

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	ベビーフンド	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 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。） </div>	

※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
 イマックス

eMAXIS 先進国債券 インデックス（為替ヘッジあり）

第2期（決算日：2018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2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）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

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

○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 (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み入金	期騰落中率	期騰落中率	中率			
(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	△4.6	378.81	△4.6	96.8	22	
2期(2018年1月26日)	9,560	0	0.4	1.0	382.76	1.0	97.6	59	

(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		シティ世界国債インデックス (<small>除く日本、円ヘッジ・円ベース</small>)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年1月26日	円 9,522	% —	378.81	% —	% 96.8	% —
1月末	9,515	△0.1	378.53	△0.1	96.4	—
2月末	9,605	0.9	382.40	0.9	96.3	—
3月末	9,580	0.6	381.61	0.7	97.8	—
4月末	9,626	1.1	383.65	1.3	98.1	—
5月末	9,670	1.6	385.66	1.8	98.5	—
6月末	9,630	1.1	384.17	1.4	105.5	—
7月末	9,618	1.0	383.87	1.3	97.8	—
8月末	9,699	1.9	387.34	2.3	98.1	—
9月末	9,612	0.9	383.97	1.4	97.4	—
10月末	9,644	1.3	385.49	1.8	97.3	—
11月末	9,649	1.3	385.93	1.9	97.9	—
12月末	9,629	1.1	385.27	1.7	97.8	—
(期 末) 2018年1月26日	9,560	0.4	382.76	1.0	97.6	—

(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。

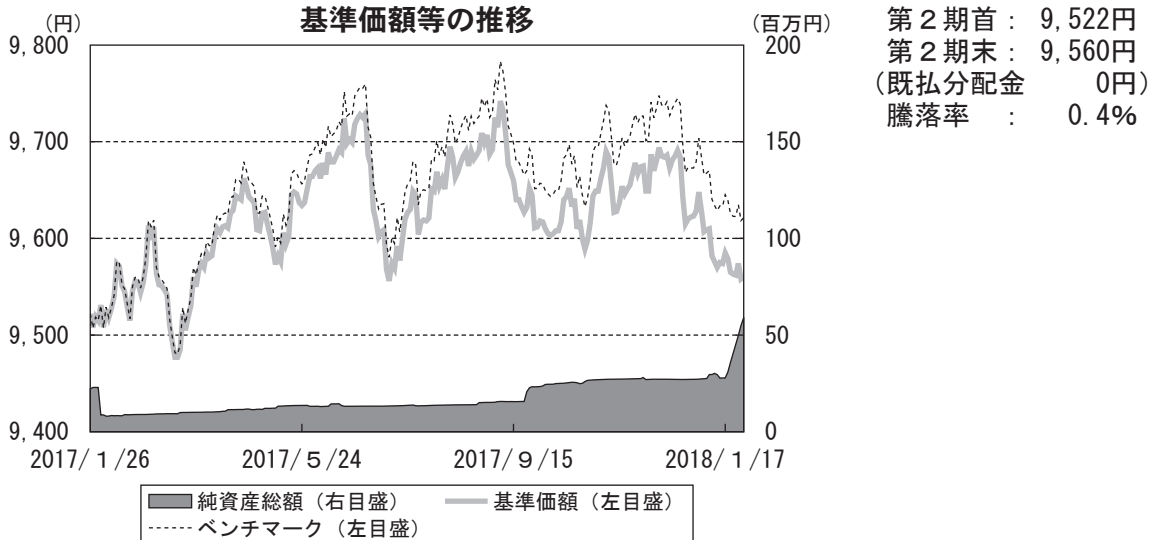
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第2期：2017/1/27～2018/1/26)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.4%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(1.0%)を0.6%下回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	米国のインフレが抑制されるとの観測などを背景に、先進国の債券市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
------	---

投資環境について

（第2期：2017/1/27～2018/1/26）

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、米国のインフレが抑制されるとの観測などを背景に上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 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 >

基準価額は期首に比べ1.0%の上昇となりました。

- ・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）

期首（2017年1月26日）

期末（2018年1月26日）

最終利回り	1.4%	➡	最終利回り	1.6%
直接利回り	2.4%		直接利回り	2.4%
デュレーション	6.7年		デュレーション	7.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、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。
- ・直接利回りとは、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

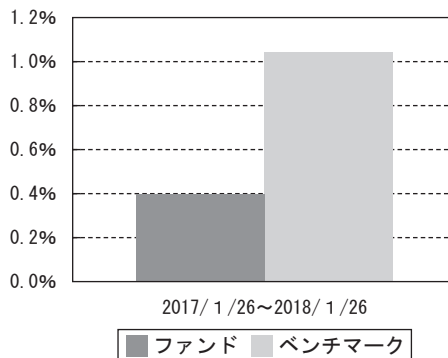
< eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

	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	$\Delta 0.6\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.6\%$ 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 1.0% の上昇となったため、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	$\Delta 0.0\%$ 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 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 $\Delta 0.0\%$ 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。

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2期
	2017年1月27日～2018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	195

(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

(2017年1月27日～2018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)	(28)	(0.287)	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)	(28)	(0.290)	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)	(0.064)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.014)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	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	64	0.658	
期中の平均基準価額は、9,623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

(2017年1月27日～2018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 48,286	千円 61,140	千口 19,669	千円 24,750

○利害関係人との取引状況等

(2017年1月27日～2018年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			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	1,852,172	204,754	11.1	1,935,108	272,537	14.1
為替直物取引	117,899	63,018	53.5	35,683	6,170	17.3

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

(2017年1月27日～2018年1月26日)

期首残高(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

(2018年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 17,724	千口 46,341	千円 58,543

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

(2018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 58,543	% 98.9
コール・ローン等、その他	629	1.1
投資信託財産総額	59,172	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（182,378,259千円）の投資信託財産総額（185,213,328千円）に対する比率は98.5%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=109.78円	1 カナダドル=88.70円	1 メキシコペソ=5.90円	1 ユーロ=136.17円
1 イギリスポンド=155.44円	1 スイスフラン=116.59円	1 スウェーデンクローネ=13.86円	1 ノルウェークローネ=14.18円
1 デンマーククローネ=18.29円	1 ポーランドズロチ=32.86円	1 オーストラリアドル=88.18円	1 シンガポールドル=83.83円
1 南アフリカランド=9.21円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	59,172,926
コール・ローン等	629,228
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	58,543,698
(B) 負債	76,357
未払解約金	204
未払信託報酬	75,778
その他未払費用	375
(C) 純資産総額(A-B)	59,096,569
元本	61,817,761
次期繰越損益金	△ 2,721,192
(D) 受益権総口数	61,817,761口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,560円

<注記事項>

- ①期首元本額 23,321,025円
 期中追加設定元本額 67,407,535円
 期中一部解約元本額 28,910,799円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9560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2,721,192円です。

③分配金の計算過程

項 目	2017年1月27日～ 2018年1月26日
費用控除後の配当等収益額	355,230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	813,968円
分配準備積立金額	39,782円
当ファンドの分配対象収益額	1,208,980円
1万口当たり収益分配対象額	195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（2017年1月27日～2018年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 64
支払利息	△ 64
(B) 有価証券売買損益	△ 43,668
売買益	80,354
売買損	△ 124,022
(C) 信託報酬等	△ 114,548
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 158,280
(E) 前期繰越損益金	△ 181,598
(F) 追加信託差損益金	△ 2,381,314
(配当等相当額)	(711,393)
(売買損益相当額)	(△ 3,092,707)
(G) 計(D+E+F)	△ 2,721,192
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 2,721,192
追加信託差損益金	△ 2,381,314
(配当等相当額)	(813,968)
(売買損益相当額)	(△ 3,195,282)
分配準備積立金	395,012
繰越損益金	△ 734,890

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。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。

【お 知 ら せ】

- ①よりわかりやすい記載を目的として目論見書の特色の分配方針に「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。)」を掲載しました。
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ③2014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9期》決算日2018年1月26日

[計算期間：2017年1月27日～2018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9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9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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	（除く日本、円ヘッジ・円ベース） 期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523

(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>債(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) 2017年1月26日	円 12,509	% —	378.81	% —	96.9	—
1月末	12,501	△0.1	378.53	△0.1	97.2	—
2月末	12,628	1.0	382.40	0.9	97.3	—
3月末	12,599	0.7	381.61	0.7	98.8	—
4月末	12,666	1.3	383.65	1.3	99.3	—
5月末	12,733	1.8	385.66	1.8	99.7	—
6月末	12,684	1.4	384.17	1.4	109.1	—
7月末	12,673	1.3	383.87	1.3	99.2	—
8月末	12,788	2.2	387.34	2.3	99.1	—
9月末	12,677	1.3	383.97	1.4	100.9	—
10月末	12,726	1.7	385.49	1.8	98.4	—
11月末	12,740	1.8	385.93	1.9	99.0	—
12月末	12,720	1.7	385.27	1.7	100.0	—
(期 末) 2018年1月26日	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

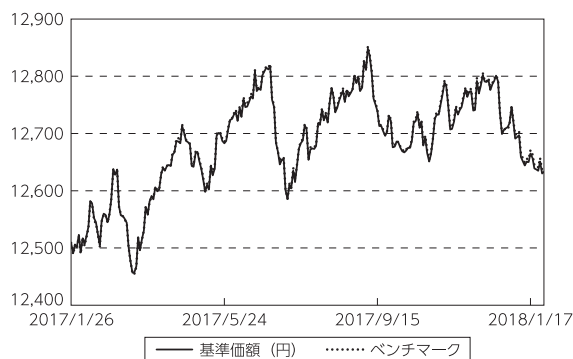
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.0%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(1.0%)と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

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、米国のインフレが抑制されるとの観測などを背景に上昇しました。

●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1.0%の上昇となったため、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	$\Delta 0.0\%$ 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 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 $\Delta 0.0\%$ 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

- ・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

(2017年1月27日～2018年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、12,677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

(2017年1月27日～2018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 635,251	千アメリカドル 283,993
	カナダ	千カナダドル 37,284	千カナダドル 14,355
	メキシコ	千メキシコペソ 192,853	千メキシコペソ 78,654
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 80,767	34,272
	イタリア	国債証券 102,108	38,711
	フランス	国債証券 111,795	44,756
	オランダ	国債証券 21,630	8,182
	スペイン	国債証券 58,157	18,958
	ベルギー	国債証券 25,639	8,842
国	オーストリア	国債証券 15,663	5,099
	フィンランド	国債証券 6,199	2,067
	アイルランド	国債証券 7,627	2,306
	イギリス	千イギリスポンド 63,668	千イギリスポンド 22,690
	スイス	千スイスフラン 1,730	千スイスフラン 746
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 42,589	千スウェーデンクローネ 10,793
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 25,435	千ノルウェークローネ 4,346
	デンマーク	千デンマーククローネ 43,289	千デンマーククローネ 18,868
	ポーランド	千ポーランドズロチ 31,403	千ポーランドズロチ 14,545
	オーストラリア	千オーストラリアドル 33,256	千オーストラリアドル 9,493
	シンガポール	千シンガポールドル 10,311	千シンガポールドル 3,678
	南アフリカ	千南アフリカランド 81,534	千南アフリカランド 20,809

(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

(2017年1月27日～2018年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	1,852,172	204,754	11.1	1,935,108	272,537	14.1
為替直物取引	117,899	63,018	53.5	35,683	6,170	17.3

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

(2018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			末			
		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 690,580	千アメリカドル 694,870	千円 76,282,930	% 41.6	% —	% 17.6	% 15.8	% 8.2
カナダ	千カナダドル 41,520	千カナダドル 44,241	3,924,214	2.1	—	0.9	0.8	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 235,450	千メキシコペソ 238,284	1,405,877	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	85,520	98,232	13,376,314	7.3	—	4.2	2.0	1.1
イタリア	118,330	133,733	18,210,484	9.9	—	5.8	2.9	1.2
フランス	118,110	138,644	18,879,241	10.3	—	6.6	2.5	1.2
オランダ	25,750	29,969	4,081,006	2.2	—	1.3	0.6	0.3
スペイン	68,530	79,833	10,870,866	5.9	—	3.9	1.5	0.5
ベルギー	28,930	34,837	4,743,830	2.6	—	1.9	0.6	0.2
オーストリア	17,930	21,321	2,903,302	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	7,840	8,476	1,154,213	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	9,680	10,896	1,483,727	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 69,500	千イギリスポンド 85,024	13,216,273	7.2	—	5.2	1.5	0.5
スイス	千スイスフラン 2,330	千スイスフラン 2,741	319,649	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 56,500	千スウェーデンクローネ 62,942	872,381	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 36,950	千ノルウェークローネ 38,603	547,394	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 47,550	千デンマーククローネ 58,752	1,074,589	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 36,000	千ポーランドズロチ 36,934	1,213,676	0.7	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 43,250	千オーストラリアドル 45,317	3,996,084	2.2	—	1.4	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 12,800	千シンガポールドル 13,265	1,112,084	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 130,350	千南アフリカランド 120,605	1,110,773	0.6	—	0.6	0.0	0.0
合 計	—	—	180,778,919	98.5	—	53.1	30.6	14.8

(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	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	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,777	195,180	2019/2/15
		0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,080	118,592	2019/7/15
		0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,200	2,157	236,902	2019/8/15
		0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,700	2,665	292,573	2019/4/15
		0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,084	119,073	2019/5/15
		0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	492	54,064	2019/6/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	491	53,983	2019/7/31
		0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,668	183,192	2019/9/15
		1 T-NOTE 190315	1.0	1,900	1,880	206,414	2019/3/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	400	394	43,304	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	2,700	2,657	291,716	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,474	161,904	2019/9/30
		1 T-NOTE 191015	1.0	2,500	2,456	269,700	2019/10/15
		1 T-NOTE 191115	1.0	5,700	5,595	614,282	2019/11/15
		1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,275	140,015	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,800	2,780	305,198	2019/1/15
		1.125 T-NOTE 190131	1.125	1,900	1,885	206,952	2019/1/31
		1.125 T-NOTE 190228	1.125	7,200	7,138	783,654	2019/2/28
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,285	141,125	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,768	194,122	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,000	978	107,369	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	2,997	329,071	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,398	1,690,474	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,499	274,412	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,688	295,112	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	671	73,688	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 181231	1.25	400	397	43,663	2018/12/31
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,800	1,788	196,307	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190331	1.25	3,400	3,372	370,263	2019/3/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,000	1,982	217,613	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 190531	1.25	3,100	3,070	337,087	2019/5/31
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	295	32,486	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	885	97,204	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	2,400	2,358	258,933	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	12,100	11,734	1,288,176	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	2,983	327,476	2021/10/31
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,600	1,592	174,845	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	497	54,566	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 191215	1.375	6,600	6,516	715,406	2019/12/15
		1.375 T-NOTE 200115	1.375	10,200	10,064	1,104,840	2020/1/15
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	3,600	3,550	389,804	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200215	1.375	2,700	2,661	292,179	2020/2/15
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,576	173,054	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	9,100	8,958	983,466	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,100	1,081	118,757	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,600	1,572	172,587	2020/5/31

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	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					
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,274	139,915	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	14,000	13,713	1,505,461	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	4,200	4,109	451,170	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,560	171,339	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,528	277,578	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,428	266,645	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,400	2,268	249,042	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,886	207,055	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	1,700	1,601	175,792	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	1,300	1,294	142,134	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	500	497	54,639	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	397	43,685	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	4,900	4,869	534,559	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	4,150	4,111	451,333	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	1,979	217,347	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	4,000	3,944	432,996	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	4,700	4,632	508,508	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,900	2,855	313,449	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	774	85,017	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,900	1,815	199,293	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	7,700	7,349	806,870	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,750	5,260	577,530	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,394	153,115	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	1,991	218,616	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,650	2,636	289,439	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	17,100	17,005	1,866,825	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,484	272,756	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,586	174,165	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	1,500	1,485	163,042	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,481	162,650	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,300	1,283	140,896	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,476	162,122	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,127	892,290	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	11,050	10,664	1,170,706	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,534	827,100	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,397	263,193	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	2,200	2,099	230,534	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,500	4,183	459,236	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	8,527	936,121	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,000	1,990	218,530	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 191130	1.75	4,000	3,977	436,701	2019/11/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,500	1,482	162,766	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,678	184,249	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	10,000	9,794	1,075,243	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,463	1,368,201	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,367	150,089	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,463	160,681	2022/4/30

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,170	128,524	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,703	406,571	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	3,600	3,497	383,907	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,448	158,983	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	3,250	3,229	354,485	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 201215	1.875	6,000	5,947	652,942	2020/12/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	689	75,699	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	1,965	215,717	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,500	2,454	269,432	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220430	1.875	4,000	3,921	430,474	2022/4/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,627	398,189	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,662	182,456	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,152	675,404	2022/10/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	7,500	7,467	819,747	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	350	348	38,218	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	1,800	1,787	196,276	2021/2/28
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	990	108,699	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,300	2,275	249,752	2021/10/31
	2 T-NOTE 211231	2.0	1,300	1,284	140,996	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	2,864	314,481	2022/2/15
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	196	21,547	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,253	247,404	2023/2/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,425	266,237	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,900	1,841	202,161	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,250	4,097	449,797	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,650	3,506	384,950	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,600	5,330	585,134	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	999	109,677	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	698	76,653	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	18,400	18,302	2,009,221	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	993	109,111	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,673	403,298	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	5,550	5,492	602,995	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,960	215,254	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,600	1,565	171,874	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	3,400	3,324	364,970	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	3,500	3,407	374,083	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,700	3,591	394,317	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,250	1,097	120,436	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,800	197,650	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,600	175,689	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	699	76,779	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	300	295	32,483	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,091	449,180	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	12,000	11,778	1,293,071	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	4,075	447,387	2027/2/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	703	77,236	2020/12/31

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			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.375	T-NOTE 240815	2.375	11,500	11,389	1,250,338	2024/8/15
		2.375	T-NOTE 270515	2.375	9,000	8,818	968,105	2027/5/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	4,850	4,505	494,621	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	2,500	2,316	254,359	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	5,250	4,862	533,839	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	12,350	12,376	1,358,642	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	10,600	10,587	1,162,304	2024/5/15
		2.625	T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,416	155,451	2020/8/15
		2.625	T-NOTE 201115	2.625	3,800	3,844	422,085	2020/11/15
		2.75	T-BOND 420815	2.75	10,550	10,358	1,137,187	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	2,000	1,961	215,357	2042/11/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	2,900	2,823	310,004	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 190215	2.75	2,100	2,118	232,546	2019/2/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	4,100	4,160	456,743	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	3,000	3,041	333,894	2024/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	2,700	2,705	297,031	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	2,500	2,499	274,342	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	8,100	8,093	888,453	2046/11/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	5,150	5,289	580,649	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	5,400	5,531	607,215	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	3,600	3,686	404,655	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	3,050	3,122	342,807	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	5,050	5,171	567,728	2047/2/15
		3.125	T-BOND 411115	3.125	1,400	1,468	161,256	2041/11/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	5,650	5,930	651,027	2042/2/15
		3.125	T-BOND 430215	3.125	3,450	3,612	396,612	2043/2/15
		3.125	T-BOND 440815	3.125	2,850	2,984	327,612	2044/8/15
		3.125	T-NOTE 190515	3.125	12,400	12,585	1,381,637	2019/5/15
		3.125	T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,335	146,644	2021/5/15
		3.375	T-BOND 440515	3.375	3,100	3,390	372,222	2044/5/15
		3.375	T-NOTE 191115	3.375	1,860	1,903	208,920	2019/11/15
		3.5	T-NOTE 200515	3.5	2,500	2,577	282,962	2020/5/15
		3.625	T-BOND 430815	3.625	1,450	1,650	181,192	2043/8/15
		3.625	T-BOND 440215	3.625	2,100	2,391	262,561	2044/2/15
		3.625	T-NOTE 190815	3.625	2,520	2,581	283,432	2019/8/15
		3.625	T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,680	184,463	2020/2/15
		3.75	T-BOND 410815	3.75	1,000	1,157	127,121	2041/8/15
		3.75	T-BOND 431115	3.75	4,700	5,458	599,246	2043/11/15
		3.875	T-BOND 400815	3.875	800	941	103,337	2040/8/15
		4.25	T-BOND 401115	4.25	800	992	108,915	2040/11/15
		4.375	T-BOND 391115	4.375	500	628	68,994	2039/11/15
		4.375	T-BOND 400515	4.375	2,050	2,581	283,438	2040/5/15
		4.375	T-BOND 410515	4.375	800	1,011	111,073	2041/5/15
		4.5	T-BOND 360215	4.5	1,460	1,833	201,262	2036/2/15
		4.625	T-BOND 400215	4.625	2,600	3,379	371,034	2040/2/15
		4.75	T-BOND 410215	4.75	5,200	6,902	757,722	2041/2/15
		5.0	T-BOND 370515	5.0	700	936	102,835	2037/5/15

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					
	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		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	5.25 T-BOND 290215	5.25	2,250	2,813	308,910	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,200	1,562	171,524	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,498	274,312	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	16,440	21,420	2,351,576	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,710	3,243	356,098	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	800	1,103	121,121	2030/5/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,568	172,215	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	174	19,201	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	6,600	7,679	843,051	2020/8/15
小計					76,282,930	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 190201	0.5	1,400	1,384	122,801	2019/2/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,129	100,212	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 190501	0.75	1,300	1,285	113,980	2019/5/1
	0.75 CAN GOVT 190801	0.75	400	394	34,954	2019/8/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,150	1,117	99,156	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	2,000	1,930	171,191	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	143	12,753	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,300	1,240	110,074	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	950	851	75,522	2027/6/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	5,300	5,266	467,167	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	2,250	2,183	193,687	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	700	661	58,694	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	901	79,939	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	3,500	3,499	310,437	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,750	1,757	155,895	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,100	1,123	99,613	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,230	1,267	112,468	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,350	1,470	130,474	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	500	562	49,875	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,150	3,282	291,181	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,150	1,193	105,862	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,380	1,701	150,878	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	985	87,445	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,650	2,136	189,506	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,300	1,839	163,148	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,600	2,153	191,020	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,589	140,975	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	800	1,187	105,293	2027/6/1
小計					3,924,214	
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	23,250	26,469	156,172	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	7,000	8,619	50,853	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	20,500	19,648	115,926	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	20,850	18,675	110,184	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	33,400	32,526	191,904	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	19,500	18,849	111,209	2022/6/9

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					償還年月日	
	利率	額面金額	評価額		千円		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	10,500	10,485	61,862	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	11,300	11,426	67,418	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,907	64,356	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	19,100	19,190	113,225	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	27,300	27,667	163,236	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,000	8,225	48,529	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	4,350	4,488	26,482	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	10,400	11,139	65,721	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,200	9,964	58,793	2038/11/18	
小計					1,405,877		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	3,350	3,231	440,062	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,700	1,720	234,250	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	5,800	5,868	799,164	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	500	504	68,748	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	800	805	109,729	2022/4/8
		0 SCHATS 190315	—	700	705	96,027	2019/3/15
		0.25 BUND 270215	0.25	1,500	1,469	200,107	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	6,750	6,849	932,713	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	2,250	2,293	312,321	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,950	3,002	408,794	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,950	2,983	406,218	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	1,200	1,216	165,681	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,600	1,684	229,439	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,750	2,894	394,141	2025/8/15
		1 OBL 190222	1.0	1,300	1,323	180,195	2019/2/22
		1.25 BUND 480815	1.25	450	443	60,334	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,900	2,041	278,030	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	4,100	4,417	601,541	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	800	863	117,520	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,800	1,951	265,800	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,550	2,765	376,622	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,141	291,659	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,800	3,046	414,793	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	997	135,772	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	750	102,156	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	250	273	37,178	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	2,800	3,042	414,247	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	2,750	3,536	481,500	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,120	1,452	197,787	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	2,050	2,226	303,124	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,000	2,150	292,772	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,450	1,629	221,886	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	2,500	3,607	491,251	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,900	2,013	274,222	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	440	458	62,424	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,900	2,874	391,399	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	600	963	131,214	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	3,100	4,391	597,958	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,900	3,006	409,338	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,710	2,951	401,897	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,150	1,819	247,763	2031/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,363	185,683	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	950	1,554	211,633	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,900	2,946	401,202	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	800	803	109,428	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	1,000	1,005	136,864	2019/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	399	54,441	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	8,450	8,512	1,159,120	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	3,700	3,758	511,840	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	294	40,054	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,118	152,363	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	1,005	136,955	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	511	69,628	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,243	169,340	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,550	1,600	217,951	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	4,250	4,399	599,028	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,100	1,107	150,777	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,026	139,812	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	1,000	136,295	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	990	134,923	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,500	1,373	187,057	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,100	2,182	297,144	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,700	2,775	377,944	2025/12/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	600	605	82,403	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,386	188,744	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,500	1,537	209,338	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,200	1,130	153,997	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	3,500	3,471	472,669	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	3,400	3,520	479,403	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,000	1,074	146,280	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,100	1,030	140,323	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	550	493	67,209	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,257	171,246	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	800	852	116,139	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,500	2,816	383,545	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	2,300	2,563	349,003	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,430	1,602	218,196	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,425	330,340	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,750	1,929	262,797	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,550	1,850	251,924	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	400	418	57,014	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	8,200	8,787	1,196,621	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,234	168,038	2020/3/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			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	4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	600	631	86,007	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,749	238,270	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	3,085	420,184	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,700	2,034	277,095	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	6,300	7,659	1,043,036	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,389	189,147	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,730	2,086	284,065	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,800	3,680	501,155	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,315	587,672	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,450	1,800	245,175	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	3,850	524,379	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	850	1,143	155,683	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,600	3,473	472,931	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	6,400	8,405	1,144,522	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,150	2,630	358,256	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,254	170,817	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,051	279,372	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,900	4,069	554,139	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	649	88,502	2026/11/1
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,850	2,672	363,855	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 190225	—	300	301	41,112	2019/2/25
		0 O.A.T 200225	—	1,500	1,513	206,135	2020/2/25
		0 O.A.T 200525	—	2,950	2,978	405,538	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	3,400	3,422	466,034	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	1,200	1,200	163,474	2022/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	3,700	3,758	511,738	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	2,750	2,654	361,446	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	1,700	1,731	235,781	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,500	1,506	205,169	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	1,300	1,290	175,795	2026/5/25
		1 O.A.T 190525	1.0	3,400	3,470	472,559	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	2,000	2,074	282,487	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	3,700	3,785	515,456	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	1,950	1,901	258,866	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	1,850	1,936	263,692	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	3,600	3,909	532,336	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	300	327	44,650	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	750	785	106,902	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	600	568	77,475	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	2,050	2,162	294,434	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	5,000	5,522	752,016	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	8,800	9,883	1,345,902	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,100	2,264	308,305	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	5,100	5,966	812,448	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,400	2,846	387,572	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,389	461,541	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	6,350	7,161	975,124	2021/10/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	3.25 O.A.T 450525	3.25	2,400	3,232	440,107	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,100	2,285	311,256	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	5,100	6,327	861,609	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	6,010	6,461	879,849	2019/10/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,350	1,975	269,005	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	900	1,425	194,062	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,400	2,273	309,569	2060/4/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	3,100	3,285	447,442	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,100	3,821	520,405	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	4,350	6,906	940,457	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,700	4,159	566,389	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	3,200	4,772	649,922	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	3,000	4,878	664,289	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	4,750	6,763	920,953	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,042	141,953	2019/10/25
8.5 O.A.T 230425	8.5	500	719	97,966	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	500	502	68,484	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,300	1,320	179,856	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,950	1,928	262,647	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	900	898	122,381	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,350	1,361	185,440	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,750	1,781	242,573	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,950	2,126	289,541	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,800	2,001	272,608	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,550	1,712	233,147	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,450	1,759	239,577	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,200	1,616	220,106	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,526	344,079	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,400	1,537	209,386	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	850	1,008	137,310	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,500	2,305	313,973	2042/1/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	950	1,014	138,127	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,400	2,109	287,304	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,300	1,907	259,730	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	548	74,729	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	2,550	2,566	349,501	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	3,200	3,224	439,094	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,000	1,024	139,516	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	2,100	2,168	295,233	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	705	96,023	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	2,200	2,273	309,564	2020/1/31
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	1,650	1,656	225,587	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,600	1,626	221,545	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,574	214,448	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,200	3,406	463,802	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,750	1,786	243,218	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	4,400	4,761	648,347	2025/10/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	750	779	106,146	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,559	212,338	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,100	2,371	322,922	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,300	1,378	187,759	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	750	850	115,781	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,850	2,200	299,701	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,530	2,769	377,087	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,900	2,497	340,064	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,254	170,788	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,550	4,318	588,058	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,800	1,934	263,452	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,079	283,148	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,050	2,903	395,392	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,494	203,554	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,800	2,046	278,616	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,250	1,803	245,618	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	700	948	129,151	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,200	1,811	246,612	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,850	2,307	314,245	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,100	3,651	497,159	2021/4/30
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,200	3,284	447,220	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,450	3,008	409,642	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	900	1,245	169,570	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,150	4,560	620,946	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	400	399	54,424	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,665	362,972	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,357	184,785	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,150	1,187	161,767	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,100	1,086	147,895	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	200	201	27,414	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	750	730	99,476	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	270	36,829	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	189	25,786	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,672	227,685	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	400	438	59,712	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,900	2,177	296,504	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,600	1,693	230,663	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	400	504	68,665	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,750	1,942	264,554	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,250	1,845	251,308	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	550	579	78,869	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,300	1,523	207,518	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	650	900	122,653	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,650	1,919	261,433	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,157	293,844	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,700	2,629	358,024	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	793	107,995	2026/3/28

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	5 BEL GOVT 350328	5.0	2,050	3,255	443,308	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,850	2,715	369,734	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	600	594	80,895	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	600	608	82,796	2019/10/18
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	750	735	100,170	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	650	656	89,444	2026/10/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	600	632	86,184	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	148	20,258	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	212	29,000	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	434	59,226	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,700	1,851	252,107	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	465	63,391	2019/6/18
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	60	62	8,502	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	750	886	120,671	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	900	1,243	169,305	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	1,550	1,802	245,380	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,815	247,241	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	750	867	118,165	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,078	146,845	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,170	1,293	176,193	2020/7/15		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,150	1,722	234,519	2037/3/15		
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	900	949	129,318	2019/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,892	257,712	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,365	185,968	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	200	200	27,286	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	450	444	60,581	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	1,300	1,325	180,432	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	349	47,546	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	450	436	59,450	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	800	825	112,360	2025/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	589	80,260	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	591	80,514	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	550	608	82,852	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	450	583	79,498	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	640	768	104,607	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	600	650	88,580	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	224	30,508	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	504	68,694	2025/7/4		
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	374	51,039	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	800	827	112,685	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,000	1,021	139,062	2026/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	500	511	69,589	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	750	787	107,251	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	890	1,015	138,321	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	889	121,080	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	953	129,818	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	1,000	1,068	145,470	2019/6/18

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	655	89,219	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	750	860	117,175	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,473	200,675	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	750	832	113,375	2019/10/18
小 計						75,702,988	
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	2,950	2,894	449,985	2022/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	4,500	4,598	714,847	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	3,750	3,805	591,473	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,650	1,507	234,317	2047/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	2,800	2,847	442,673	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	2,100	2,177	338,518	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	800	784	121,927	2037/9/7
		1.75 GILT 570722	1.75	2,450	2,464	383,139	2057/7/22
		2 GILT 200722	2.0	2,850	2,942	457,357	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	2,650	2,800	435,345	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	3,150	3,358	522,077	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	800	1,016	157,967	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,350	1,489	231,496	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,850	3,626	563,750	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,150	1,533	238,300	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,000	1,624	252,470	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	2,400	2,521	391,951	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	600	647	100,658	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	960	1,060	164,920	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	600	899	139,873	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	850	958	149,005	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	1,140	1,922	298,756	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	200	252	39,179	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,300	1,724	268,101	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,100	2,892	449,538	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,100	1,563	243,009	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	800	1,150	178,789	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	950	1,444	224,533	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	350	552	85,810	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	4,200	7,105	1,104,481	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	850	886	137,872	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	2,150	2,995	465,692	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	4,750	7,195	1,118,393	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,086	168,835	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,350	1,842	286,332	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	650	975	151,616	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	1,800	2,268	352,679	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,800	2,614	406,459	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	800	991	154,131	2021/6/7
小 計						13,216,273	

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			
スイス			%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
国債証券	2 SWISS GOVT 210428		2.0	420	456	53,274	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706		2.25	350	376	43,902	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 190512		3.0	570	599	69,891	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211		4.0	450	551	64,306	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408		4.0	540	757	88,274	2028/4/8
小計						319,649	
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	3,850	3,800	52,669	2028/5/12
	1 SWD GOVT 261112		1.0	6,150	6,316	87,540	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113		1.5	8,000	8,557	118,608	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512		2.5	5,850	6,692	92,753	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601		3.5	9,750	11,228	155,633	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330		3.5	4,400	5,928	82,164	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312		4.25	9,350	9,878	136,920	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201		5.0	9,150	10,540	146,089	2020/12/1
小計						872,381	
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	4,400	4,347	61,649	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313		1.75	3,500	3,538	50,172	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217		1.75	3,050	3,045	43,180	2027/2/17
	2 NORWE GOVT 230524		2.0	6,100	6,297	89,296	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314		3.0	4,500	4,904	69,538	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525		3.75	7,700	8,373	118,737	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522		4.5	7,700	8,097	114,819	2019/5/22
小計						547,394	
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		
国債証券	0.5 DMK GOVT 271115		0.5	4,900	4,839	88,508	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115		1.5	4,800	5,179	94,727	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115		1.75	7,400	8,183	149,673	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115		3.0	9,650	10,825	198,000	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115		4.0	8,450	9,145	167,268	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115		4.5	12,350	20,580	376,409	2039/11/15
小計						1,074,589	
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	2,250	2,239	73,586	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725		1.75	4,950	4,875	160,200	2021/7/25
	2 POLAND 210425		2.0	750	747	24,546	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425		2.25	1,900	1,884	61,909	2022/4/25
	2.5 POLAND 230125		2.5	800	792	26,056	2023/1/25
	2.5 POLAND 260725		2.5	3,500	3,301	108,483	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725		2.5	2,800	2,603	85,565	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725		3.25	3,100	3,179	104,481	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725		3.25	2,650	2,672	87,814	2025/7/25
	4 POLAND 231025		4.0	2,800	2,971	97,643	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025		5.25	1,850	2,013	66,168	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025		5.5	3,150	3,363	110,512	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025		5.75	1,900	2,137	70,238	2021/10/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,846	93,535	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	900	1,109	36,470	2029/4/25
		POLAND 190425	—	200	196	6,462	2019/4/25
小	計					1,213,676	
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	2,500	2,469	217,774	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	2,950	2,911	256,752	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,700	2,556	225,395	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	2,950	2,991	263,758	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,419	213,312	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,632	232,139	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,200	1,186	104,638	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	471	41,571	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	950	869	76,686	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	3,200	3,314	292,264	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,250	2,328	205,285	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	650	644	56,867	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,150	1,236	108,996	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,150	2,384	210,222	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,850	1,946	171,624	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,350	1,586	139,909	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,200	3,702	326,462	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,400	1,453	128,182	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,982	262,989	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,500	2,775	244,763	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,150	2,455	216,486	2022/7/15
小	計					3,996,084	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	150	147	12,374	2021/10/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	1,100	1,103	92,508	2019/10/1
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	580	580	48,635	2022/4/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	400	404	33,900	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	552	46,313	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	1,150	1,171	98,236	2021/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	350	340	28,567	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	1,000	1,023	85,800	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	1,050	1,065	89,351	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,250	1,304	109,345	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	650	677	56,778	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	400	414	34,751	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	479	40,213	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	650	691	57,976	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	531	44,513	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	650	688	57,720	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	800	834	69,934	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	550	619	51,972	2033/9/1

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	
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	3.5	SINGAPORGGOVT 270301	570	634	53,189
小 計					1,112,084
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	18,800	21,223	195,466
	6.25	SOUTH AFRICA 360331	4,700	3,450	31,780
	6.5	SOUTH AFRICA 410228	15,500	11,210	103,247
	6.75	SOUTH AFRICA 210331	4,500	4,427	40,779
	7.0	SOUTH AFRICA 310228	18,000	15,338	141,270
	7.25	SOUTH AFRICA 200115	3,600	3,618	33,321
	7.75	SOUTH AFRICA 230228	8,200	8,226	75,770
	8.0	SOUTH AFRICA 300131	7,500	7,015	64,612
	8.25	SOUTH AFRICA 320331	3,800	3,552	32,720
	8.5	SOUTH AFRICA 370131	14,750	13,579	125,070
	8.75	SOUTH AFRICA 440131	6,100	5,644	51,987
	8.75	SOUTH AFRICA 480228	16,700	15,462	142,409
	8.875	SOUTH AFRIC 350228	5,500	5,278	48,614
	9.0	SOUTH AFRICA 400131	2,700	2,575	23,719
小 計					1,110,773
合 計					180,778,919

(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

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 180,778,919	% 97.6
コール・ローン等、その他	4,434,409	2.4
投資信託財産総額	185,213,328	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (182,378,259千円) の投資信託財産総額 (185,213,328千円) に対する比率は98.5%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=109.78円	1 カナダドル=88.70円	1 メキシコペソ=5.90円	1 ユーロ=136.17円
1 イギリスポンド=155.44円	1 スイスフラン=116.59円	1 スウェーデンクローネ=13.86円	1 ノルウェークローネ=14.18円
1 デンマーククローネ=18.29円	1 ポーランドズロチ=32.86円	1 オーストラリアドル=88.18円	1 シンガポールドル=83.83円
1 南アフリカランド=9.21円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	368,105,844,960
コール・ローン等	823,576,609
公社債(評価額)	180,778,919,604
未収入金	184,892,559,340
未収利息	1,455,651,132
前払費用	155,138,275
(B) 負債	184,582,002,926
未払金	184,487,595,027
未払解約金	94,407,109
未払利息	790
(C) 純資産総額(A-B)	183,523,842,034
元本	145,275,272,507
次期繰越損益金	38,248,569,527
(D) 受益権総口数	145,275,272,507口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,633円

<注記事項>

- ①期首元本額 73,688,743,763円
 期中追加設定元本額 97,465,330,579円
 期中一部解約元本額 25,878,801,835円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2633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)	46,341,881円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,610,745,039円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,597,265,004円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	119,081,792円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	496,057,048円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	4,118,676,123円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	60,833,226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)	103,635,957,023円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	13,834,981,578円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	230,951,434円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	237,914,737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)	5,705,741,471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)	2,120,300,689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)	188,835,718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)	5,269,608,944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)	1,980,800円
合計	145,275,272,507円

【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
 (2018年1月1日)

○損益の状況 (2017年1月27日～2018年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,747,103,547
受取利息	3,747,601,568
支払利息	△ 498,021
(B) 有価証券売買損益	△ 3,051,588,332
売買益	20,140,607,446
売買損	△23,192,195,778
(C) 保管費用等	△ 19,564,370
(D) 当期損益金(A+B+C)	675,950,845
(E) 前期繰越損益金	18,490,874,676
(F) 追加信託差損益金	26,029,163,427
(G) 解約差損益金	△ 6,947,419,421
(H) 計(D+E+F+G)	38,248,569,527
次期繰越損益金(H)	38,248,569,527

- (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。