000	299,772	2023/2/24
第64回三井不動産	0.08	100,000	100,014	2022/4/14
第105回三菱地所	1.178	100,000	103,118	2022/3/23
第116回三菱地所	0.643	100,000	102,611	2024/9/19
第125回三菱地所	0.19	300,000	300,144	2025/3/14
第95回住友不動産	0.987	100,000	103,401	2024/1/26
第99回住友不動産	0.836	300,000	308,469	2024/7/29
第12回イオンモール	0.36	200,000	200,490	2023/7/3
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	102,402	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	102,492	2024/9/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000	101,007	2027/9/17
第38回京王電鉄	0.295	100,000	100,694	2027/11/29
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	106,523	2022/2/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	104,159	2022/12/20
第39回東日本旅客鉄道	2.05	500,000	558,815	2025/6/20
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	111,453	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	129,717	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	130,961	2022/3/25
第9回東海旅客鉄道	1.74	100,000	105,769	2022/9/20
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	104,015	2022/12/20
第34回東海旅客鉄道	2.3	200,000	236,230	2027/12/20
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	116,829	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	120,775	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	122,882	2045/3/6
第8回東京地下鉄	2.31	200,000	236,500	2027/12/20
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	102,933	2021/12/9
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	201,788	2028/9/13
第16回三菱倉庫	0.21	200,000	200,424	2024/12/6
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	101,496	2020/9/10
第8回関西高速鉄道	0.861	200,000	206,158	2023/8/30
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,358	2023/3/20
第21回KDDI	0.669	100,000	102,587	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,775	2023/9/20
第38回電源開発	0.978	100,000	103,288	2023/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第39回電源開発		0.929	100,000	103,079	2024/2/20
第40回電源開発		0.889	200,000	206,170	2024/6/20
第50回電源開発		0.415	200,000	200,278	2027/7/20
第57回電源開発		0.355	200,000	198,462	2028/7/20
第4回東京電力パワーグリッド		0.69	400,000	401,364	2024/6/20
第6回東京電力パワーグリッド		0.85	100,000	99,981	2027/8/31
第7回東京電力パワーグリッド		0.46	300,000	300,255	2022/10/24
第13回東京電力パワーグリッド		0.77	200,000	198,470	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド		0.89	200,000	197,742	2030/7/24
第23回東京ガス		1.01	200,000	207,804	2023/6/9
第13回広島ガス		0.405	200,000	201,048	2028/9/13
第6回SCSK		0.14	100,000	99,873	2022/7/21
第3回ファーストリテイリング		0.491	100,000	101,183	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	103,090	2025/12/18
第7回ファーストリテイリング		0.405	200,000	200,928	2028/6/6
第14回フランス相互信用連合銀行		0.563	300,000	302,517	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行		0.999	200,000	207,768	2025/10/15
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.217	300,000	298,539	2023/1/25
第1回韓国石油公社債		0.24	100,000	100,065	2022/1/21
第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク		2.45	200,000	211,156	2021/12/28
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	100,075	2020/1/16
第17回ナショナル・オーストラリア銀行		0.44	100,000	100,096	2024/1/23
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション		0.32	300,000	300,501	2023/7/6
小	計		28,573,000	29,238,091	
合	計		559,649,447	607,797,202	

先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 458	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 607,797,202	% 99.3
コール・ローン等、その他	4,499,513	0.7
投資信託財産総額	612,296,715	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	612,296,656,365
コール・ローン等	3,267,518,129
公社債(評価額)	607,797,202,127
未収利息	1,202,986,944
前払費用	27,729,165
差入委託証拠金	1,220,000
(B) 負債	3,466,306,522
未払金	3,228,231,040
未払解約金	238,072,516
未払利息	2,966
(C) 純資産総額(A-B)	608,830,349,843
元本	450,894,780,414
次期繰越損益金	157,935,569,429
(D) 受益権総口数	450,894,780,414口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,503円

<注記事項>

- ①期首元本額 409,751,145,196円
期中追加設定元本額 169,094,607,153円
期中一部解約元本額 127,950,971,935円
また、1口当たり純資産額は、期末1.3503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)

ファンド・マネジャー(国内債券)	109,979,356,450円
eMAXIS 国内債券インデックス	10,035,262,977円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,449,606,746円
eMAXIS バランス(波乗り型)	108,235,487円
コアバランス	2,083,543円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	160,406,340円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	100,595,546円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	45,856,226円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	2,994,002,597円
国内債券セレクション(ラップ向け)	3,725,663,704円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,119,148,139円
つみたて8資産均等バランス	716,195,228円
つみたて4資産均等バランス	190,943,956円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,724,968円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	630,852円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	56,204円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	20,478,724円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	9,901,610円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	5,921,660円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	1,979,112円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	11,417,340,983円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	9,405,543,450円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	926,997,122円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	2,504,187,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	7,535,376,951円

○損益の状況 (2018年5月15日~2019年5月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,899,494,952
受取利息	4,902,112,559
支払利息	△ 2,617,607
(B) 有価証券売買損益	4,919,444,412
売買益	7,030,554,959
売買損	△ 2,111,110,547
(C) 先物取引等取引損益	28,949,400
取引益	36,985,800
取引損	△ 8,036,400
(D) 保管費用等	△ 38,290
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	9,847,850,474
(F) 前期繰越損益金	134,522,690,775
(G) 追加信託差損益金	55,556,167,569
(H) 解約差損益金	△ 41,991,139,389
(I) 計(E+F+G+H)	157,935,569,429
次期繰越損益金(I)	157,935,569,429

(注) (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) (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) (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。

三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	253,372,348円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	301,316,439円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	69,526,253円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	278,251,142円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	393,451,163円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	245,000,807円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	481,003,850円
eMAXIS 最適化バランス (マイフoward)	57,585,505円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	11,391,742円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	100,799,834円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	12,107,304,829円
三菱UFJ バランスファンドVA20型 (適格機関投資家限定)	1,244,796,553円
三菱UFJ バランスファンドVA40型 (適格機関投資家限定)	5,220,566,008円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	192,957,635,262円
三菱UFJ バランスファンドVA50型 (適格機関投資家限定)	564,307,657円
三菱UFJ バランスファンドVA75型 (適格機関投資家限定)	8,521,197円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	25,940,137円
三菱UFJ バランスファンドVA45型 (適格機関投資家限定)	134,794,955円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	21,873,033円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,016,262,501円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	3,367,584,279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)	18,016,713,315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)	6,077,150,884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)	3,150,322,832円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	188,538,582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)	19,594,530,499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)	520,641,857円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,412,873,515円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	16,816,081円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	33,982,964円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	23,240,085円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	14,041,632円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	136,537,650円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	284,025,615円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	102,429,565円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	200,806,487円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,840,759,122円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	1,930,698,115円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	3,714,775,174円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,065,776,560円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,250,338,510円
合計	450,894,780,414円

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27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27日に第11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11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
7期(2016年1月26日)	12,613	△0.2	381.71	△0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	92,179
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
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

(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		F T S E 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) 2019年1月28日	円 12,706	% —	385.22	% —	98.0	—
1月末	12,728	0.2	385.88	0.2	97.9	—
2月末	12,714	0.1	385.50	0.1	100.1	—
3月末	12,951	1.9	392.62	1.9	98.2	—
4月末	12,862	1.2	389.98	1.2	98.1	—
5月末	13,049	2.7	395.72	2.7	95.1	—
6月末	13,260	4.4	401.98	4.4	97.4	—
7月末	13,318	4.8	403.79	4.8	96.9	—
8月末	13,732	8.1	416.34	8.1	95.7	—
9月末	13,633	7.3	413.28	7.3	99.7	—
10月末	13,465	6.0	408.17	6.0	100.5	—
11月末	13,456	5.9	407.93	5.9	98.6	—
12月末	13,373	5.2	405.42	5.2	99.4	—
(期 末) 2020年1月27日	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—

(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

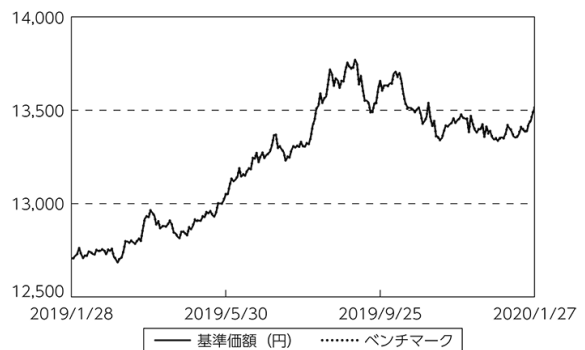
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.3%の上昇となりました。

◎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(6.4%)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

(上昇要因)

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上昇しました。

- ・ 先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では上昇しました。

● 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6.4%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 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)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

○ 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

(2019年1月29日～2020年1月27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)	1	0.011	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)	(1)	(0.010)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
	(0)	(0.000)	
合 計	1	0.011	
期中の平均基準価額は、13,234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

(2019年1月29日～2020年1月27日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 380,260	千アメリカドル 344,703
	カナダ	千カナダドル 15,458	千カナダドル 19,740
	メキシコ	千メキシコペソ 80,479	千メキシコペソ 69,848
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 30,332	32,109
	イタリア	国債証券 44,205	44,608
	フランス	国債証券 50,975	49,330
	オランダ	国債証券 7,401	9,410
	スペイン	国債証券 33,256	32,399
	ベルギー	国債証券 10,745	11,449
	オーストリア	国債証券 7,793	8,367
	フィンランド	国債証券 1,503	2,917
	アイルランド	国債証券 2,635	5,198
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 31,092	千イギリスポンド 35,730
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 3,007	千スウェーデンクローネ 13,315
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 5,115	千ノルウェークローネ 1,550
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 11,635	千デンマーククローネ 14,614
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 7,868	千ポーランドズロチ 9,495
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 10,748	千オーストラリアドル 12,782
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 7,355	千シンガポールドル 3,732	
南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 36,276	千南アフリカランド 22,060	

(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

(2019年1月29日～2020年1月27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	2,814,608	690,127	24.5	2,822,336	683,467	24.2
為替直物取引	52,690	12,879	24.4	56,324	22,555	40.0

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

(2020年1月27日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 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	千アメリカドル 977,180	千アメリカドル 1,037,803	千円 113,182,842	% 47.6	% —	% 21.2	% 18.1	% 8.3
カナダ	千カナダドル 45,450	千カナダドル 51,746	4,291,864	1.8	—	0.9	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 323,300	千メキシコペソ 343,256	1,987,456	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	97,630	119,529	14,379,388	6.0	—	3.7	1.5	0.9
イタリア	144,940	171,164	20,591,118	8.7	—	5.2	2.4	1.0
フランス	154,340	189,675	22,817,966	9.6	—	6.6	2.1	0.9
オランダ	29,230	35,835	4,311,013	1.8	—	1.2	0.5	0.2
スペイン	87,450	109,300	13,148,827	5.5	—	3.8	1.4	0.4
ベルギー	35,930	45,378	5,459,042	2.3	—	1.7	0.5	0.1
オーストリア	21,530	26,886	3,234,424	1.4	—	0.9	0.3	0.1
フィンランド	9,240	10,373	1,247,938	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	9,890	11,777	1,416,839	0.6	—	0.5	0.1	—
イギリス	千イギリスポンド 81,400	千イギリスポンド 109,057	15,541,775	6.5	—	5.1	1.2	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 52,400	千スウェーデンクローネ 59,551	678,888	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 42,350	千ノルウェークローネ 43,846	528,350	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 54,950	千デンマーククローネ 71,917	1,157,864	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 44,150	千ポーランドズロチ 46,158	1,304,905	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 52,750	千オーストラリアドル 61,414	4,563,092	1.9	—	1.4	0.3	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 17,170	千シンガポールドル 18,616	1,500,529	0.6	—	0.4	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 196,350	千南アフリカランド 179,238	1,355,045	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	232,699,174	97.8	—	54.7	30.0	13.1

(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 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	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,085	336,488	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,907	1,734,871	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,583	281,761	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,782	303,411	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	695	75,852	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	5,400	5,381	586,853	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	3,086	336,580	2021/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,597	174,182	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	7,000	6,986	761,928	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,494	272,010	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	8,000	7,980	870,332	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,087	445,783	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	3,700	3,687	402,197	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	6,975	760,795	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	800	87,268	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 220815	1.5	5,500	5,504	600,368	2022/8/15
	1.5 T-NOTE 220915	1.5	14,000	14,012	1,528,211	2022/9/15
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	10,000	10,012	1,091,963	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,707	731,501	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	5,999	654,308	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,300	8,255	900,389	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,436	920,076	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	6,350	6,377	695,533	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,888	860,267	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,925	537,149	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,736	734,698	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	8,800	8,824	962,427	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,226	1,006,252	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,900	3,908	426,264	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	5,000	5,009	546,322	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,500	2,504	273,139	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	4,400	4,379	477,652	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,703	185,756	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	6,600	6,629	723,057	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,822	1,398,445	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,408	153,602	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,119	340,225	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	9,200	9,258	1,009,701	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,824	417,082	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220715	1.75	4,000	4,027	439,188	2022/7/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	4,900	4,937	538,485	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,400	2,421	264,095	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,700	2,718	296,497	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	2,015	219,755	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	12,500	12,599	1,374,113	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220430	1.875	12,000	12,105	1,320,273	2022/4/30

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	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	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,734	407,305	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,788	413,128	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,369	694,646	2022/10/31
	2 T-NOTE 210228	2.0	4,800	4,822	525,941	2021/2/28
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,007	109,916	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	3,800	3,832	418,021	2021/10/31
	2 T-NOTE 211231	2.0	10,000	10,095	1,100,994	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	8,900	8,994	980,984	2022/2/15
	2 T-NOTE 221130	2.0	10,700	10,859	1,184,354	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	8,900	9,043	986,330	2023/2/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,550	278,166	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	12,000	12,255	1,336,530	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	7,000	7,166	781,610	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	12,300	12,592	1,373,297	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	7,300	7,490	816,912	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	704	76,783	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	6,400	6,456	704,118	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,010	110,176	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,743	408,313	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,450	703,514	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,885	860,034	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,700	2,766	301,754	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,600	4,717	514,531	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	6,300	6,481	706,885	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	10,650	10,967	1,196,061	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,550	2,606	284,229	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,814	197,910	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	6,100	6,153	671,061	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	707	77,171	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,057	987,845	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,273	466,106	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	9,400	9,721	1,060,243	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	10,300	10,653	1,161,844	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	4,100	4,244	462,865	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	7,000	7,266	792,465	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	9,500	9,882	1,077,836	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,500	6,795	741,066	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	5,000	5,230	570,434	2027/11/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	4,350	4,586	500,170	2049/11/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	705	76,911	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 210315	2.375	14,000	14,129	1,540,975	2021/3/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	10,000	10,350	1,128,771	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,555	1,042,075	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	9,800	10,322	1,125,817	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	5,397	588,703	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	5,100	5,468	596,357	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	5,631	614,165	2046/5/15

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	
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 230815	2.5	14,550	15,069	1,643,477	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,481	1,034,004	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,000	2,095	228,548	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 210515	2.625	15,500	15,714	1,713,871	2021/5/15
	2.625 T-NOTE 210615	2.625	3,000	3,044	332,049	2021/6/15
	2.625 T-NOTE 211215	2.625	9,000	9,188	1,002,052	2021/12/15
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,814	634,163	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	11,900	12,553	1,369,092	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	9,509	1,037,106	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	6,150	6,863	748,480	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,000	2,232	243,467	2042/11/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	6,600	7,456	813,200	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 210815	2.75	18,000	18,336	1,999,811	2021/8/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	13,500	14,060	1,533,387	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,211	1,004,640	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	15,000	15,745	1,717,183	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	11,500	12,220	1,332,772	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,000	5,323	580,574	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	11,000	11,919	1,299,944	2028/2/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	6,100	6,986	761,937	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	6,600	7,604	829,396	2046/11/15
	2.875 T-NOTE 211015	2.875	11,500	11,764	1,283,046	2021/10/15
	2.875 T-NOTE 211115	2.875	8,000	8,193	893,576	2021/11/15
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	8,930	974,012	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	13,400	14,313	1,561,076	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	6,000	6,420	700,165	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	13,700	15,008	1,636,880	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,200	6,805	742,257	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,978	652,050	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	8,450	9,854	1,074,765	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	6,000	7,011	764,629	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,450	4,042	440,837	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,250	3,836	418,411	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,700	6,745	735,674	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	6,640	724,247	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	6,100	7,255	791,250	2049/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,500	2,959	322,770	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	4,300	5,091	555,238	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	4,265	465,219	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	6,600	7,851	856,332	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,800	4,603	502,105	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,326	144,641	2021/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	15,900	17,805	1,941,869	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	14,200	17,563	1,915,488	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	7,623	831,395	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	2,000	2,494	272,070	2039/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	3,000	3,839	418,764	2043/8/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	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					
	3.625 T-BOND 440215	3.625	5,700	7,311	797,401	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,200	2,246	245,039	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,293	141,104	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	6,600	8,614	939,446	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	1,050	114,526	2040/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	1,102	120,211	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	940	1,295	141,288	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,000	2,786	303,936	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,863	312,268	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,542	168,214	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	3,260	4,457	486,083	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,300	1,818	198,323	2038/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,400	2,011	219,399	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,494	272,033	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,050	1,535	167,430	2037/5/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,580	2,164	236,071	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,516	274,439	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	13,850	18,456	2,012,833	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	3,000	3,494	381,151	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,300	1,862	203,108	2030/5/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,449	158,110	2021/11/15
小計					113,182,842	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券					
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,175	97,522	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	5,900	5,846	484,917	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	148	12,291	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,800	1,778	147,546	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,460	121,118	2027/6/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,256	270,091	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,150	3,174	263,264	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	1,000	1,009	83,722	2023/3/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,573	130,539	2028/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	500	565	46,885	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 240301	2.25	1,200	1,241	102,964	2024/3/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	4,700	4,920	408,073	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	3,000	3,087	256,075	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,750	2,261	187,541	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	1,133	94,022	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,100	3,169	262,878	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,950	2,779	230,521	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,850	2,690	223,115	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,450	2,229	184,941	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	2,350	3,241	268,851	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,800	2,743	227,540	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,259	187,437	2027/6/1
小計					4,291,864	

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		
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 241205	10.0	34,750	39,481	228,600	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	11,682	67,643	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	20,305	117,569	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	29,150	29,064	168,283	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	34,850	201,782	2022/6/9	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	10,000	10,103	58,496	2021/12/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	45,750	47,685	276,100	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	19,300	20,656	119,598	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	11,637	67,382	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	25,897	149,948	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	21,500	22,425	129,845	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	15,764	91,278	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	15,000	16,666	96,498	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	14,400	16,084	93,127	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	18,200	20,950	121,300	2038/11/18	
	小 計					1,987,456		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	4,550	4,707	566,333	2026/8/15
			0 BUND 500815	—	550	519	62,494	2050/8/15
			0 OBL 210409	—	2,800	2,820	339,289	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	3,500	3,536	425,465	2021/10/8
			0 OBL 220408	—	800	811	97,583	2022/4/8
			0 OBL 231013	—	1,500	1,535	184,682	2023/10/13
			0 SCHATS 211210	—	5,000	5,057	608,473	2021/12/10
			0.25 BUND 270215	0.25	3,600	3,793	456,403	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	4,000	4,237	509,755	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	2,350	2,491	299,704	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	3,050	3,219	387,277	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	1,800	1,915	230,444	2026/2/15
			0.5 BUND 280215	0.5	3,300	3,558	428,127	2028/2/15
			1 BUND 240815	1.0	1,600	1,718	206,720	2024/8/15
			1 BUND 250815	1.0	2,700	2,938	353,458	2025/8/15
			1.25 BUND 480815	1.25	1,300	1,696	204,138	2048/8/15
			1.5 BUND 220904	1.5	2,800	2,956	355,726	2022/9/4
			1.5 BUND 230215	1.5	6,800	7,249	872,096	2023/2/15
			1.5 BUND 230515	1.5	3,700	3,963	476,828	2023/5/15
			1.5 BUND 240515	1.5	2,900	3,167	380,998	2024/5/15
			1.75 BUND 220704	1.75	2,750	2,910	350,165	2022/7/4
			1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,139	257,404	2024/2/15
			2 BUND 220104	2.0	3,400	3,575	430,181	2022/1/4
			2 BUND 230815	2.0	1,600	1,751	210,675	2023/8/15
			2.25 BUND 210904	2.25	250	261	31,462	2021/9/4
			2.5 BUND 440704	2.5	2,900	4,596	552,943	2044/7/4
			2.5 BUND 460815	2.5	2,600	4,213	506,921	2046/8/15
			3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,900	228,589	2021/7/4
			3.25 BUND 420704	3.25	2,500	4,296	516,888	2042/7/4
			4 BUND 370104	4.0	2,300	3,911	470,560	2037/1/4

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	4.25 BUND 390704	4.25	1,900	3,491	420,085	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	3,036	365,344	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,670	4,607	554,273	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,510	4,965	597,324	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,700	2,805	337,447	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	2,200	3,283	395,039	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,273	153,238	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	1,250	2,089	251,422	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,650	2,522	303,416	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	3,500	3,510	422,294	2021/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	402	48,469	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,000	988	118,886	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,950	1,966	236,523	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	1,200	1,217	146,412	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,500	2,558	307,728	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,337	160,892	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	4,850	4,990	600,373	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	450	466	56,060	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,879	226,120	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,580	1,651	198,680	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,100	2,209	265,802	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,750	1,801	216,755	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,000	1,059	127,503	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	3,450	3,705	445,760	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	4,050	4,373	526,167	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,850	1,999	240,509	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	2,600	2,707	325,750	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	3,550	3,873	466,004	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	750	805	96,846	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,150	2,387	287,264	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,000	3,280	394,601	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	3,200	3,523	423,844	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,700	2,988	359,562	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	3,800	4,354	523,881	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,300	1,413	170,100	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	3,700	4,306	518,129	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,551	306,964	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	500	609	73,340	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,800	2,261	271,998	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,000	3,647	438,839	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	3,950	4,145	498,731	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,300	2,434	292,871	2021/8/1
3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,408	289,762	2024/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,150	4,149	499,239	2037/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	2,959	355,969	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,379	406,611	2024/3/1		
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	4,400	4,739	570,196	2021/9/1		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,430	3,966	477,158	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,174	141,233	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	3,678	442,517	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,033	485,277	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	6,600	8,059	969,531	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	4,152	499,586	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,540	3,788	455,707	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,500	5,226	628,691	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,600	6,320	760,320	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	3,800	4,333	521,377	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	5,300	6,081	731,649	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,450	3,668	441,375	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,820	5,680	683,372	2031/5/1
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	4,050	5,726	688,904	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	994	119,645	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,950	5,231	629,314	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 210225	—	7,900	7,949	956,311	2021/2/25
		0 O.A.T 210525	—	4,800	4,837	581,906	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	4,100	4,155	499,933	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	—	2,900	2,951	355,086	2023/3/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	4,700	4,878	586,843	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	4,100	4,304	517,851	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	5,300	5,582	671,583	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	5,600	5,924	712,764	2029/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	3,350	3,617	435,164	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	4,250	4,594	552,764	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	2,000	2,161	260,080	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	3,700	4,046	486,791	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	5,410	6,214	747,630	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	6,850	8,000	962,478	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	1,820	2,192	263,765	2050/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	4,900	5,278	635,059	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	4,400	4,874	586,442	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	1,020	1,272	153,129	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,480	1,963	236,180	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	2,800	3,749	451,028	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	4,600	4,959	596,587	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	7,350	8,234	990,658	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	6,150	7,779	935,930	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,100	3,830	460,799	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,243	390,144	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	4,050	4,322	520,008	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	3,120	5,058	608,555	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	3,200	3,979	478,714	2026/4/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,200	1,264	152,172	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,900	4,807	578,348	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	2,170	4,307	518,208	2055/4/25

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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
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 600425	4.0	1,700	3,537	425,570	2060/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	4,700	5,552	667,922	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	4,100	7,447	895,937	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	3,350	5,628	677,072	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	5,100	7,794	937,651	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	4,100	7,062	849,642	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	7,420	10,171	1,223,616	2025/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	1,650	2,141	257,624	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	900	910	109,551	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,403	168,889	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,000	2,120	255,098	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	950	1,017	122,460	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,600	2,817	338,892	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,150	2,345	282,190	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	2,350	2,542	305,898	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,200	2,451	294,916	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	2,550	2,732	328,709	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,500	2,007	241,482	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,600	2,681	322,624	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,378	286,093	2021/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,350	1,526	183,636	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,780	3,185	383,182	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,800	3,008	361,881	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,500	2,208	265,648	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	497	59,858	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	800	816	98,250	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	3,150	3,204	385,530	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,500	1,532	184,359	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	4,400	4,478	538,802	2021/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	2,850	3,086	371,280	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,400	1,536	184,797	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,450	4,888	588,144	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	4,200	4,634	557,547	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,450	3,793	456,335	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,350	2,558	307,744	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	2,500	2,800	336,919	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,900	2,200	264,691	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,300	3,713	446,782	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,600	3,177	382,206	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	3,000	3,413	410,671	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,740	2,412	290,253	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,300	2,109	253,766	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,650	1,929	232,129	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	3,170	4,888	588,036	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	4,000	4,697	565,121	2023/10/31
4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,064	248,322	2025/7/30		
4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,650	4,542	546,424	2041/7/30		

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							
スペイン	国債証券	4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,882	346,722	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,950	5,117	615,584	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,984	479,323	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,200	4,118	495,479	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	4,450	5,214	627,260	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,600	3,868	465,323	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,700	4,414	531,013	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,750	3,095	372,372	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,500	3,448	414,833	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,100	4,678	562,797	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	1,900	1,950	234,703	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,879	226,123	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,767	332,899	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,454	174,932	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,900	3,137	377,486	2028/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	976	117,435	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,330	160,006	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	850	973	117,141	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	294	35,432	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,600	1,974	237,553	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,200	1,512	181,942	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	930	1,367	164,565	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,644	197,794	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	600	870	104,737	2057/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,119	134,665	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	550	957	115,186	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,500	1,650	198,565	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,080	1,596	192,064	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	2,100	2,270	273,162	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,033	244,654	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,450	4,289	515,976	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,275	153,500	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,390	4,079	490,785	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,700	3,971	477,726	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	1,400	1,426	171,629	2023/7/15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,400	1,481	178,220	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	850	901	108,410	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	950	1,019	122,638	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	650	701	84,445	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	2,100	2,294	276,013	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	750	950	114,323	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	337	40,550	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,100	1,211	145,773	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	950	1,031	124,148	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	480	843	101,494	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	900	1,191	143,354	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	850	1,403	168,846	2044/6/20

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	
オーストリア	国債証券	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,707	205,453	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	2,950	3,231	388,804	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,420	170,899	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,950	3,251	391,145	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,059	127,438	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	950	1,420	170,834	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	506	60,941	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	662	79,738	2023/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	737	88,684	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	500	529	63,645	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	200	212	25,525	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	750	816	98,169	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	1,100	1,179	141,852	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	650	743	89,502	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	350	439	52,915	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	586	70,593	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	582	70,045	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	1,050	1,162	139,811	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	550	830	99,950	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	676	81,410	2028/7/4
3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	210	25,266	2021/4/15		
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	497	59,884	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	700	761	91,587	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	950	1,026	123,518	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	950	1,054	126,819	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,000	1,143	137,621	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	600	721	86,840	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	650	790	95,119	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,326	159,583	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,190	1,484	178,642	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	869	104,647	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	911	109,608	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,300	1,686	202,850	2025/3/13
小 計					86,606,558		
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	3,380	3,391	483,285	2022/7/22	
	0.75 GILT 230722	0.75	2,650	2,683	382,459	2023/7/22	
	1 GILT 240422	1.0	1,200	1,230	175,421	2024/4/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	5,380	5,702	812,643	2027/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,100	1,111	158,334	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	3,150	3,373	480,699	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	2,600	2,870	409,069	2047/7/22	
	1.625 GILT 281022	1.625	1,950	2,139	304,950	2028/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	1,420	1,825	260,085	2071/10/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	4,950	5,128	730,841	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	2,270	2,560	364,836	2037/9/7	
	1.75 GILT 490122	1.75	700	819	116,803	2049/1/22	

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					
		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		
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	1.75 GILT 570722	1.75	2,170	2,704	385,475	2057/7/22
		2.25 GILT 230907	2.25	3,650	3,894	555,064	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,480	2,325	331,447	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,300	1,440	205,256	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	4,200	6,144	875,611	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,350	3,606	513,895	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	2,040	4,049	577,126	2068/7/22
		3.75 GILT 210907	3.75	1,650	1,738	247,710	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,240	2,178	310,451	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	1,650	1,775	253,027	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	1,900	3,820	544,398	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	850	1,100	156,853	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,000	2,840	404,858	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,550	3,840	547,335	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	2,000	3,167	451,455	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	890	1,431	204,063	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,900	3,314	472,343	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	800	1,454	207,305	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	3,660	7,263	1,035,114	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,300	1,961	279,533	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,350	4,007	571,119	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,800	2,588	368,865	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,550	2,569	366,194	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,750	3,391	483,253	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,920	2,839	404,588	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	700	771	109,996	2021/6/7
小	計					15,541,775	
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	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	5,600	5,975	68,119	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,500	4,802	54,746	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,623	75,509	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,597	143,605	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	8,239	93,935	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	11,550	12,588	143,513	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,600	8,724	99,458	2039/3/30
小	計					678,888	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,887	34,798	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	4,800	4,916	59,238	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,380	52,788	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,000	3,110	37,476	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,417	89,385	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	5,050	5,318	64,093	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,950	5,290	63,754	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	10,200	10,523	126,813	2021/5/25
小	計					528,350	

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	
デンマーク			%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,700	11,508	185,280	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,000	4,327	69,664	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,757	140,993	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,600	8,623	138,834	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,291	165,686	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	14,900	28,410	457,404	2039/11/15
小	計					1,157,864	
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	1.75 POLAND 210725	1.75	5,750	5,771	163,146	2021/7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	5,400	5,477	154,860	2022/4/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	800	817	23,123	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	6,000	6,159	174,129	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,577	101,144	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	4,500	4,589	129,736	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,838	108,505	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	1,000	1,043	29,509	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,774	106,707	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,479	126,630	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,900	2,037	57,592	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,763	78,118	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,828	51,700	2029/4/25
小	計					1,304,905	
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	2 AUST GOVT 211221	2.0	2,450	2,507	186,285	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	800	833	61,956	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	3,300	3,619	268,892	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,000	3,407	253,185	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,595	192,866	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,996	222,667	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	3,050	3,482	258,756	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,950	3,405	253,039	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,000	1,201	89,253	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,900	2,440	181,332	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	4,550	5,109	379,627	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	3,500	4,166	309,605	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,166	86,644	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,750	2,380	176,859	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,250	3,907	290,332	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,400	3,372	250,602	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,500	4,423	328,665	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,993	222,442	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	3,900	4,148	308,220	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,255	241,856	2022/7/15
小	計					4,563,092	
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 SINGAPOREGOVT 211001	1.25	150	149	12,060	2021/10/1
		1.75 SINGAPOREGOVT 220401	1.75	650	654	52,784	2022/4/1

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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	570	45,992	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOV 210601	2.25	1,150	1,162	93,736	2021/6/1
		2.25 SINGAPORGOV 360801	2.25	1,150	1,217	98,098	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	1,000	1,046	84,365	2025/6/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	1,000	1,080	87,055	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOV 230701	2.75	1,400	1,462	117,873	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOV 420401	2.75	1,150	1,313	105,903	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOV 460301	2.75	650	744	59,972	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	498	40,150	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	800	890	71,807	2030/9/1
		3 SINGAPORGOV 240901	3.0	2,650	2,832	228,289	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOV 220901	3.125	1,200	1,252	100,961	2022/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	1,600	1,907	153,777	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOV 270301	3.5	1,620	1,832	147,699	2027/3/1
小		計				1,500,529	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	28,400	31,938	241,452	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,357	25,385	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	17,900	12,442	94,065	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,800	5,813	43,948	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	18,000	15,275	115,483	2031/2/28
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,200	8,404	63,535	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	15,200	14,193	107,304	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,800	7,150	54,056	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	20,250	17,848	134,932	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	11,100	9,714	73,443	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	23,200	20,228	152,924	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	15,600	14,502	109,638	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	20,200	18,369	138,874	2040/1/31
小		計				1,355,045	
合		計				232,699,174	

(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

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 232,699,174	% 97.7
コール・ローン等、その他	5,432,700	2.3
投資信託財産総額	238,131,874	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (234,687,280千円) の投資信託財産総額 (238,131,874千円) に対する比率は98.6%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=109.06円	1 カナダドル=82.94円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ユーロ=120.30円
1 イギリスポンド=142.51円	1 スウェーデンクローネ=11.40円	1 ノルウェークローネ=12.05円	1 デンマーククローネ=16.10円
1 ポーランドズロチ=28.27円	1 オーストラリアドル=74.30円	1 シンガポールドル=80.60円	1 南アフリカランド=7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	469,686,945,334
コール・ローン等	1,758,041,455
公社債(評価額)	232,699,174,814
未収入金	233,322,496,240
未収利息	1,842,332,451
前払費用	64,900,374
(B) 負債	231,839,535,253
未払金	231,837,921,263
未払解約金	1,613,367
未払利息	623
(C) 純資産総額(A-B)	237,847,410,081
元本	176,023,402,374
次期繰越損益金	61,824,007,707
(D) 受益権総口数	176,023,402,374口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,512円

<注記事項>

- ①期首元本額 178,385,096,188円
 期中追加設定元本額 37,696,590,522円
 期中一部解約元本額 40,058,284,336円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,512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)	105,594,306,529円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	11,256,999,335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)	10,143,150,689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)	9,260,836,149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)	7,563,319,070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)	6,557,849,487円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,729,500,636円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,520,168,461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)	3,940,734,688円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	3,286,827,948円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,152,392,978円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,590,562,187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)	1,250,760,089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)	1,079,737,354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)	551,522,821円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	171,262,988円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	134,194,556円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	89,342,059円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	76,119,162円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	73,815,188円
合計	176,023,402,374円

○損益の状況 (2019年1月29日~2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,536,844,307
受取利息	5,538,406,134
支払利息	△ 1,561,827
(B) 有価証券売買損益	8,802,018,090
売買益	35,628,164,545
売買損	△26,826,146,455
(C) 保管費用等	△ 25,045,357
(D) 当期損益金(A+B+C)	14,313,817,040
(E) 前期繰越損益金	48,272,350,615
(F) 追加信託差損益金	11,747,061,443
(G) 解約差損益金	△12,509,221,391
(H) 計(D+E+F+G)	61,824,007,707
次期繰越損益金(H)	61,824,007,707

- (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。