

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2016年7月1日設定）	
運用方針	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。 実質組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。	
主要運用対象	ベビーフンド	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	<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3期（決算日：2019年1月28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28日に第3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)	標準価額			FTSE世界国債インデックス <small>(為替ヘッジあり)</small>		債券組入比率	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			
(設定日)	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	378.81	△4.6	96.8	—	22	
2期(2018年1月26日)	9,560	0	0.4	382.76	1.0	97.6	—	59	
3期(2019年1月28日)	9,557	0	△0.0	385.22	0.6	97.8	—	73	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018年1月26日	円 9,560	% —	382.76	% —	% 97.6	% —
1月末	9,521	△0.4	381.24	△0.4	96.8	—
2月末	9,481	△0.8	379.88	△0.8	96.0	—
3月末	9,604	0.5	385.14	0.6	98.2	—
4月末	9,510	△0.5	381.47	△0.3	97.2	—
5月末	9,494	△0.7	381.19	△0.4	96.4	—
6月末	9,522	△0.4	382.43	△0.1	98.9	—
7月末	9,473	△0.9	380.68	△0.5	98.1	—
8月末	9,481	△0.8	381.23	△0.4	98.3	—
9月末	9,415	△1.5	378.76	△1.0	98.1	—
10月末	9,386	△1.8	377.76	△1.3	97.1	—
11月末	9,412	△1.5	378.89	△1.0	99.2	—
12月末	9,537	△0.2	384.13	0.4	96.8	—
(期 末) 2019年1月28日	9,557	△0.0	385.22	0.6	97.8	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第3期：2018年1月27日～2019年1月28日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第3期首	9,560円
第3期末	9,557円
既払分配金	0円
騰落率	-0.0%

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

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

**基準価額の動き**

基準価額は期首に比べ横ばいとなりました。

**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 (0.6%) を0.6%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

米国の利上げ休止観測などを背景に、多くの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。

**下落要因**

イタリアの政局不安を受けて同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。  
信託報酬等の費用などが、基準価額の下落要因となりました。

第3期：2018年1月27日～2019年1月28日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

イタリアの政局不安を受けて同国の債券市況が下落した一方で、米国の利上げ休止観測などを背景に、多くの国の債券市況が上昇したことから、先進国の債券市況は、期首との比較では上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ eMAXIS 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FTSE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0.6%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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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

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

## (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 (2018年1月26日)		期末 (2019年1月28日)	
最終利回り	1.6%	最終利回り	1.8%
直接利回り	2.4%	直接利回り	2.5%
デュレーション	7.0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)

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.6\%$ 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。

### ▶ 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 $0.6\%$ の上昇となったため、乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

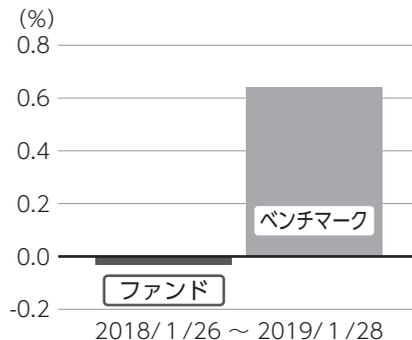
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ポートフォリオ要因

**主なマイナス要因：**評価時価差異要因\*

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

基準価額 (ベビーファンド) と  
ベンチマークの対比 (騰落率)



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第3期 2018年1月27日～2019年1月28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	354

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

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

## 今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

### ▶ eMAXIS 先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)

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

（2018年1月27日～2019年1月28日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	62	0.651	(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)	(0.293)	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)	(0.293)	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 )	(0.065)	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	0.015	(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 )	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	63	0.666	
期中の平均基準価額は、9,480円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

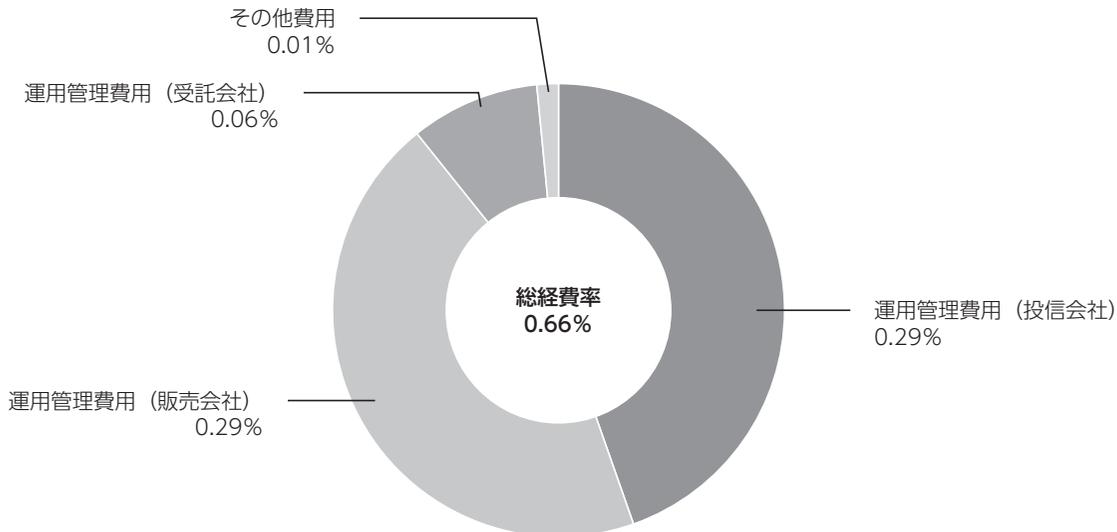
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

## （参考情報）

### ■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.66%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ○売買及び取引の状況

(2018年1月27日～2019年1月28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 31,333	千円 39,390	千口 20,143	千円 25,300

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年1月27日～2019年1月28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。

## &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	2,544,348	608,133	23.9	2,591,275	618,156	23.9
為替直物取引	76,217	13,580	17.8	29,203	4,604	15.8

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

(2018年1月27日～2019年1月28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 1	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

## ○組入資産の明細

(2019年1月28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 46,341	千口 57,531	千円 73,099

## ○投資信託財産の構成

(2019年1月28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 73,099	% 99.5
コール・ローン等、その他	380	0.5
投資信託財産総額	73,479	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（224,573,323千円）の投資信託財産総額（227,433,801千円）に対する比率は98.7%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=109.35円	1 カナダドル=82.73円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=124.76円
1 イギリスポンド=144.35円	1 スウェーデンクローネ=12.09円	1 ノルウェークローネ=12.84円	1 デンマーククローネ=16.71円
1 ポーランドズロチ=29.08円	1 オーストラリアドル=78.56円	1 シンガポールドル=80.85円	1 南アフリカランド=8.04円

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年1月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	73,479,996
コール・ローン等	380,225
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	73,099,771
(B) 負債	242,551
未払解約金	19,993
未払信託報酬	221,288
その他未払費用	1,270
(C) 純資産総額(A-B)	73,237,445
元本	76,629,252
次期繰越損益金	△ 3,391,807
(D) 受益権総口数	76,629,252口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,557円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 61,817,761円  
 期中追加設定元本額 32,258,507円  
 期中一部解約元本額 17,447,016円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9557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3,391,807円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2018年1月27日～ 2019年1月28日
費用控除後の配当等収益額	1,182,289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	1,231,566円
分配準備積立金額	305,220円
当ファンドの分配対象収益額	2,719,075円
1万口当たり収益分配対象額	354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（2018年1月27日～2019年1月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 219
支払利息	△ 219
(B) 有価証券売買損益	588,794
売買益	763,706
売買損	△ 174,912
(C) 信託報酬等	△ 428,794
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	159,781
(E) 前期繰越損益金	△ 262,615
(F) 追加信託差損益金	△3,288,973
(配当等相当額)	( 1,193,398)
(売買損益相当額)	(△4,482,371)
(G) 計(D+E+F)	△3,391,807
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△3,391,807
追加信託差損益金	△3,288,973
(配当等相当額)	( 1,231,566)
(売買損益相当額)	(△4,520,539)
分配準備積立金	1,487,509
繰越損益金	△1,590,343

- (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商品性として無手数料とするため、販売手数料に係る記載の削除および記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2018年4月26日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2018年4月26日)
- ③本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。
- ④2014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10期》決算日2019年1月28日

[計算期間：2018年1月27日～2019年1月28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28日に第10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10期の運用状況をご報告申し上げます。

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (係(日本、円ヘッジ・円ベース))		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018年1月26日	円 12,633	% —	382.76	% —	98.5	—
1月末	12,582	△0.4	381.24	△0.4	97.5	—
2月末	12,535	△0.8	379.88	△0.8	96.4	—
3月末	12,706	0.6	385.14	0.6	98.7	—
4月末	12,585	△0.4	381.47	△0.3	100.4	—
5月末	12,572	△0.5	381.19	△0.4	96.6	—
6月末	12,614	△0.2	382.43	△0.1	100.1	—
7月末	12,556	△0.6	380.68	△0.5	99.5	—
8月末	12,574	△0.5	381.23	△0.4	98.6	—
9月末	12,491	△1.1	378.76	△1.0	101.4	—
10月末	12,458	△1.4	377.76	△1.3	97.3	—
11月末	12,499	△1.1	378.89	△1.0	99.4	—
12月末	12,672	0.3	384.13	0.4	97.0	—
(期 末) 2019年1月28日	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—

(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

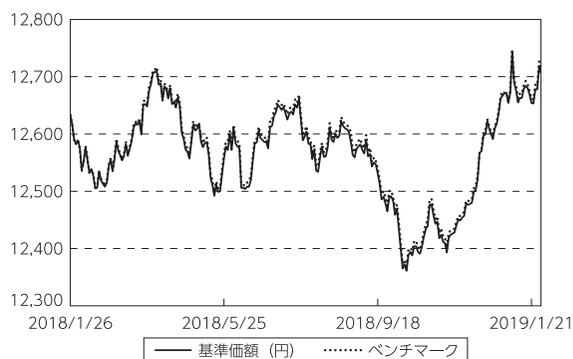
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.6%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(0.6%)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

## ◎債券市況

- ・イタリアの政局不安を受けて同国の債券市況が下落した一方で、米国の利上げ休止観測などを背景に、多くの国の債券市況が上昇したことから、先進国の債券市況は、期首との比較では上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは0.6%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ポートフォリオ要因

（主なマイナス要因）

- ・評価時価差異要因<sup>※</sup>

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

## ○今後の運用方針

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

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年1月27日～2019年1月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	1	0.011	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( そ の 他 )	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.000)	
合 計	1	0.011	
期中の平均基準価額は、12,565円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2018年1月27日～2019年1月28日)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 484,528	千アメリカドル 232,974
	カナダ	千カナダドル 21,362	千カナダドル 11,909
	メキシコ	千メキシコペソ 123,954	千メキシコペソ 43,755
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 49,889	31,648
	イタリア	国債証券 69,817	37,240
	フランス	国債証券 73,188	31,971
	オランダ	国債証券 11,157	4,838
	スペイン	国債証券 42,072	18,887
	ベルギー	国債証券 15,064	6,319
国	オーストリア	国債証券 9,818	5,182
	フィンランド	国債証券 3,933	1,054
	アイルランド	国債証券 4,596	1,841
	イギリス	千イギリスポンド 42,527	千イギリスポンド 22,685
	スイス	千スイスフラン 438	千スイスフラン 3,135
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,735	千スウェーデンクローネ 10,358
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 12,700	千ノルウェークローネ 10,731
	デンマーク	千デンマーククローネ 24,673	千デンマーククローネ 12,173
	ポーランド	千ポーランドズロチ 16,558	千ポーランドズロチ 6,731
	オーストラリア	千オーストラリアドル 20,504	千オーストラリアドル 7,822
	シンガポール	千シンガポールドル 4,929	千シンガポールドル 3,777
	南アフリカ	千南アフリカランド 51,991	千南アフリカランド 2,865

(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

(2018年1月27日～2019年1月28日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	2,544,348	608,133	23.9	2,591,275	618,156	23.9
為替直物取引	76,217	13,580	17.8	29,203	4,604	15.8

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

(2019年1月28日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 946,310	千アメリカドル 942,863	千円 103,102,138	% 45.5	% —	% 19.1	% 18.3	% 8.1
カナダ	千カナダドル 50,250	千カナダドル 54,146	4,479,549	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 312,500	千メキシコペソ 304,508	1,753,966	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	100,310	118,740	14,814,076	6.5	—	3.9	1.8	0.8
イタリア	146,470	159,491	19,898,113	8.8	—	5.1	2.9	0.7
フランス	154,440	180,557	22,526,353	9.9	—	6.5	2.6	0.8
オランダ	31,150	36,897	4,603,363	2.0	—	1.3	0.5	0.2
スペイン	88,270	102,946	12,843,593	5.7	—	3.8	1.2	0.7
ベルギー	36,100	43,266	5,397,912	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	22,010	26,194	3,267,963	1.4	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	10,690	11,480	1,432,331	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	12,180	13,545	1,689,935	0.7	—	0.5	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 85,690	千イギリスポンド 104,690	15,112,016	6.7	—	5.1	1.0	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 62,050	千スウェーデンクローネ 69,381	838,816	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 38,900	千ノルウェークローネ 40,234	516,606	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 57,250	千デンマーククローネ 72,660	1,214,162	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 45,450	千ポーランドズロチ 47,466	1,380,334	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 55,200	千オーストラリアドル 59,918	4,707,199	2.1	—	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 13,820	千シンガポールドル 14,303	1,156,406	0.5	—	0.3	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 182,650	千南アフリカランド 165,939	1,334,150	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	222,068,990	98.0	—	53.0	31.7	13.3

(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					
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,775	194,177	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	3,400	3,338	365,022	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,007	328,868	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,461	1,690,687	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,507	274,248	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,697	294,985	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	674	73,716	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,900	1,874	204,989	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	4,500	4,434	484,924	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	5,400	5,249	574,066	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	2,990	327,014	2021/10/31
	1.375 T-NOTE 200115	1.375	16,200	16,012	1,750,918	2020/1/15
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	3,600	3,556	388,877	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200215	1.375	2,700	2,665	291,496	2020/2/15
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,579	172,663	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	9,100	8,972	981,091	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	4,100	4,037	441,469	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,600	1,574	172,130	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,274	139,400	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	15,200	14,891	1,628,358	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	4,200	4,111	449,546	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,561	170,763	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	7,000	6,814	745,177	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,431	265,857	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	3,892	425,673	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	3,700	3,506	383,448	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	6,627	724,725	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	4,500	4,436	485,135	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	4,700	4,632	506,536	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,900	2,852	311,974	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	775	84,780	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	10,000	9,580	1,047,624	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,412	701,164	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	6,450	5,927	648,166	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,586	173,435	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	11,500	11,378	1,244,212	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	5,500	5,424	593,155	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,300	1,280	140,067	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,473	161,116	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,129	888,974	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	10,350	9,993	1,092,779	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,545	825,134	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,707	514,759	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,411	701,106	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	12,600	11,752	1,285,130	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	8,560	936,070	2026/5/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	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	1.75	T-NOTE 201031	1.75	3,600	3,546	387,785	2020/10/31
		1.75	T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,673	182,990	2020/12/31
		1.75	T-NOTE 211130	1.75	6,600	6,450	705,358	2021/11/30
		1.75	T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,440	1,360,337	2022/ 2 /28
		1.75	T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,365	149,262	2022/ 3 /31
		1.75	T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,021	330,377	2022/ 4 /30
		1.75	T-NOTE 220515	1.75	9,200	8,960	979,808	2022/ 5 /15
		1.75	T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,699	404,589	2022/ 5 /31
		1.75	T-NOTE 220930	1.75	4,900	4,758	520,368	2022/ 9 /30
		1.75	T-NOTE 230515	1.75	2,400	2,318	253,480	2023/ 5 /15
		1.875	T-NOTE 200630	1.875	3,250	3,216	351,680	2020/ 6 /30
		1.875	T-NOTE 201215	1.875	6,000	5,920	647,360	2020/12/15
		1.875	T-NOTE 211130	1.875	2,700	2,647	289,547	2021/11/30
		1.875	T-NOTE 220131	1.875	2,000	1,959	214,240	2022/ 1 /31
		1.875	T-NOTE 220228	1.875	2,500	2,448	267,693	2022/ 2 /28
		1.875	T-NOTE 220430	1.875	4,000	3,912	427,797	2022/ 4 /30
		1.875	T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,617	395,523	2022/ 5 /31
		1.875	T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,659	400,195	2022/ 8 /31
		1.875	T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,141	671,574	2022/10/31
		2.0	T-NOTE 200930	2.0	7,500	7,424	811,859	2020/ 9 /30
		2.0	T-NOTE 201130	2.0	350	346	37,850	2020/11/30
		2.0	T-NOTE 210115	2.0	5,200	5,139	562,023	2021/ 1 /15
		2.0	T-NOTE 210228	2.0	1,800	1,778	194,431	2021/ 2 /28
		2.0	T-NOTE 210831	2.0	1,000	985	107,722	2021/ 8 /31
		2.0	T-NOTE 211031	2.0	3,800	3,741	409,134	2021/10/31
		2.0	T-NOTE 211231	2.0	10,000	9,842	1,076,243	2021/12/31
		2.0	T-NOTE 220215	2.0	2,900	2,851	311,813	2022/ 2 /15
		2.0	T-NOTE 221130	2.0	8,200	8,026	877,685	2022/11/30
		2.0	T-NOTE 230215	2.0	13,900	13,588	1,485,884	2023/ 2 /15
		2.0	T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,426	265,301	2024/ 4 /30
		2.0	T-NOTE 240531	2.0	2,700	2,618	286,364	2024/ 5 /31
		2.0	T-NOTE 250215	2.0	15,000	14,463	1,581,559	2025/ 2 /15
		2.0	T-NOTE 250815	2.0	12,300	11,814	1,291,940	2025/ 8 /15
		2.0	T-NOTE 261115	2.0	7,300	6,941	759,090	2026/11/15
		2.125	T-NOTE 200831	2.125	1,000	992	108,504	2020/ 8 /31
		2.125	T-NOTE 210131	2.125	700	693	75,821	2021/ 1 /31
		2.125	T-NOTE 210815	2.125	6,400	6,325	691,720	2021/ 8 /15
		2.125	T-NOTE 210930	2.125	1,000	988	108,068	2021/ 9 /30
		2.125	T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,653	399,537	2021/12/31
		2.125	T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,257	684,228	2022/ 6 /30
		2.125	T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,536	824,102	2023/11/30
		2.125	T-NOTE 240229	2.125	2,700	2,639	288,625	2024/ 2 /29
		2.125	T-NOTE 240331	2.125	5,600	5,471	598,294	2024/ 3 /31
		2.125	T-NOTE 241130	2.125	3,500	3,404	372,259	2024/11/30
		2.125	T-NOTE 250515	2.125	7,650	7,416	811,039	2025/ 5 /15
		2.25	T-BOND 460815	2.25	2,850	2,417	264,316	2046/ 8 /15
		2.25	T-NOTE 210215	2.25	15,000	14,893	1,628,652	2021/ 2 /15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,786	195,399	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,587	173,634	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	694	75,911	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	300	295	32,287	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,082	446,463	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	12,000	11,754	1,285,340	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 241231	2.25	4,100	4,014	438,983	2024/12/31
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	5,000	4,834	528,681	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	5,000	4,820	527,101	2027/8/15
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	696	76,216	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 210315	2.375	14,000	13,938	1,524,142	2021/3/15
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	11,200	11,060	1,209,411	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	9,800	9,558	1,045,174	2027/5/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	4,543	496,780	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	3,500	3,137	343,077	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	4,700	514,032	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 200630	2.5	2,600	2,595	283,854	2020/6/30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	10,950	10,908	1,192,798	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,050	989,720	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 200731	2.625	3,700	3,699	404,579	2020/7/31
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,399	153,084	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 200831	2.625	7,000	7,000	765,479	2020/8/31
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,100	5,100	557,706	2020/11/15
		2.625 T-NOTE 210515	2.625	15,500	15,507	1,695,785	2021/5/15
		2.625 T-NOTE 210615	2.625	3,000	3,002	328,370	2021/6/15
		2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,609	613,364	2023/6/30
		2.625 T-NOTE 250331	2.625	19,800	19,781	2,163,100	2025/3/31
		2.75 T-BOND 420815	2.75	7,250	6,897	754,201	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	2,000	1,900	207,833	2042/11/15
		2.75 T-BOND 471115	2.75	6,100	5,727	626,335	2047/11/15
		2.75 T-NOTE 210815	2.75	18,000	18,071	1,976,065	2021/8/15
		2.75 T-NOTE 230430	2.75	2,000	2,013	220,135	2023/4/30
		2.75 T-NOTE 230531	2.75	6,000	6,041	660,661	2023/5/31
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,800	4,834	528,652	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,000	3,021	330,407	2024/2/15
		2.75 T-NOTE 250630	2.75	4,500	4,526	494,996	2025/6/30
		2.75 T-NOTE 280215	2.75	5,500	5,504	601,894	2028/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	7,400	7,179	785,040	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	2,500	2,418	264,511	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	6,600	6,373	696,957	2046/11/15
2.875 T-NOTE 201031	2.875	3,000	3,013	329,498	2020/10/31		
2.875 T-NOTE 211015	2.875	11,500	11,584	1,266,809	2021/10/15		
2.875 T-NOTE 211115	2.875	8,000	8,062	881,668	2021/11/15		
2.875 T-NOTE 231031	2.875	7,000	7,088	775,077	2023/10/31		
2.875 T-NOTE 250430	2.875	22,200	22,489	2,459,242	2025/4/30		
2.875 T-NOTE 280515	2.875	7,400	7,477	817,661	2028/5/15		
2.875 T-NOTE 280815	2.875	4,400	4,446	486,176	2028/8/15		

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	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	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,122	560,116	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	10,350	10,258	1,121,781	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	4,500	4,457	487,461	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,050	3,021	330,442	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	5,350	5,294	578,989	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	6,700	6,610	722,857	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	7,200	7,104	776,924	2048/8/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	4,900	4,984	545,024	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	5,650	5,747	628,494	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	3,649	399,042	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	6,600	6,689	731,520	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,300	3,336	364,830	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,315	143,837	2021/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	2,000	2,063	225,688	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,700	3,913	427,922	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,200	3,395	371,297	2048/11/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,500	2,527	276,375	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,400	2,640	288,745	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,900	5,394	589,940	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	3,130	3,162	345,835	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,200	2,244	245,456	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,120	122,531	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	4,600	5,162	564,510	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	99,795	2040/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	960	105,037	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	2,040	2,484	271,644	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,350	1,644	179,857	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,501	273,501	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,344	147,039	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,460	1,788	195,535	2036/2/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,600	3,274	358,030	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	4,050	5,196	568,185	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,000	1,305	142,735	2037/5/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	1,900	2,311	252,734	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,580	1,994	218,071	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,425	265,276	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	17,050	21,534	2,354,846	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,500	2,888	315,833	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,300	1,733	189,565	2030/5/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,488	162,784	2021/11/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	6,600	7,206	788,045	2020/8/15
小 計					103,102,138	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,150	95,176	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	3,050	2,997	247,953	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,900	1,856	153,595	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	145	12,060	2021/9/1

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,800	1,744	144,361	2022/9/1	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,390	115,048	2027/6/1	
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	5,300	5,279	436,807	2020/3/1	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,197	264,516	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	850	824	68,240	2026/6/1	
		1.75 CAN GOVT 200501	1.75	1,600	1,597	132,190	2020/5/1	
		1.75 CAN GOVT 200801	1.75	2,000	1,996	165,178	2020/8/1	
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	1,000	994	82,268	2023/3/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,503	124,399	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	500	478	39,547	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	2,850	2,906	240,453	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,100	2,163	179,002	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	3,000	3,083	255,121	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,550	1,739	143,888	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	650	761	62,978	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,100	3,197	264,508	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,250	1,276	105,645	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	2,050	2,585	213,912	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,650	2,171	179,649	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,300	1,856	153,557	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	2,350	3,166	261,959	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,250	1,814	150,111	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,265	187,416	2027/6/1	
小	計					4,479,549		
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	46,750	50,506	290,916	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	10,089	58,116	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	18,417	106,082	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	39,950	38,511	221,823	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	33,261	191,584	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	29,750	28,153	162,166	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	19,300	18,103	104,277	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	9,975	57,457	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	19,100	17,259	99,414	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	33,300	33,204	191,255	2020/6/11	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	9,500	9,420	54,264	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	10,100	9,335	53,775	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	10,400	10,423	60,038	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	18,200	17,845	102,791	2038/11/18	
小	計					1,753,966		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	3,350	3,369	420,352	2026/8/15
			0 OBL 200417	—	1,700	1,712	213,670	2020/4/17
			0 OBL 210409	—	2,800	2,836	353,824	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	3,500	3,552	443,265	2021/10/8
			0 OBL 220408	—	800	813	101,470	2022/4/8
			0 OBL 231013	—	1,500	1,525	190,338	2023/10/13

## 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	0.25 BUND 270215	0.25	3,600	3,680	459,139	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	2,000	2,020	252,112	2028/8/15
		0.25 OBL 201016	0.25	3,250	3,297	411,455	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	3,650	3,811	475,564	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,950	3,081	384,415	2026/2/15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,250	3,373	420,823	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	1,600	1,714	213,893	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,700	2,910	363,111	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,100	2,359	294,430	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	2,800	3,002	374,612	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	6,800	7,339	915,736	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	3,700	4,007	499,986	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,900	3,179	396,703	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,750	2,964	369,805	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,156	269,076	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,400	2,580	321,990	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	998	124,608	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	732	91,352	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	250	268	33,495	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	4,300	4,561	569,137	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	3,150	4,455	555,806	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,780	2,557	319,074	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	3,850	4,050	505,286	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	400	414	51,742	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,968	245,552	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	3,400	5,321	663,903	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	3,000	4,787	597,295	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	720	1,227	153,175	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	3,019	376,756	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,050	3,373	420,882	2034/7/4
4.75 BUND 400704	4.75	1,710	3,140	391,828	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	2,050	3,318	414,038	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	1,700	2,550	318,176	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,327	165,630	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	950	1,574	196,471	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	2,450	3,799	474,079	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	1,700	1,682	209,920	2021/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	396	49,429	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,950	1,946	242,847	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	5,000	5,029	627,532	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	289	36,118	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,106	138,104	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,700	2,662	332,131	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,214	151,545	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	4,850	4,907	612,263	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	4,250	4,295	535,967	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,762	219,936	2024/11/15

## 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	
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,580	1,537	191,788	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,100	2,026	252,788	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,650	1,438	179,494	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,100	2,116	264,032	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,700	2,693	336,016	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	5,450	5,260	656,246	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,050	1,023	127,641	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	2,600	2,699	336,740	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,500	1,482	185,000	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,200	1,069	133,479	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,350	2,206	275,241	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,000	3,112	388,284	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,100	1,128	140,768	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,250	2,001	249,759	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	600	608	75,972	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	750	640	79,891	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,900	2,771	345,830	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,050	255,803	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,300	1,294	161,469	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,500	2,671	333,303	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	7,450	7,978	995,438	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,300	2,472	308,484	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,314	288,782	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	3,350	3,547	442,635	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,250	2,501	312,071	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,180	147,242	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,300	2,401	299,570	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	2,934	366,108	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,700	1,931	240,937	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	4,800	5,540	691,289	2026/3/1
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,600	1,763	219,957	2021/9/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,430	3,927	489,964	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	712	88,922	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	2,987	372,668	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,096	511,093	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	7,150	8,406	1,048,810	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	3,575	446,050	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,940	2,400	299,465	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,600	3,204	399,765	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,900	6,044	754,142	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	5,300	6,123	763,978	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,450	3,201	399,366	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,820	5,041	628,981	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,050	4,024	502,083	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	745	92,966	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,950	5,306	661,985	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 0. A. T 200225	—	1,500	1,508	188,209	2020/2/25

## 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	0 O.A.T 200525	—	2,950	2,970	370,656	2020/5/25
		0 O.A.T 210225	—	7,900	7,977	995,260	2021/2/25
		0 O.A.T 210525	—	4,800	4,851	605,256	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	3,400	3,438	429,042	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	—	4,900	4,943	616,786	2023/3/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	4,050	4,106	512,340	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	5,200	5,175	645,707	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	4,100	4,206	524,818	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,300	2,343	292,427	2026/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	1,850	1,886	235,375	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	1,000	1,014	126,573	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	2,000	2,114	263,810	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	3,700	3,884	484,624	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	5,150	5,231	652,693	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	3,850	4,153	518,209	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	4,400	4,776	595,965	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,400	2,644	329,880	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	1,370	1,489	185,873	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,000	999	124,697	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	3,350	3,717	463,811	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	4,600	5,040	628,872	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	14,200	15,954	1,990,493	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	3,900	4,105	512,210	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	4,850	5,785	721,770	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	5,600	6,727	839,325	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,329	415,369	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	4,050	4,461	556,613	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	2,850	3,988	497,601	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,100	2,205	275,097	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	4,500	5,574	695,439	2026/4/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,200	1,314	163,943	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,680	4,010	500,409	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,620	2,666	332,685	2055/4/25
4 O.A.T 600425	4.0	1,700	2,871	358,239	2060/4/25		
4.25 O.A.T 231025	4.25	3,700	4,480	558,933	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	4,300	6,975	870,290	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	3,100	4,840	603,882	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	5,100	7,593	947,418	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	4,100	6,694	835,213	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	4,470	6,235	777,933	2025/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,650	2,265	282,584	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	900	913	113,937	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	2,600	2,622	327,193	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,550	2,600	324,492	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	900	929	116,012	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,600	2,722	339,661	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,650	1,719	214,585	2028/7/15

## 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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,950	2,131	265,921	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,200	2,463	307,295	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,750	1,915	238,953	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,700	2,142	267,318	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,000	2,960	369,320	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,462	307,283	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,400	1,484	185,213	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,350	1,574	196,480	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,500	2,458	306,775	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,950	3,057	381,411	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,500	2,211	275,866	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	526	65,641	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,950	1,980	247,082	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,500	1,524	190,210	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	2,800	2,866	357,618	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	2,100	2,145	267,662	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,900	1,955	243,980	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	5,200	5,291	660,143	2020/1/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	100	101	12,664	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,450	4,581	571,560	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,450	3,578	446,463	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,300	2,442	304,776	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	4,800	5,176	645,769	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,150	2,260	282,018	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,900	4,267	532,398	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,000	2,151	268,413	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,450	1,538	191,922	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,900	3,270	407,977	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,070	2,303	287,445	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,200	1,440	179,716	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,850	2,174	271,317	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,530	2,666	332,678	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,430	3,274	408,581	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,550	4,239	528,873	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,056	256,529	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,650	3,853	480,793	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,929	365,477	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	2,000	2,180	271,999	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,050	3,042	379,600	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,803	474,483	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,700	2,650	330,704	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	3,250	3,939	491,546	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,600	4,062	506,861	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,550	3,836	478,700	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,750	3,241	404,443	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,200	1,638	204,410	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,100	4,478	558,768	2029/1/31		

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	400	405	50,616	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,704	337,406	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,383	172,643	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,500	1,522	189,945	2028/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,750	1,835	228,939	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,210	151,055	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	255	31,822	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,300	1,292	161,304	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,400	1,527	190,571	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	430	457	57,093	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,663	207,521	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	600	663	82,834	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,900	3,305	412,452	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,010	126,091	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	2,050	2,196	274,094	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,250	1,847	230,442	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,500	1,709	213,325	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,500	2,066	257,838	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	2,100	2,365	295,065	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,103	262,486	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,850	2,836	353,920	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,273	158,853	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,390	3,739	466,483	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,700	3,888	485,101	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	600	605	75,572	2023/7/15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	900	914	114,109	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	950	988	123,281	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,450	1,494	186,441	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,200	1,291	161,106	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	650	688	85,902	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	242	30,215	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,100	1,208	150,775	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,700	1,858	231,909	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	290	348	43,536	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,050	1,277	159,436	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	850	1,222	152,541	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	2,750	3,144	392,367	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,769	220,724	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	750	847	105,780	2022/4/20
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,161	144,908	2062/1/26		
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,370	1,458	181,990	2020/7/15		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,550	2,374	296,283	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,870	233,320	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	950	1,424	177,758	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	505	63,127	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	656	81,847	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	1,300	1,318	164,534	2020/9/15

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			
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	717	89,575	2026/4/15		
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	500	507	63,345	2027/9/15		
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	200	201	25,095	2028/9/15		
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	600	608	75,864	2031/4/15		
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	1,700	1,792	223,593	2025/9/15		
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	600	627	78,245	2034/4/15		
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	591	73,740	2023/4/15		
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	589	73,553	2022/9/15		
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	550	611	76,250	2024/4/15		
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	550	745	93,008	2042/7/4		
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	658	82,195	2028/7/4		
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	600	628	78,438	2020/4/15		
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	217	27,163	2021/4/15		
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	502	62,749	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	1,200	1,239	154,648	2022/3/15		
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	700	709	88,478	2028/5/15		
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,450	1,507	188,025	2026/5/15		
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	600	601	75,072	2033/5/15		
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	650	674	84,176	2037/5/15		
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,077	134,405	2045/2/18		
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,190	1,368	170,695	2030/5/15		
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	1,950	2,281	284,682	2024/3/18		
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	933	116,461	2023/3/20		
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	626	78,127	2020/4/18		
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	750	820	102,382	2020/10/18		
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,300	1,705	212,777	2025/3/13		
		小 計						86,473,643	
		イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	3,380	3,339	482,031	2022/7/22			
	1.25 GILT 270722	1.25	1,880	1,885	272,202	2027/7/22			
	1.5 GILT 210122	1.5	4,100	4,155	599,862	2021/1/22			
	1.5 GILT 260722	1.5	5,300	5,447	786,377	2026/7/22			
	1.5 GILT 470722	1.5	2,900	2,713	391,698	2047/7/22			
	1.625 GILT 711022	1.625	2,250	2,222	320,836	2071/10/22			
	1.75 GILT 220907	1.75	3,350	3,453	498,582	2022/9/7			
	1.75 GILT 370907	1.75	1,970	1,979	285,742	2037/9/7			
	1.75 GILT 570722	1.75	2,450	2,484	358,686	2057/7/22			
	2 GILT 200722	2.0	2,850	2,900	418,687	2020/7/22			
	2 GILT 250907	2.0	4,100	4,349	627,877	2025/9/7			
	2.25 GILT 230907	2.25	3,650	3,866	558,110	2023/9/7			
	2.5 GILT 650722	2.5	1,150	1,454	209,989	2065/7/22			
	2.75 GILT 240907	2.75	1,700	1,862	268,794	2024/9/7			
	3.25 GILT 440122	3.25	4,200	5,428	783,616	2044/1/22			
	3.5 GILT 450122	3.5	1,850	2,504	361,472	2045/1/22			
	3.5 GILT 680722	3.5	2,250	3,619	522,537	2068/7/22			
	3.75 GILT 200907	3.75	1,900	1,989	287,128	2020/9/7			
	3.75 GILT 210907	3.75	1,650	1,774	256,206	2021/9/7			

## 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	3.75 GILT 520722	3.75	870	1,315	189,830	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	1,250	1,371	197,979	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	1,050	1,767	255,201	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	850	1,067	154,071	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	2,000	2,662	384,336	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	2,350	3,256	470,008	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,000	1,437	207,484	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	890	1,294	186,850	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,692	244,276	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	800	1,270	183,439	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	4,480	7,585	1,094,985	2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	2,150	3,009	434,363	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	3,950	6,048	873,079	2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	1,800	2,456	354,536	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	2,000	3,026	436,935	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	2,350	2,901	418,896	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	1,920	2,756	397,962	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	2,000	2,336	337,337	2021/6/7
小計					15,112,016	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	5,600	5,771	69,778	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,500	4,575	55,323	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,495	78,532	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,688	153,406	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,700	10,009	121,009	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	11,550	12,997	157,138	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,100	7,324	88,558	2039/3/30
	5 SWD GOVT 201201	5.0	8,650	9,517	115,070	2020/12/1
小計					838,816	
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	4,379	56,231	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	4,800	4,868	62,515	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,281	54,970	2027/2/17
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,449	95,648	2023/5/24
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	3,050	3,119	40,054	2028/4/26
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,950	5,337	68,536	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	10,200	10,798	138,649	2021/5/25
小計					516,606	
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	0.25 DMK GOVT 201115	0.25	2,200	2,233	37,315	2020/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,700	6,916	115,574	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,800	147,057	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	15,400	17,331	289,602	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,607	177,258	2021/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,200	26,771	447,354	2039/11/15
小計					1,214,162	

## 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			
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	1.5 POLAND 200425	1.5	2,250	2,256	65,615	2020/4/25	
	1.75 POLAND 210725	1.75	5,750	5,786	168,262	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	750	759	22,084	2021/4/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	5,400	5,485	159,513	2022/4/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	800	817	23,770	2023/1/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,472	100,968	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	4,500	4,426	128,718	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,681	107,051	2028/4/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,850	2,985	86,810	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,502	130,946	2023/10/25	
	5.25 POLAND 201025	5.25	2,000	2,133	62,055	2020/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	5,900	6,555	190,621	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,838	82,553	2022/9/23	
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,766	51,361	2029/4/25	
小計					1,380,334		
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	2,600	2,597	204,044	2020/11/21	
	2 AUST GOVT 211221	2.0	2,950	2,973	233,617	2021/12/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	3,800	3,816	299,809	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	800	820	64,473	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,506	196,926	2024/4/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,773	217,870	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	3,750	3,928	308,610	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,350	1,418	111,402	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,000	1,039	81,629	2035/6/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,600	1,691	132,898	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	5,950	6,400	502,794	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,300	2,517	197,766	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,300	1,435	112,810	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,250	1,475	115,907	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,250	3,729	293,017	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,950	3,041	238,975	2020/4/15	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,400	3,023	237,524	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,500	4,192	329,379	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,994	235,254	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	3,900	4,248	333,782	2021/5/15	
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,293	258,703	2022/7/15	
小計					4,707,199		
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	11,891	2021/10/1	
	1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	650	644	52,132	2022/4/1	
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	500	500	40,433	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	549	44,400	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	1,150	1,156	93,498	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	650	625	50,571	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	1,000	1,015	82,111	2025/6/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,400	1,440	116,500	2023/7/1	

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	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	1,000	1,021	82,547	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	650	663	53,665	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	476	38,529	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	844	68,302	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	650	681	55,064	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	1,200	1,245	100,716	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	500	509	41,212	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	900	1,000	80,860	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	1,620	1,780	143,969	2027/3/1
小 計					1,156,406	
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	25,900	28,469	228,893	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,405	27,379	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	22,900	16,248	130,639	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,800	5,764	46,347	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	18,000	14,989	120,517	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	3,300	3,329	26,768	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,200	8,169	65,681	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	15,200	13,939	112,074	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,800	7,107	57,145	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	22,250	20,061	161,290	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	11,100	10,050	80,807	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	23,200	20,998	168,826	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	6,100	5,738	46,137	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	8,200	7,666	61,640	2040/1/31
小 計					1,334,150	
合 計					222,068,990	

(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

(2019年1月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 222,068,990	% 97.6
コール・ローン等、その他	5,364,811	2.4
投資信託財産総額	227,433,801	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (224,573,323千円) の投資信託財産総額 (227,433,801千円) に対する比率は98.7%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=109.35円	1 カナダドル=82.73円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=124.76円
1 イギリスポンド=144.35円	1 スウェーデンクローネ=12.09円	1 ノルウェークローネ=12.84円	1 デンマーククローネ=16.71円
1 ポーランドズロチ=29.08円	1 オーストラリアドル=78.56円	1 シンガポールドル=80.85円	1 南アフリカランド=8.04円

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年1月28日現在)

項目	当期末
(A) 資産	450,657,524,848
コール・ローン等	1,065,145,975
公社債(評価額)	222,068,990,913
未収入金	225,546,939,692
未収利息	1,849,785,126
前払費用	126,663,142
(B) 負債	224,000,078,045
未払金	223,971,306,600
未払解約金	28,769,706
未払利息	1,025
その他未払費用	714
(C) 純資産総額(A-B)	226,657,446,803
元本	178,385,096,188
次期繰越損益金	48,272,350,615
(D) 受益権総口数	178,385,096,188口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,706円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 145,275,272,507円  
期中追加設定元本額 50,821,549,084円  
期中一部解約元本額 17,711,725,403円  
また、1口当たり純資産額は、期末1.2706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)	57,531,695円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	6,037,311,019円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	6,203,831,017円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	2,384,631,393円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,159,798,190円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	4,083,920,481円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	102,174,440円
MUKAM 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)	116,397,259,422円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	12,094,914,056円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	91,147,652円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	98,140,358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)	8,106,536,191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)	2,962,293,262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)	980,877,774円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,776,230,084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)	133,519,388円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	138,397,042円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,576,582,724円
合計	178,385,096,188円

## 【お知らせ】

- ①使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2018年2月8日)
- ②本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、FTSE債券インデックスの名称に変更しています。

## ○損益の状況 (2018年1月27日～2019年1月28日)

項目	当期
(A) 配当等収益	5,176,271,869
受取利息	5,176,745,517
支払利息	△ 473,648
(B) 有価証券売買損益	△ 3,687,479,187
売買益	28,002,105,049
売買損	△31,689,584,236
(C) 保管費用等	△ 23,487,755
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,465,304,927
(E) 前期繰越損益金	38,248,569,527
(F) 追加信託差損益金	13,095,544,260
(G) 解約差損益金	△ 4,537,068,099
(H) 計(D+E+F+G)	48,272,350,615
次期繰越損益金(H)	48,272,350,615

- (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。