

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4期（決算日：2020年1月27日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、去る1月27日に第4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 (為替ヘッジあり)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円	
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
3期(2019年1月28日)	9,557	0	△0.0	0.6	385.22	0.6	97.8	—	73
4期(2020年1月27日)	10,106	0	5.7	6.4	409.73	6.4	97.6	—	181

(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		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年1月28日	円 9,557	% —	385.22	% —	% 97.8	% —
1月末	9,573	0.2	385.88	0.2	97.7	—
2月末	9,559	0.0	385.50	0.1	98.5	—
3月末	9,734	1.9	392.62	1.9	98.0	—
4月末	9,664	1.1	389.98	1.2	97.9	—
5月末	9,798	2.5	395.72	2.7	94.9	—
6月末	9,951	4.1	401.98	4.4	97.2	—
7月末	9,989	4.5	403.79	4.8	96.8	—
8月末	10,293	7.7	416.34	8.1	95.5	—
9月末	10,215	6.9	413.28	7.3	98.3	—
10月末	10,086	5.5	408.17	6.0	97.7	—
11月末	10,075	5.4	407.93	5.9	98.2	—
12月末	10,008	4.7	405.42	5.2	98.4	—
(期 末) 2020年1月27日	10,106	5.7	409.73	6.4	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

第4期：2019年1月29日～2020年1月27日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第4期首	9,557円
第4期末	10,106円
既払分配金	0円
騰落率	5.7%

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

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

### 基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.7%の上昇となりました。

### ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（6.4%）を0.7%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

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

第4期：2019年1月29日～2020年1月27日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**先進国の債券市況は上昇しました。**

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

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ eMAXIS 先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）

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

### ▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザー ファンド

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

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

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

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

### ▶ eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）

ベンチマークとの乖離は△0.7%程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.6%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△0.1%程度でした。

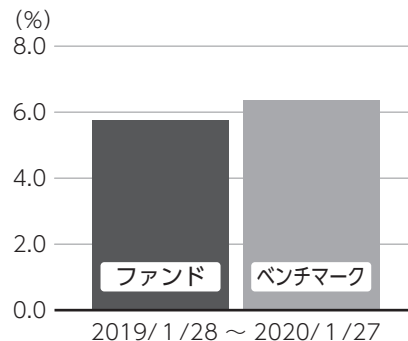
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

**主なマイナス要因：**評価時価差異要因\*によるものです。

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

### 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4期 2019年1月29日～2020年1月27日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	521

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

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

## 今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

### ▶ eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

### ▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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



2019年1月29日～2020年1月27日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	65	0.653	(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）	(29)	(0.294)	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）	(29)	(0.294)	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	66	0.668	

期中の平均基準価額は、9,927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。

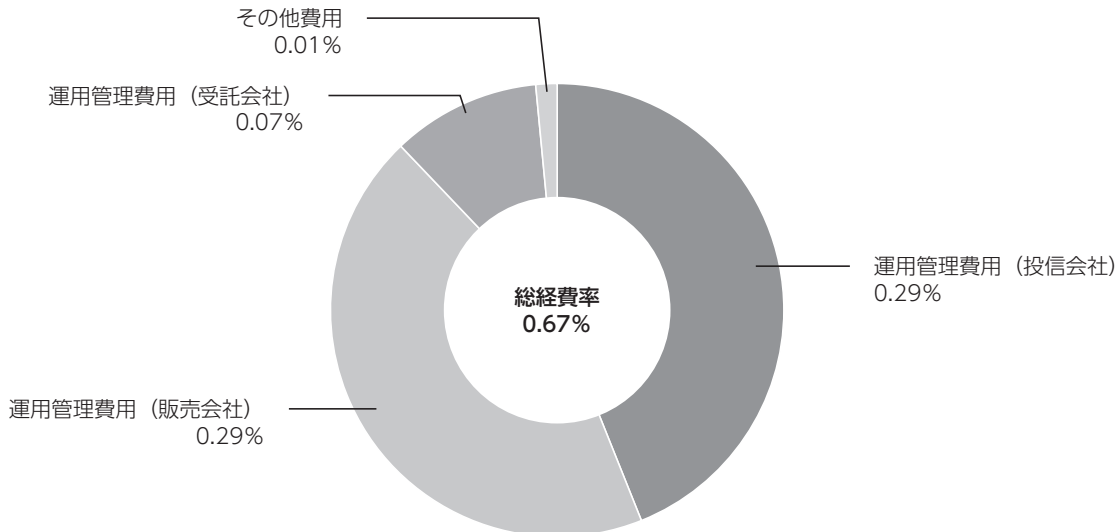
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.67%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ○売買及び取引の状況

(2019年1月29日～2020年1月27日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 206,661	千円 275,210	千口 129,998	千円 175,007

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年1月29日～2020年1月27日)

## 利害関係人との取引状況

< eMAXIS 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	2,814,608	690,127	24.5	2,822,336	683,467	24.2
為替直物取引	52,690	12,879	24.4	56,324	22,555	40.0

平均保有割合 0.1%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2020年1月27日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 57,531	千口 134,194	千円 181,323

## ○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 181,323	% 99.3
コール・ローン等、その他	1,333	0.7
投資信託財産総額	182,656	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（234,687,280千円）の投資信託財産総額（238,131,874千円）に対する比率は98.6%です。

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

1 アメリカドル=109.06円	1 カナダドル=82.94円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ユーロ=120.30円
1 イギリスポンド=142.51円	1 スウェーデンクローネ=11.40円	1 ノルウェークローネ=12.05円	1 デンマーククローネ=16.10円
1 ポーランドズロチ=28.27円	1 オーストラリアドル=74.30円	1 シンガポールドル=80.60円	1 南アフリカランド=7.56円

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年1月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	182,656,650
コール・ローン等	1,222,966
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	181,323,684
未収入金	110,000
(B) 負債	979,447
未払解約金	396,113
未払信託報酬	579,910
その他未払費用	3,424
(C) 純資産総額(A-B)	181,677,203
元本	179,764,395
次期繰越損益金	1,912,808
(D) 受益権総口数	179,764,395口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,106円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 76,629,252円  
 期中追加設定元本額 337,492,089円  
 期中一部解約元本額 234,356,946円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0106円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2019年1月29日～ 2020年1月27日
費用控除後の配当等収益額	2,588,895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	6,415,769円
分配準備積立金額	363,686円
当ファンドの分配対象収益額	9,368,350円
1万口当たり収益分配対象額	521円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

## ○損益の状況（2019年1月29日～2020年1月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 416
受取利息	3
支払利息	△ 419
(B) 有価証券売買損益	2,541,632
売買益	6,095,871
売買損	△3,554,239
(C) 信託報酬等	△ 976,878
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	1,564,338
(E) 前期繰越損益金	△ 25,141
(F) 追加信託差損益金	373,611
(配当等相当額)	( 6,014,558)
(売買損益相当額)	(△5,640,947)
(G) 計(D+E+F)	1,912,808
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,912,808
追加信託差損益金	373,611
(配当等相当額)	( 6,415,769)
(売買損益相当額)	(△6,042,158)
分配準備積立金	2,952,581
繰越損益金	△1,413,384

- (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。

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 《第11期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月27日に第11期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
7期(2016年1月26日)	12,613	△0.2	381.71	△0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	92,179
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス ( <small>除く日本、円ヘッジ円ベース</small> )		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年1月28日	円 12,706	% —	385.22	% —	98.0	—
1月末	12,728	0.2	385.88	0.2	97.9	—
2月末	12,714	0.1	385.50	0.1	100.1	—
3月末	12,951	1.9	392.62	1.9	98.2	—
4月末	12,862	1.2	389.98	1.2	98.1	—
5月末	13,049	2.7	395.72	2.7	95.1	—
6月末	13,260	4.4	401.98	4.4	97.4	—
7月末	13,318	4.8	403.79	4.8	96.9	—
8月末	13,732	8.1	416.34	8.1	95.7	—
9月末	13,633	7.3	413.28	7.3	99.7	—
10月末	13,465	6.0	408.17	6.0	100.5	—
11月末	13,456	5.9	407.93	5.9	98.6	—
12月末	13,373	5.2	405.42	5.2	99.4	—
(期 末) 2020年1月27日	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

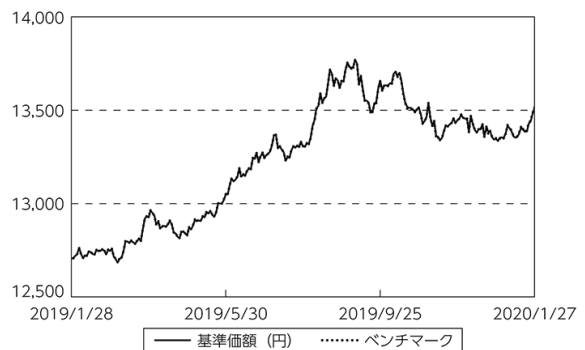
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.3%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.4%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

## ● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

## ● 投資環境について

## ◎ 債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

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

## ● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.4%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

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

## ○ 今後の運用方針

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



## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(1)	(0.010)	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	1	0.011	
期中の平均基準価額は、13,234円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2019年1月29日～2020年1月27日)

## 公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年1月29日～2020年1月27日)

## 利害関係人との取引状況

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2020年1月27日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 977,180	千アメリカドル 1,037,803	千円 113,182,842	% 47.6	% —	% 21.2	% 18.1	% 8.3
カナダ	千カナダドル 45,450	千カナダドル 51,746	4,291,864	1.8	—	0.9	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 323,300	千メキシコペソ 343,256	1,987,456	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	97,630	119,529	14,379,388	6.0	—	3.7	1.5	0.9
イタリア	144,940	171,164	20,591,118	8.7	—	5.2	2.4	1.0
フランス	154,340	189,675	22,817,966	9.6	—	6.6	2.1	0.9
オランダ	29,230	35,835	4,311,013	1.8	—	1.2	0.5	0.2
スペイン	87,450	109,300	13,148,827	5.5	—	3.8	1.4	0.4
ベルギー	35,930	45,378	5,459,042	2.3	—	1.7	0.5	0.1
オーストリア	21,530	26,886	3,234,424	1.4	—	0.9	0.3	0.1
フィンランド	9,240	10,373	1,247,938	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	9,890	11,777	1,416,839	0.6	—	0.5	0.1	—
イギリス	千イギリスポンド 81,400	千イギリスポンド 109,057	15,541,775	6.5	—	5.1	1.2	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 52,400	千スウェーデンクローネ 59,551	678,888	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 42,350	千ノルウェークローネ 43,846	528,350	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 54,950	千デンマーククローネ 71,917	1,157,864	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 44,150	千ポーランドズロチ 46,158	1,304,905	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 52,750	千オーストラリアドル 61,414	4,563,092	1.9	—	1.4	0.3	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 17,170	千シンガポールドル 18,616	1,500,529	0.6	—	0.4	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 196,350	千南アフリカランド 179,238	1,355,045	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	232,699,174	97.8	—	54.7	30.0	13.1

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,085	336,488	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,907	1,734,871	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,583	281,761	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,782	303,411	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	695	75,852	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	5,400	5,381	586,853	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	3,086	336,580	2021/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,597	174,182	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	7,000	6,986	761,928	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,494	272,010	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	8,000	7,980	870,332	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,087	445,783	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	3,700	3,687	402,197	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	6,975	760,795	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	800	87,268	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 220815	1.5	5,500	5,504	600,368	2022/8/15
	1.5 T-NOTE 220915	1.5	14,000	14,012	1,528,211	2022/9/15
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	10,000	10,012	1,091,963	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,707	731,501	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	5,999	654,308	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,300	8,255	900,389	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,436	920,076	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	6,350	6,377	695,533	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,888	860,267	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,925	537,149	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,736	734,698	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	8,800	8,824	962,427	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,226	1,006,252	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,900	3,908	426,264	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	5,000	5,009	546,322	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,500	2,504	273,139	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	4,400	4,379	477,652	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,703	185,756	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	6,600	6,629	723,057	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,822	1,398,445	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,408	153,602	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,119	340,225	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	9,200	9,258	1,009,701	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,824	417,082	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220715	1.75	4,000	4,027	439,188	2022/7/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	4,900	4,937	538,485	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,400	2,421	264,095	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,700	2,718	296,497	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	2,015	219,755	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	12,500	12,599	1,374,113	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220430	1.875	12,000	12,105	1,320,273	2022/4/30

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,734	407,305	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,788	413,128	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,369	694,646	2022/10/31
	2 T-NOTE 210228	2.0	4,800	4,822	525,941	2021/2/28
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,007	109,916	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	3,800	3,832	418,021	2021/10/31
	2 T-NOTE 211231	2.0	10,000	10,095	1,100,994	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	8,900	8,994	980,984	2022/2/15
	2 T-NOTE 221130	2.0	10,700	10,859	1,184,354	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	8,900	9,043	986,330	2023/2/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,550	278,166	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	12,000	12,255	1,336,530	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	7,000	7,166	781,610	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	12,300	12,592	1,373,297	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	7,300	7,490	816,912	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	704	76,783	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	6,400	6,456	704,118	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,010	110,176	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,743	408,313	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,450	703,514	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,885	860,034	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,700	2,766	301,754	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,600	4,717	514,531	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	6,300	6,481	706,885	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	10,650	10,967	1,196,061	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,550	2,606	284,229	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,814	197,910	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	6,100	6,153	671,061	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	707	77,171	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,057	987,845	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,273	466,106	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	9,400	9,721	1,060,243	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	10,300	10,653	1,161,844	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	4,100	4,244	462,865	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	7,000	7,266	792,465	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	9,500	9,882	1,077,836	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,500	6,795	741,066	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	5,000	5,230	570,434	2027/11/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	4,350	4,586	500,170	2049/11/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	705	76,911	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 210315	2.375	14,000	14,129	1,540,975	2021/3/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	10,000	10,350	1,128,771	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,555	1,042,075	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	9,800	10,322	1,125,817	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	5,397	588,703	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	5,100	5,468	596,357	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	5,631	614,165	2046/5/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-NOTE 230815	2.5	14,550	15,069	1,643,477	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,481	1,034,004	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,000	2,095	228,548	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 210515	2.625	15,500	15,714	1,713,871	2021/5/15
	2.625 T-NOTE 210615	2.625	3,000	3,044	332,049	2021/6/15
	2.625 T-NOTE 211215	2.625	9,000	9,188	1,002,052	2021/12/15
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,814	634,163	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	11,900	12,553	1,369,092	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	9,509	1,037,106	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	6,150	6,863	748,480	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,000	2,232	243,467	2042/11/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	6,600	7,456	813,200	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 210815	2.75	18,000	18,336	1,999,811	2021/8/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	13,500	14,060	1,533,387	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,211	1,004,640	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	15,000	15,745	1,717,183	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	11,500	12,220	1,332,772	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,000	5,323	580,574	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	11,000	11,919	1,299,944	2028/2/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	6,100	6,986	761,937	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	6,600	7,604	829,396	2046/11/15
	2.875 T-NOTE 211015	2.875	11,500	11,764	1,283,046	2021/10/15
	2.875 T-NOTE 211115	2.875	8,000	8,193	893,576	2021/11/15
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	8,930	974,012	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	13,400	14,313	1,561,076	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	6,000	6,420	700,165	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	13,700	15,008	1,636,880	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,200	6,805	742,257	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,978	652,050	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	8,450	9,854	1,074,765	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	6,000	7,011	764,629	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,450	4,042	440,837	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,250	3,836	418,411	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,700	6,745	735,674	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	6,640	724,247	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	6,100	7,255	791,250	2049/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,500	2,959	322,770	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	4,300	5,091	555,238	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	4,265	465,219	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	6,600	7,851	856,332	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,800	4,603	502,105	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,326	144,641	2021/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	15,900	17,805	1,941,869	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	14,200	17,563	1,915,488	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	7,623	831,395	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	2,000	2,494	272,070	2039/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	3,000	3,839	418,764	2043/8/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	3.625 T-BOND 440215	3.625	5,700	7,311	797,401	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,200	2,246	245,039	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,293	141,104	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	6,600	8,614	939,446	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	1,050	114,526	2040/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	1,102	120,211	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	940	1,295	141,288	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,000	2,786	303,936	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,863	312,268	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,542	168,214	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	3,260	4,457	486,083	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,300	1,818	198,323	2038/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,400	2,011	219,399	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,494	272,033	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,050	1,535	167,430	2037/5/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,580	2,164	236,071	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,516	274,439	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	13,850	18,456	2,012,833	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	3,000	3,494	381,151	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,300	1,862	203,108	2030/5/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,449	158,110	2021/11/15
小計					113,182,842	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券					
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,175	97,522	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	5,900	5,846	484,917	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	148	12,291	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,800	1,778	147,546	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,460	121,118	2027/6/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,256	270,091	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,150	3,174	263,264	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	1,000	1,009	83,722	2023/3/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,573	130,539	2028/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	500	565	46,885	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 240301	2.25	1,200	1,241	102,964	2024/3/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	4,700	4,920	408,073	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	3,000	3,087	256,075	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,750	2,261	187,541	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	1,133	94,022	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,100	3,169	262,878	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,950	2,779	230,521	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,850	2,690	223,115	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,450	2,229	184,941	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	2,350	3,241	268,851	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,800	2,743	227,540	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,259	187,437	2027/6/1
小計					4,291,864	



## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券					
	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	34,750	39,481	228,600	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	11,682	67,643	2036/11/20
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	20,305	117,569	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	29,150	29,064	168,283	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	34,850	201,782	2022/6/9
	7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	10,000	10,103	58,496	2021/12/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	45,750	47,685	276,100	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	19,300	20,656	119,598	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	11,637	67,382	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	25,897	149,948	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	21,500	22,425	129,845	2023/12/7
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	15,764	91,278	2024/9/5
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	15,000	16,666	96,498	2047/11/7
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	14,400	16,084	93,127	2029/5/31
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	18,200	20,950	121,300	2038/11/18
小計					1,987,456	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
	ドイツ					
	国債証券					
	0 BUND 260815	—	4,550	4,707	566,333	2026/8/15
	0 BUND 500815	—	550	519	62,494	2050/8/15
	0 OBL 210409	—	2,800	2,820	339,289	2021/4/9
	0 OBL 211008	—	3,500	3,536	425,465	2021/10/8
	0 OBL 220408	—	800	811	97,583	2022/4/8
	0 OBL 231013	—	1,500	1,535	184,682	2023/10/13
	0 SCHATS 211210	—	5,000	5,057	608,473	2021/12/10
	0.25 BUND 270215	0.25	3,600	3,793	456,403	2027/2/15
	0.25 BUND 280815	0.25	4,000	4,237	509,755	2028/8/15
	0.25 BUND 290215	0.25	2,350	2,491	299,704	2029/2/15
	0.5 BUND 250215	0.5	3,050	3,219	387,277	2025/2/15
	0.5 BUND 260215	0.5	1,800	1,915	230,444	2026/2/15
	0.5 BUND 280215	0.5	3,300	3,558	428,127	2028/2/15
	1 BUND 240815	1.0	1,600	1,718	206,720	2024/8/15
	1 BUND 250815	1.0	2,700	2,938	353,458	2025/8/15
	1.25 BUND 480815	1.25	1,300	1,696	204,138	2048/8/15
	1.5 BUND 220904	1.5	2,800	2,956	355,726	2022/9/4
	1.5 BUND 230215	1.5	6,800	7,249	872,096	2023/2/15
	1.5 BUND 230515	1.5	3,700	3,963	476,828	2023/5/15
	1.5 BUND 240515	1.5	2,900	3,167	380,998	2024/5/15
	1.75 BUND 220704	1.75	2,750	2,910	350,165	2022/7/4
	1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,139	257,404	2024/2/15
	2 BUND 220104	2.0	3,400	3,575	430,181	2022/1/4
	2 BUND 230815	2.0	1,600	1,751	210,675	2023/8/15
	2.25 BUND 210904	2.25	250	261	31,462	2021/9/4
	2.5 BUND 440704	2.5	2,900	4,596	552,943	2044/7/4
	2.5 BUND 460815	2.5	2,600	4,213	506,921	2046/8/15
	3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,900	228,589	2021/7/4
	3.25 BUND 420704	3.25	2,500	4,296	516,888	2042/7/4
	4 BUND 370104	4.0	2,300	3,911	470,560	2037/1/4

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	1,900	3,491	420,085	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	3,036	365,344	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,670	4,607	554,273	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,510	4,965	597,324	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,700	2,805	337,447	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	2,200	3,283	395,039	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,273	153,238	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	1,250	2,089	251,422	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,650	2,522	303,416	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	3,500	3,510	422,294	2021/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	402	48,469	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,000	988	118,886	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,950	1,966	236,523	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	1,200	1,217	146,412	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,500	2,558	307,728	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,337	160,892	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	4,850	4,990	600,373	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	450	466	56,060	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,879	226,120	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,580	1,651	198,680	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,100	2,209	265,802	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,750	1,801	216,755	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,000	1,059	127,503	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	3,450	3,705	445,760	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	4,050	4,373	526,167	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,850	1,999	240,509	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	2,600	2,707	325,750	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	3,550	3,873	466,004	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	750	805	96,846	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,150	2,387	287,264	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,000	3,280	394,601	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	3,200	3,523	423,844	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,700	2,988	359,562	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	3,800	4,354	523,881	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,300	1,413	170,100	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	3,700	4,306	518,129	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,551	306,964	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	500	609	73,340	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,800	2,261	271,998	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,000	3,647	438,839	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	3,950	4,145	498,731	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,300	2,434	292,871	2021/8/1
3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,408	289,762	2024/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,150	4,149	499,239	2037/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	2,959	355,969	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,379	406,611	2024/3/1		
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	4,400	4,739	570,196	2021/9/1		

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
スペイン	国債証券	4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,882	346,722	2024/1/31	
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,950	5,117	615,584	2040/7/30	
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,984	479,323	2028/10/31	
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,200	4,118	495,479	2044/10/31	
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	4,450	5,214	627,260	2023/1/31	
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,600	3,868	465,323	2021/4/30	
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,700	4,414	531,013	2032/7/30	
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,750	3,095	372,372	2022/1/31	
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,500	3,448	414,833	2026/7/30	
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,100	4,678	562,797	2029/1/31	
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	1,900	1,950	234,703	2023/10/22	
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,879	226,123	2024/10/22	
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,767	332,899	2025/6/22	
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,454	174,932	2027/6/22	
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,900	3,137	377,486	2028/6/22	
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	976	117,435	2026/6/22	
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,330	160,006	2031/6/22	
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	850	973	117,141	2033/4/22	
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	294	35,432	2037/6/22	
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,600	1,974	237,553	2047/6/22	
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,200	1,512	181,942	2038/6/22	
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	930	1,367	164,565	2066/6/22	
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,644	197,794	2023/6/22	
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	600	870	104,737	2057/6/22	
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,119	134,665	2034/6/22	
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	550	957	115,186	2045/6/22	
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,500	1,650	198,565	2022/3/28	
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,080	1,596	192,064	2032/3/28	
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	2,100	2,270	273,162	2021/9/28	
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,033	244,654	2022/9/28	
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,450	4,289	515,976	2041/3/28			
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,275	153,500	2026/3/28			
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,390	4,079	490,785	2035/3/28			
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,700	3,971	477,726	2028/3/28			
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	1,400	1,426	171,629	2023/7/15	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,400	1,481	178,220	2027/4/20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	850	901	108,410	2029/2/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	950	1,019	122,638	2026/10/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	650	701	84,445	2028/2/20	
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	2,100	2,294	276,013	2025/10/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	750	950	114,323	2047/2/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	337	40,550	2086/11/2	
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,100	1,211	145,773	2024/10/21	
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	950	1,031	124,148	2023/10/20	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	480	843	101,494	2117/9/20	
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	900	1,191	143,354	2034/5/23	
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	850	1,403	168,846	2044/6/20	

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,707	205,453	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	2,950	3,231	388,804	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,420	170,899	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,950	3,251	391,145	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,059	127,438	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	950	1,420	170,834	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	506	60,941	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	662	79,738	2023/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	737	88,684	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	500	529	63,645	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	200	212	25,525	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	750	816	98,169	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	1,100	1,179	141,852	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	650	743	89,502	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	350	439	52,915	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	586	70,593	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	582	70,045	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	1,050	1,162	139,811	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	550	830	99,950	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	676	81,410	2028/7/4
3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	210	25,266	2021/4/15		
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	497	59,884	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	700	761	91,587	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	950	1,026	123,518	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	950	1,054	126,819	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,000	1,143	137,621	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	600	721	86,840	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	650	790	95,119	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,326	159,583	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,190	1,484	178,642	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	869	104,647	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	911	109,608	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,300	1,686	202,850	2025/3/13
小 計						86,606,558	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	3,380	3,391	483,285	2022/7/22	
	0.75 GILT 230722	0.75	2,650	2,683	382,459	2023/7/22	
	1 GILT 240422	1.0	1,200	1,230	175,421	2024/4/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	5,380	5,702	812,643	2027/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,100	1,111	158,334	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	3,150	3,373	480,699	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	2,600	2,870	409,069	2047/7/22	
	1.625 GILT 281022	1.625	1,950	2,139	304,950	2028/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	1,420	1,825	260,085	2071/10/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	4,950	5,128	730,841	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	2,270	2,560	364,836	2037/9/7	
	1.75 GILT 490122	1.75	700	819	116,803	2049/1/22	

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日	
			額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	1.75 GILT 570722	1.75	2,170	2,704	385,475	2057/7/22
		2.25 GILT 230907	2.25	3,650	3,894	555,064	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,480	2,325	331,447	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,300	1,440	205,256	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	4,200	6,144	875,611	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,350	3,606	513,895	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	2,040	4,049	577,126	2068/7/22
		3.75 GILT 210907	3.75	1,650	1,738	247,710	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,240	2,178	310,451	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	1,650	1,775	253,027	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	1,900	3,820	544,398	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	850	1,100	156,853	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,000	2,840	404,858	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,550	3,840	547,335	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	2,000	3,167	451,455	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	890	1,431	204,063	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,900	3,314	472,343	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	800	1,454	207,305	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	3,660	7,263	1,035,114	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,300	1,961	279,533	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,350	4,007	571,119	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,800	2,588	368,865	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,550	2,569	366,194	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,750	3,391	483,253	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,920	2,839	404,588	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	700	771	109,996	2021/6/7
小	計					15,541,775	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	5,600	5,975	68,119	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,500	4,802	54,746	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,623	75,509	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,597	143,605	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	8,239	93,935	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	11,550	12,588	143,513	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,600	8,724	99,458	2039/3/30
小	計					678,888	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,887	34,798	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	4,800	4,916	59,238	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,380	52,788	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,000	3,110	37,476	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,417	89,385	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	5,050	5,318	64,093	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,950	5,290	63,754	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	10,200	10,523	126,813	2021/5/25
小	計					528,350	

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
デンマーク			%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,700	11,508	185,280	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,000	4,327	69,664	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,757	140,993	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,600	8,623	138,834	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,291	165,686	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	14,900	28,410	457,404	2039/11/15
小	計					1,157,864	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	5,750	5,771	163,146	2021/7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	5,400	5,477	154,860	2022/4/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	800	817	23,123	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	6,000	6,159	174,129	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,577	101,144	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	4,500	4,589	129,736	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,838	108,505	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	1,000	1,043	29,509	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,774	106,707	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,479	126,630	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,900	2,037	57,592	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,763	78,118	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,828	51,700	2029/4/25
小	計					1,304,905	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	2 AUST GOVT 211221	2.0	2,450	2,507	186,285	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	800	833	61,956	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	3,300	3,619	268,892	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,000	3,407	253,185	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,595	192,866	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,996	222,667	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	3,050	3,482	258,756	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,950	3,405	253,039	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,000	1,201	89,253	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,900	2,440	181,332	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	4,550	5,109	379,627	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	3,500	4,166	309,605	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,166	86,644	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,750	2,380	176,859	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,250	3,907	290,332	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,400	3,372	250,602	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,500	4,423	328,665	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,993	222,442	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	3,900	4,148	308,220	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,255	241,856	2022/7/15
小	計					4,563,092	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPOREGOVT 211001	1.25	150	149	12,060	2021/10/1
		1.75 SINGAPOREGOVT 220401	1.75	650	654	52,784	2022/4/1



## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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

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

## ○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産(234,687,280千円)の投資信託財産総額(238,131,874千円)に対する比率は98.6%です。

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

1 アメリカドル=109.06円	1 カナダドル=82.94円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ユーロ=120.30円
1 イギリスポンド=142.51円	1 スウェーデンクローネ=11.40円	1 ノルウェークローネ=12.05円	1 デンマーククローネ=16.10円
1 ポーランドズロチ=28.27円	1 オーストラリアドル=74.30円	1 シンガポールドル=80.60円	1 南アフリカランド=7.56円

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

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

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 178,385,096,188円  
 期中追加設定元本額 37,696,590,522円  
 期中一部解約元本額 40,058,284,336円  
 また、1口当たり純資産額は、期末13,512円です。

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

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	105,594,306,529円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	11,256,999,335円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	10,143,150,689円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,260,836,149円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,563,319,070円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	6,557,849,487円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,729,500,636円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,520,168,461円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,940,734,688円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	3,286,827,948円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,152,392,978円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,590,562,187円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	1,250,760,089円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,079,737,354円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	551,522,821円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	171,262,988円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	134,194,556円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	89,342,059円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	76,119,162円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	73,815,188円
合計	176,023,402,374円

## ○損益の状況 (2019年1月29日~2020年1月27日)

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

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
 (注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。