

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

※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 先進国債券 インデックス（為替ヘッジあり）

第1期（決算日：2017年1月26日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、去る1月26日に第1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

URL:<http://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**

(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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

## 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)	基準価額			シティ世界国債インデックス (為替ヘッジあり)		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税金分配	み入金	期騰落	中率	騰落			
(設定日)	円	円	円	%		%	%	%	百万円
2016年7月1日	10,000	—	—	—	396.92	—	—	—	1
1期(2017年1月26日)	9,522	0	△4.8	△4.8	378.81	△4.6	96.8	—	22

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）とは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。

(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	基準価額		シティ世界国債インデックス (為替ヘッジあり)		債組入比率	債券先物比率
		騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(設定日)	円		%		%	%	%
2016年7月1日	10,000	—	—	396.92	—	—	—
7月末	10,040		0.4	398.69	0.4	97.5	—
8月末	10,054		0.5	399.55	0.7	97.0	—
9月末	10,033		0.3	398.82	0.5	95.6	—
10月末	9,822		△1.8	390.37	△1.7	95.4	—
11月末	9,638		△3.6	382.83	△3.6	96.3	—
12月末	9,636		△3.6	383.04	△3.5	97.7	—
(期末)							
2017年1月26日	9,522		△4.8	378.81	△4.6	96.8	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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。

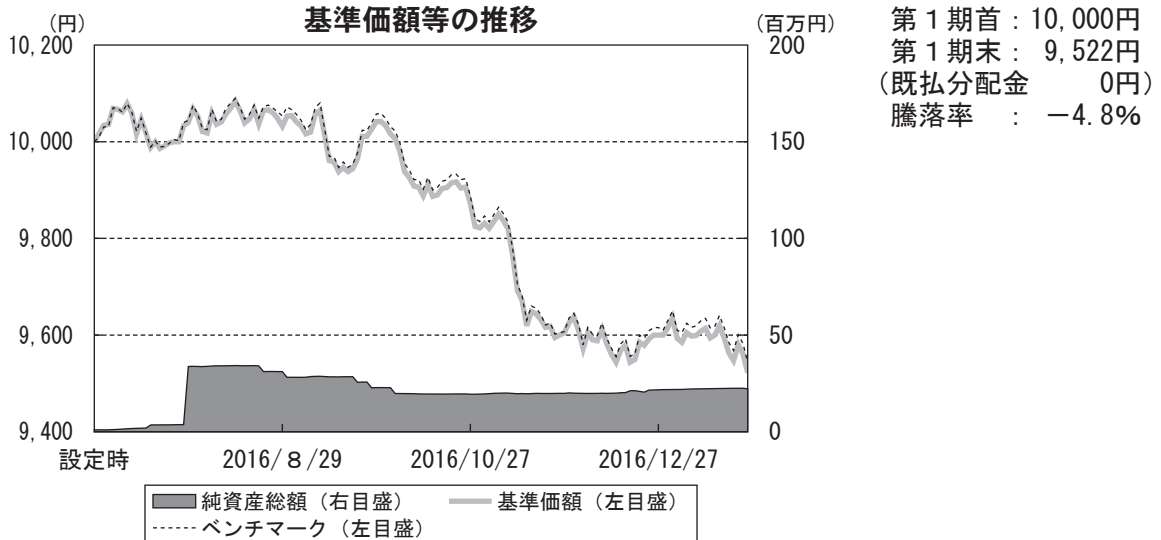
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

### 当期中の基準価額等の推移について

(第1期：2016/7/1～2017/1/26)

基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ4.8%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−4.6%)を0.2%下回りました。



### 基準価額の主な変動要因

下落要因	米連邦準備制度理事会 (FRB) の利上げに対する期待が高まったことや米大統領選の結果を背景に、先進国の債券市況が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。
------	---

投資環境について

（第1期：2016/7/1～2017/1/26）

◎債券市況

- ・FRBの利上げに対する期待が高まったことや、米大統領選の結果を受けて、米国を中心に主要先進国の金利が上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

- ・マザーファンドを主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。

< ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド >

基準価額は設定時に比べ4.6%の下落となりました。

- ・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シティ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。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期末（2017年1月26日）

最終利回り	1.4%
直接利回り	2.4%
デュレーション	6.7年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

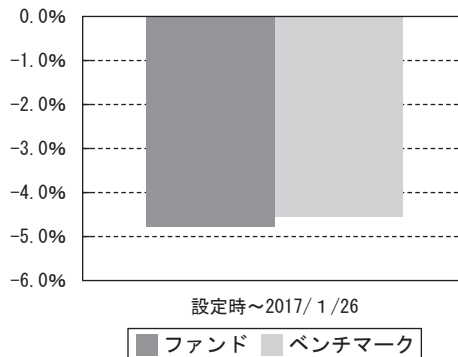
< e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >  
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎マザーファンド保有以外の要因  
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。
- ◎マザーファンド保有による要因  
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と  
ベンチマークの対比（騰落率）



<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは4.6%の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎ポートフォリオ要因  
ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。
  - ・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。
- ◎管理コスト等要因  
管理コスト等による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。
  - ・為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。  
為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
- ◎評価時価差異に基づく要因  
評価時価差異による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
  - ・為替の効果および債券の効果による要因です。  
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。  
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

## 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1期
	2016年7月1日～2017年1月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	121

(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

＜eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を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に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜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。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年7月1日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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 )	(14)	(0.145)	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 )	(14)	(0.145)	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 )	( 3 )	(0.032)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.011	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	( 1 )	(0.009)	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 )	(0.002)	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	33	0.333	
期中の平均基準価額は、9,870円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年7月1日～2017年1月26日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 32,065	千円 41,896	千口 14,340	千円 18,720

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年7月1日～2017年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

&lt; eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

該当事項はございません。

&lt;ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	649,940	248,862	38.3	654,082	255,486	39.1
為替直物取引	22,635	16,594	73.3	16,719	8,371	50.1

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。

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		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		17,724	22,172

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。



## ○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 22,172	% 98.5
コール・ローン等、その他	329	1.5
投資信託財産総額	22,501	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（90,456,093千円）の投資信託財産総額（92,232,535千円）に対する比率は98.1%です。

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

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,501,233
コール・ローン等	129,050
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	22,172,183
未収入金	200,000
(B) 負債	295,367
未払解約金	216,716
未払信託報酬	78,222
その他未払費用	429
(C) 純資産総額(A-B)	22,205,866
元本	23,321,025
次期繰越損益金	△ 1,115,159
(D) 受益権総口数	23,321,025口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,522円

## &lt;注記事項&gt;

- ①設定元本額 1,000,000円  
 期中追加設定元本額 39,587,710円  
 期中一部解約元本額 17,266,685円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9522円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,115,159円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2016年7月1日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	213,344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	70,075円
分配準備積立金額	-円
当ファンドの分配対象収益額	283,419円
1万口当たり収益分配対象額	121円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

## ○損益の状況（2016年7月1日～2017年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 70
支払利息	△ 70
(B) 有価証券売買損益	△ 895,263
売買益	86,870
売買損	△ 982,133
(C) 信託報酬等	△ 78,651
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 973,984
(E) 追加信託差損益金	△ 141,175
(配当等相当額)	(△ 9)
(売買損益相当額)	(△ 141,166)
(F) 計(D+E)	△ 1,115,159
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 1,115,159
追加信託差損益金	△ 141,175
(配当等相当額)	( 70,075)
(売買損益相当額)	(△ 211,250)
分配準備積立金	213,344
繰越損益金	△ 1,187,328

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

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。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 (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

### 《第8期》決算日2017年1月26日

[計算期間：2016年1月27日～2017年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第8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8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、シティ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		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2013年1月28日)	11,375	4.5	343.56	4.6	103.8	—	22,835
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
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

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）とは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。

(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		シティ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	券 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	%			
(期 首) 2016年1月26日	12,613	—	381.71	—	95.6	—	—
1月末	12,655	0.3	382.97	0.3	98.1	—	—
2月末	12,795	1.4	387.13	1.4	92.4	—	—
3月末	12,830	1.7	388.21	1.7	107.4	—	—
4月末	12,736	1.0	385.50	1.0	96.1	—	—
5月末	12,820	1.6	388.38	1.7	99.6	—	—
6月末	13,114	4.0	396.92	4.0	91.2	—	—
7月末	13,170	4.4	398.69	4.4	99.9	—	—
8月末	13,197	4.6	399.55	4.7	98.3	—	—
9月末	13,176	4.5	398.82	4.5	96.9	—	—
10月末	12,894	2.2	390.37	2.3	100.9	—	—
11月末	12,650	0.3	382.83	0.3	103.3	—	—
12月末	12,654	0.3	383.04	0.3	101.0	—	—
(期 末) 2017年1月26日	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	—

(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0.8%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.8%)と同程度となりました。

## 基準価額の推移



(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

## ◎外国債券市況

- ・世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

## ●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シティ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0.8%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.0$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト 等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

## ◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・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。

## ◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は0.1%程度でした。

- ・為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

## ◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

## ○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・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

(2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(2)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( そ の 他 )	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、12,890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

(2016年1月27日～2017年1月26日)

## 公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	千アメリカドル 279,435	千アメリカドル 120,266	
	カナダ	千カナダドル 17,490	千カナダドル 6,868	
	メキシコ	千メキシコペソ 99,071	千メキシコペソ 38,380	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券 40,312	17,258	
	イタリア	国債証券 50,523	18,223	
	フランス	国債証券 53,619	19,926	
	オランダ	国債証券 11,808	5,021	
	スペイン	国債証券 30,025	12,180	
	ベルギー	国債証券 13,012	4,852	
	オーストリア	国債証券 7,420	2,579	
	フィンランド	国債証券 3,449	1,488	
	アイルランド	国債証券 3,540	998	
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 32,091	千イギリスポンド 13,508	
	スイス	国債証券 千スイスフラン 1,124	千スイスフラン 446	
	国	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 22,854	千スウェーデンクローネ 8,388
		ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 12,841	千ノルウェークローネ 5,278
デンマーク		国債証券 千デンマーククローネ 25,466	千デンマーククローネ 8,974	
ポーランド		国債証券 千ポーランドズロチ 15,461	千ポーランドズロチ 5,272	
オーストラリア		国債証券 千オーストラリアドル 16,817	千オーストラリアドル 5,369	
シンガポール		国債証券 千シンガポールドル 5,380	千シンガポールドル 2,233	
南アフリカ		国債証券 千南アフリカランド 38,085	千南アフリカランド 11,938	

(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

(2016年1月27日～2017年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

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	$\frac{D}{C}$	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	983,021	474,947	48.3	1,020,009	511,226	50.1
為替直物取引	57,076	39,514	69.2	20,030	10,168	50.8

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東京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

(2017年1月26日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 348,590	千アメリカドル 349,914	千円 39,592,791	% 43.0	% —	% 17.5	% 16.9	% 8.6
カナダ	千カナダドル 20,640	千カナダドル 22,414	1,942,427	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 125,700	千メキシコペソ 126,598	679,832	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	45,850	54,088	6,585,842	7.1	—	3.9	2.3	0.9
イタリア	61,520	70,105	8,535,986	9.3	—	5.5	3.1	0.7
フランス	61,350	71,986	8,765,105	9.5	—	5.9	2.7	0.9
オランダ	14,650	17,187	2,092,732	2.3	—	1.3	0.5	0.4
スペイン	34,660	40,530	4,934,985	5.4	—	3.3	1.6	0.5
ベルギー	15,210	18,331	2,232,030	2.4	—	1.8	0.4	0.2
オーストリア	9,490	11,268	1,372,087	1.5	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	4,000	4,490	546,721	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	4,950	5,671	690,600	0.7	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 36,550	千イギリスポンド 45,180	6,460,380	7.0	—	5.0	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 1,550	千スイスフラン 1,842	208,924	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 28,300	千スウェーデンクローネ 32,542	418,172	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 17,080	千ノルウェークローネ 18,230	248,663	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 28,100	千デンマーククローネ 35,298	577,843	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 19,210	千ポーランドズロチ 19,546	546,918	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 20,610	千オーストラリアドル 22,190	1,903,293	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,410	千シンガポールドル 6,637	532,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 62,100	千南アフリカランド 57,568	492,212	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	89,359,623	96.9	—	50.5	32.6	13.9

(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 評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,390	270,435	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	2,500	2,486	281,339	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,300	1,298	146,962	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	1,500	1,498	169,559	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,100	2,096	237,243	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,996	225,849	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	600	598	67,728	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	300	299	33,858	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	700	696	78,843	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	400	397	44,936	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,781	201,561	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,083	122,563	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	3,700	3,640	411,868	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	500	500	56,603	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	3,400	3,395	384,153	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	101,608	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,200	2,189	247,792	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,088	123,137	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	494	55,931	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	55,854	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,675	189,612	2019/9/15
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	113,309	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,700	2,702	305,803	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	3,800	3,800	430,053	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	135,780	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	1,700	1,698	192,152	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,896	214,573	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,200	1,192	134,947	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	396	44,871	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,000	1,978	223,886	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,483	167,802	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,282	145,118	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,203	249,328	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,000	1,995	225,831	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,293	146,342	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,780	201,434	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,200	2,167	245,196	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,011	340,790	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,126	240,645	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,800	2,702	305,805	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,700	305,558	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,200	1,155	130,741	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,600	1,602	181,308	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,400	3,404	385,205	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	400	45,307	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	147,204	2018/12/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,800	1,800	203,677	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,000	1,996	225,919	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	298	33,768	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	892	100,967	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	500	495	56,062	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,658	187,621	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	700	656	74,304	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	603	68,232	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	803	90,965	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	1,800	1,807	204,529	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	2,400	2,407	272,419	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	4,300	4,313	488,122	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	501	56,692	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	400	398	45,061	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,590	179,979	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	893	101,150	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,100	1,091	123,502	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,800	1,784	201,903	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,284	145,336	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	986	111,673	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,100	2,070	234,254	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	5,700	5,599	633,617	2021/1/31
		1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,546	288,099	2021/4/30
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,445	276,753	2021/5/31
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,900	1,798	203,530	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,888	213,676	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	800	754	85,407	2023/9/30
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,700	2,717	307,509	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	703	79,631	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	600	603	68,229	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	400	401	45,475	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	401	45,442	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	802	90,827	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,900	3,903	441,733	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	2,000	226,379	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,393	157,655	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	780	88,313	2022/1/31
		1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,700	1,630	184,450	2023/2/28
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,100	2,010	227,479	2023/3/31
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	3,000	2,739	309,986	2026/8/15
1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,409	159,486	2019/3/31		
1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,012	227,767	2019/4/30		
1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,200	1,207	136,586	2019/6/30		
1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,608	182,015	2019/7/31		
1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,513	284,355	2019/8/31		
1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,605	181,619	2019/12/31		
1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,497	169,459	2020/6/30		

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		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	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,600	2,593	293,477	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,490	168,703	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	400	389	44,071	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,200	3,105	351,330	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	4,700	4,529	512,527	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,406	272,289	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,200	4,827	546,274	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,600	2,408	272,516	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	303	34,293	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	1,500	1,512	171,104	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,100	3,099	350,682	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,696	191,949	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	690	78,122	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,000	985	111,470	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,476	167,020	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,180	133,547	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,369	154,957	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	500	487	55,107	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,455	164,726	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,006	113,910	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	696	78,771	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,700	2,671	302,330	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,675	189,634	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,100	1,082	122,461	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,500	1,516	171,554	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,200	2,220	251,263	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,209	136,851	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,100	2,112	239,044	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,506	170,441	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,001	113,370	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,100	124,533	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,900	328,237	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,600	1,598	180,849	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	4,000	3,975	449,877	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	197	22,400	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,272	257,113	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,400	2,321	262,691	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,400	3,274	370,463	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,432	162,047	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,013	114,679	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	707	80,089	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,300	1,311	148,416	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,000	1,007	114,011	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,006	113,927	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,500	1,509	170,759	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,100	1,101	124,610	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,977	223,736	2023/11/30

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,200	3,118	352,886	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	1,250	1,039	117,647	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	600	610	69,101	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,827	206,836	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	913	103,362	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	709	80,275	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,000	3,952	447,190	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,400	3,333	377,166	2025/11/15
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	2,300	2,342	265,012	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	917	103,764	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	715	80,931	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	3,300	3,298	373,190	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	100	88	9,998	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	1,600	1,408	159,400	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	1,400	1,232	139,437	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,500	1,519	171,952	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,700	2,727	308,631	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	200	203	23,031	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	500	510	57,766	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,444	163,434	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	2,900	2,991	338,440	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,300	1,220	138,085	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,500	1,406	159,103	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	200	203	23,081	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	500	514	58,243	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	2,200	2,261	255,853	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,300	3,391	383,721	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,300	2,205	249,591	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	3,100	2,956	334,514	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	100	95	10,806	2046/11/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,900	1,943	219,855	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	7,000	6,896	780,354	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	1,200	1,176	133,096	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	3,600	3,521	398,493	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,450	2,394	270,936	2045/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	4,800	4,837	547,320	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	3,050	3,065	346,859	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	300	301	34,109	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	717	81,236	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,366	154,564	2021/5/15
3.375 T-BOND 440515	3.375	1,600	1,684	190,601	2044/5/15		
3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,115	126,174	2019/11/15		
3.5 T-BOND 390215	3.5	400	433	49,046	2039/2/15		
3.5 T-NOTE 180215	3.5	970	996	112,756	2018/2/15		
3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,166	131,937	2020/5/15		
3.625 T-BOND 430815	3.625	1,350	1,483	167,896	2043/8/15		
3.625 T-BOND 440215	3.625	1,500	1,648	186,538	2044/2/15		

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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-NOTE 190815	3.625	720	759	85,977	2019/8/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,730	195,803	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,000	3,211	363,423	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,119	126,621	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,799	203,599	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,500	2,614	295,814	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	103,206	2040/8/15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,130	1,172	132,639	2018/5/15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	700	79,296	2018/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	600	722	81,722	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	963	109,062	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	611	69,242	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	796	90,107	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	900	1,105	125,105	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,128	127,651	2036/2/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	622	70,457	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,140	128,996	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	300	388	43,913	2041/2/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,138	128,876	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	200	254	28,745	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	500	661	74,842	2031/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	300	385	43,655	2028/8/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	1,220	1,568	177,428	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	390	519	58,837	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,560	1,943	219,939	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	188	21,322	2026/11/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	500	637	72,186	2021/11/15	
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	187	21,161	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,113	239,136	2020/8/15	
小 計					39,592,791		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	894	77,559	2018/5/1	
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	900	896	77,696	2018/8/1	
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	550	547	47,426	2018/11/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	500	494	42,862	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	700	689	59,755	2021/3/1	
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	350	343	29,766	2021/9/1	
	1 CAN GOVT 270601	1.0	450	411	35,619	2027/6/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	900	905	78,475	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	805	69,776	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	352	30,554	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	400	406	35,194	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	760	762	66,066	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	750	729	63,210	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	700	713	61,837	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,000	1,022	88,582	2019/9/1	

## 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		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	650	676	58,620	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	750	796	69,011	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	980	1,053	91,272	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	500	533	46,194	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	218	18,899	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,250	1,361	117,945	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	950	1,026	88,989	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	900	1,088	94,325	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	1,024	88,803	2019/6/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,085	94,047	2041/6/1	
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	600	628	54,444	2018/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	650	917	79,497	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	440	613	53,181	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	710	1,040	90,191	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	240	376	32,618	2027/6/1	
小	計					1,942,427		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	13,600	15,604	83,796	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,400	4,046	21,729	2036/11/20	
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,500	10,225	54,911	2018/6/14	
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	13,400	12,712	68,265	2019/12/11	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,900	4,304	23,113	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,100	14,672	78,791	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,100	5,871	31,529	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,028	27,002	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,700	7,554	40,565	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,100	4,952	26,593	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,500	8,221	44,150	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,200	6,366	34,189	2020/6/11	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,200	5,345	28,703	2023/12/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,100	11,426	61,362	2018/12/13	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,700	4,945	26,557	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	5,100	5,320	28,571	2038/11/18	
小	計					679,832		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	900	866	105,555	2026/8/15
			0 OBL 200417	—	1,100	1,121	136,573	2020/4/17
			0 OBL 210409	—	800	815	99,300	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	500	509	61,977	2021/10/8
			0 SCHATS 180316	—	1,800	1,813	220,846	2018/3/16
			0 SCHATS 180615	—	200	201	24,581	2018/6/15
			0.25 OBL 180413	0.25	800	809	98,524	2018/4/13
			0.25 OBL 191011	0.25	700	717	87,343	2019/10/11
			0.25 OBL 201016	0.25	900	926	112,824	2020/10/16
			0.5 BUND 250215	0.5	800	823	100,277	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
			0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,113	135,633	2018/2/23



## 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	0.5 OBL 190412	0.5	500	513	62,490	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	500	535	65,235	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,650	1,760	214,348	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	500	514	62,625	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	900	989	120,442	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	661	80,535	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,000	1,104	134,458	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	443	53,986	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,500	1,665	202,840	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,013	123,382	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,100	1,227	149,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	1,025	124,838	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	771	93,983	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,679	204,534	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,000	1,306	159,096	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,050	1,382	168,298	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,000	1,124	136,892	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,100	1,226	149,380	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,515	184,559	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,170	142,486	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,330	2,569	312,844	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,190	1,293	157,436	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	700	730	89,003	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,300	2,014	245,326	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	664	80,883	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	590	967	117,836	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	350	513	62,500	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,050	1,712	208,528	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	810	1,427	173,829	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	800	1,310	159,519	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	650	1,005	122,480	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	980	1,408	171,475	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	750	1,274	155,203	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	630	1,020	124,288	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	500	500	60,972	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	400	402	48,969	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	800	805	98,068	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	800	796	97,038	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	700	708	86,278	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	286	34,892	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	406	49,455	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	987	120,254	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	513	62,472	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	750	694	84,526	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,000	1,022	124,515	2022/4/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	512	62,351	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	126,043	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	975	118,734	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	964	117,424	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,050	943	114,892	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,000	1,003	122,209	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,387	168,939	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	400	370	45,101	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,700	1,793	218,397	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	800	846	103,095	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	650	583	71,105	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	300	250	30,440	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	550	552	67,308	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	900	944	115,012	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,000	1,066	129,833	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,565	190,649	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,814	220,902	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,450	1,645	200,404	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,530	1,744	212,376	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,950	2,240	272,792	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,800	2,037	248,074	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,400	1,642	200,042	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,500	1,629	198,393	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	1,400	1,549	188,711	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,271	154,764	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	838	102,095	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,410	1,508	183,733	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,100	1,203	146,508	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,807	220,035	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,700	2,034	247,737	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,400	1,682	204,819	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	963	117,328	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,422	173,234	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,230	1,498	182,440	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	800	996	121,283	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,000	1,279	155,802	2044/9/1
5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	969	118,105	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,300	1,710	208,245	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,150	1,519	184,962	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	920	1,208	147,101	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,650	2,163	263,375	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	550	684	83,357	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	623	75,930	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,247	151,838	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,053	250,091	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,300	1,834	223,376	2027/11/1		

## 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	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	657	80,044	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	680	1,015	123,594	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	1,200	1,207	146,982	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	100	101	12,302	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,300	1,313	159,942	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	800	805	98,027	2021/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,200	1,222	148,897	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	500	466	56,795	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,700	1,743	212,244	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,800	1,775	216,196	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	800	772	94,017	2026/5/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,100	1,122	136,699	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	950	976	118,893	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	800	827	100,724	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,500	1,527	185,933	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	850	786	95,816	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,600	1,620	197,353	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,079	253,226	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,950	2,130	259,390	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	200	167	20,402	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,700	1,907	232,280	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,583	192,829	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,100	2,319	282,420	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,350	1,548	188,544	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,550	1,814	220,931	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,800	2,082	253,588	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,300	2,664	324,435	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,380	1,756	213,929	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,260	153,430	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,900	3,586	436,642	2026/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,684	205,058	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	2,700	3,155	384,176	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,900	2,007	244,478	2018/4/25
4 O. A. T 381025	4.0	1,550	2,183	265,915	2038/10/25		
4 O. A. T 550425	4.0	800	1,191	145,050	2055/4/25		
4 O. A. T 600425	4.0	610	918	111,806	2060/4/25		
4.25 O. A. T 181025	4.25	1,680	1,821	221,748	2018/10/25		
4.25 O. A. T 190425	4.25	1,570	1,737	211,527	2019/4/25		
4.25 O. A. T 231025	4.25	2,300	2,909	354,270	2023/10/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	1,200	1,819	221,535	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	1,100	1,655	201,525	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	1,750	2,617	318,732	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	1,820	2,933	357,124	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	910	1,322	161,056	2025/10/25		
8.5 O. A. T 191025	8.5	1,200	1,496	182,169	2019/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	900	1,363	166,048	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	705	85,853	2018/4/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	716	87,246	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	393	47,966	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	992	120,858	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	800	814	99,165	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	725	88,321	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,221	148,672	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,073	130,721	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	566	68,926	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	859	104,614	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	600	811	98,788	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	900	1,046	127,369	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	911	111,038	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	245	29,934	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	760	1,175	143,183	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	850	907	110,499	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	850	946	115,262	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	800	1,223	148,931	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	640	966	117,740	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	581	70,744	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,006	122,603	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	700	706	85,996	2019/1/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,328	161,719	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,142	139,127	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	685	83,442	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	900	938	114,303	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,539	187,461	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,146	139,547	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,050	1,045	127,313	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	800	850	103,512	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,599	194,754	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,200	1,341	163,382	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	400	403	49,086	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	156	19,005	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	450	482	58,726	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,431	174,240	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,080	1,219	148,519	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	880	938	114,212	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	900	1,149	139,971	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,300	158,292	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,150	1,417	172,600	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,000	1,048	127,666	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,200	1,342	163,409	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,040	1,317	160,388	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	820	1,121	136,575	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	750	946	115,275	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,100	1,295	157,763	2020/10/31

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		銘柄	当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	850	1,188	144,709	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	678	82,666	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	600	870	106,032	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,151	140,203	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,347	164,050	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,100	1,631	198,604	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,300	1,650	200,942	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	850	1,179	143,650	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,330	1,931	235,227	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	850	861	104,929	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	750	762	92,900	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	500	478	58,213	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	900	922	112,354	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	275	33,588	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	350	365	44,483	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	172	20,968	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	908	110,611	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	850	987	120,213	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	764	93,124	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	600	743	90,531	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	900	1,036	126,188	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	480	680	82,814	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	737	89,801	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	200	219	26,741	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	850	1,032	125,761	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	500	683	83,278	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,088	132,574	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	800	993	120,999	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	750	1,128	137,405	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	669	81,519	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	800	1,258	153,242	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,050	1,558	189,784	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	306	37,291	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	302	36,856	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	250	257	31,357	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	650	689	83,974	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	146	17,878	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	67,141	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	600	666	81,170	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	477	58,085	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	330	394	48,091	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	550	66,996	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	500	600	73,112	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	870	1,022	124,512	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	719	87,556	2022/4/20
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	190	309	37,721	2062/1/26		
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	870	1,000	121,841	2020/7/15		

## 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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	600	907	110,522	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	550	607	73,997	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	630	662	80,611	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	450	624	76,041	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	470	57,324	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	346	42,173	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	192	23,395	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	51	6,280	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	250	257	31,301	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	328	40,046	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	20,548	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	319	38,905	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	365	44,507	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	250	280	34,211	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	290	35,339	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	649	79,123	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	392	47,777	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	207	25,224	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	288	35,105	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	440	484	59,047	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	350	416	50,700	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	450	545	66,448	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	620	691	84,167	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	350	380	46,288	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	679	82,787	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	418	50,928	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	600	812	98,881	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	351	42,738	2019/10/18		
小 計						35,756,092	
イギリス							
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	300	294	42,067	2022/7/22	
	1.25 GILT 180722	1.25	1,600	1,626	232,514	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,600	1,658	237,136	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	700	702	100,407	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	400	352	50,375	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	1,500	1,554	222,342	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	1,300	1,365	195,237	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	1,500	1,579	225,844	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	900	949	135,801	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,150	1,242	177,710	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	650	775	110,820	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,100	1,227	175,487	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,200	1,484	212,279	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,130	1,464	209,338	2045/1/22	

## 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	3.5 GILT 680722	3.5	910	1,388	198,522	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	820	894	127,935	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	900	1,006	143,973	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	960	1,096	156,787	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	500	726	103,909	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	900	1,049	150,024	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	850	1,374	196,593	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	700	887	126,889	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	840	1,110	158,727	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,300	1,766	252,568	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	710	1,000	143,025	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,000	1,484	212,214	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	870	1,336	191,167	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,000	1,635	233,867	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	1,000	1,090	155,976	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,050	1,451	207,501	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,110	1,650	236,057	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,136	162,463	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	900	1,231	176,158	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	670	991	141,735	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	650	684	97,942	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	1,100	1,421	203,204	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	380	560	80,216	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	350	462	66,144	2021/6/7
小計					6,460,380	
スイス			千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	200	223	25,344	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	166	18,832	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	350	363	41,186	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	280	305	34,631	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	250	319	36,189	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	320	465	52,739	2028/4/8
小計					208,924	
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	1 SWD GOVT 261112	1.0	3,250	3,330	42,791	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,200	4,541	58,360	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,700	4,295	55,195	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,000	5,919	76,066	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,400	3,191	41,012	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,650	5,129	65,911	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	5,100	6,134	78,834	2020/12/1
小計					418,172	
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	2,000	1,972	26,905	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,100	2,130	29,058	2025/3/13
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,950	3,068	41,848	2023/5/24

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
ノルウェー			%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
	国債証券	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,400	2,652	36,184	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,000	4,457	60,794	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,630	3,949	53,871	2019/5/22
小計						248,663	
デンマーク				千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	2,500	2,538	41,563	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,750	3,008	49,249	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,000	5,549	90,849	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	4,800	5,533	90,581	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	5,310	5,968	97,703	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,650	11,035	180,650	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,090	1,664	27,246	2024/11/10
小計						577,843	
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	1.5 POLAND 200425	1.5	1,500	1,454	40,689	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	1,200	1,143	31,991	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	1,450	1,400	39,191	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	1,300	1,171	32,767	2026/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,200	1,229	34,388	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	2,250	2,184	61,108	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	950	974	27,274	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,300	1,341	37,539	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	900	981	27,453	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,110	1,204	33,688	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	850	953	26,679	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,580	44,221	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	800	945	26,459	2029/4/25
		POLAND 181025	—	1,100	1,062	29,739	2018/10/25
小計						546,918	
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	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	800	790	67,831	2020/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	300	282	24,261	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,400	1,431	122,742	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,400	1,421	121,883	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	600	597	51,243	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	350	320	27,460	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	300	258	22,172	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	850	871	74,740	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,300	1,360	116,730	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,200	1,239	106,327	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	250	237	20,369	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	520	541	46,438	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,700	1,918	164,541	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,509	129,479	2020/4/15	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	600	699	60,005	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,700	2,004	171,957	2027/4/21	



## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				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		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,330	1,424	122,149	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	829	71,114	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,200	1,415	121,415	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,310	1,504	129,042	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,300	1,531	131,385	2022/7/15
小	計					1,903,293	
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	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	100	99	7,961	2018/4/1
		1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	100	97	7,827	2021/10/1
		1.625 SINGAPORGOVT 191001	1.625	250	251	20,156	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	370	375	30,068	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOVT 260601	2.125	250	245	19,704	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOVT 250601	2.375	150	150	12,096	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	550	570	45,754	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	370	372	29,837	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	200	200	16,112	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOVT 290701	2.875	350	361	28,967	2029/7/1
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	205	16,459	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	527	42,244	2024/9/1
		3.125 SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	424	33,987	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	260	274	22,027	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOVT 330901	3.375	450	490	39,282	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	370	405	32,491	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	490	511	41,041	2018/9/1
小	計					532,070	
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	9,200	10,266	87,778	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,410	29,156	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,600	2,606	22,284	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,400	3,247	27,761	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	5,600	4,651	39,769	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,851	24,383	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,200	3,109	26,585	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,900	1,908	16,313	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,700	4,295	36,727	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,800	3,480	29,760	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	5,100	4,668	39,918	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,700	4,369	37,362	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,500	6,027	51,531	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	1,600	1,528	13,068	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,200	1,147	9,810	2040/1/31
小	計					492,212	
合	計					89,359,623	

(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

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 89,359,623	% 96.9
コール・ローン等、その他	2,872,912	3.1
投資信託財産総額	92,232,535	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (90,456,093千円) の投資信託財産総額 (92,232,535千円) に対する比率は98.1%です。

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

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	183,544,025,876
コール・ローン等	450,478,854
公社債(評価額)	89,359,623,726
未収入金	92,933,013,317
未収利息	746,061,431
前払費用	54,848,548
(B) 負債	91,364,407,437
未払金	91,360,321,640
未払解約金	4,085,578
未払利息	219
(C) 純資産総額(A-B)	92,179,618,439
元本	73,688,743,763
次期繰越損益金	18,490,874,676
(D) 受益権総口数	73,688,743,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,509円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 45,472,741,060円  
 期中追加設定元本額 36,627,504,520円  
 期中一部解約元本額 8,411,501,817円  
 また、1口当たり純資産額は、期末12,509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)

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	17,724,985円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,193,352,179円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,182,431,336円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	19,509,450円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	139,439,658円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,596,138,745円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	66,702,280円
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)	41,815,849,105円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,503,171,426円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	429,836,891円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	499,408,174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)	1,230,227,777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)	179,490,028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)	211,829,180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)	2,603,632,549円
合計	73,688,743,763円

## [お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年3月16日)

## ○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,987,199,908
受取利息	1,987,449,349
支払利息	△ 249,441
(B) 有価証券売買損益	△ 3,590,820,610
売買益	18,213,147,829
売買損	△21,803,968,439
(C) 保管費用等	△ 12,474,555
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,616,095,257
(E) 前期繰越損益金	11,882,079,061
(F) 追加信託差損益金	10,686,056,557
(G) 解約差損益金	△ 2,461,165,685
(H) 計(D+E+F+G)	18,490,874,676
次期繰越損益金(H)	18,490,874,676

- (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。