

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5期（決算日：2021年1月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、去る1月26日に第5期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
 フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客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)	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 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
4期(2020年1月27日)	10,106	0	5.7		409.73	6.4	97.6	—	181
5期(2021年1月26日)	10,459	0	3.5		427.41	4.3	98.3	—	282

(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 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年1月27日	円 10,106	% —	409.73	% —	% 97.6	% —
1月末	10,183	0.8	412.91	0.8	97.7	—
2月末	10,295	1.9	417.52	1.9	98.5	—
3月末	10,441	3.3	423.40	3.3	97.3	—
4月末	10,424	3.1	423.84	3.4	96.5	—
5月末	10,411	3.0	423.57	3.4	98.7	—
6月末	10,482	3.7	426.81	4.2	99.5	—
7月末	10,579	4.7	431.07	5.2	98.4	—
8月末	10,444	3.3	425.73	3.9	97.8	—
9月末	10,554	4.4	430.39	5.0	97.6	—
10月末	10,528	4.2	429.55	4.8	97.3	—
11月末	10,535	4.2	429.92	4.9	99.4	—
12月末	10,520	4.1	429.65	4.9	99.0	—
(期 末) 2021年1月26日	円 10,459	% 3.5	427.41	% 4.3	% 98.3	% —

(注) 騰落率は期首比。

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

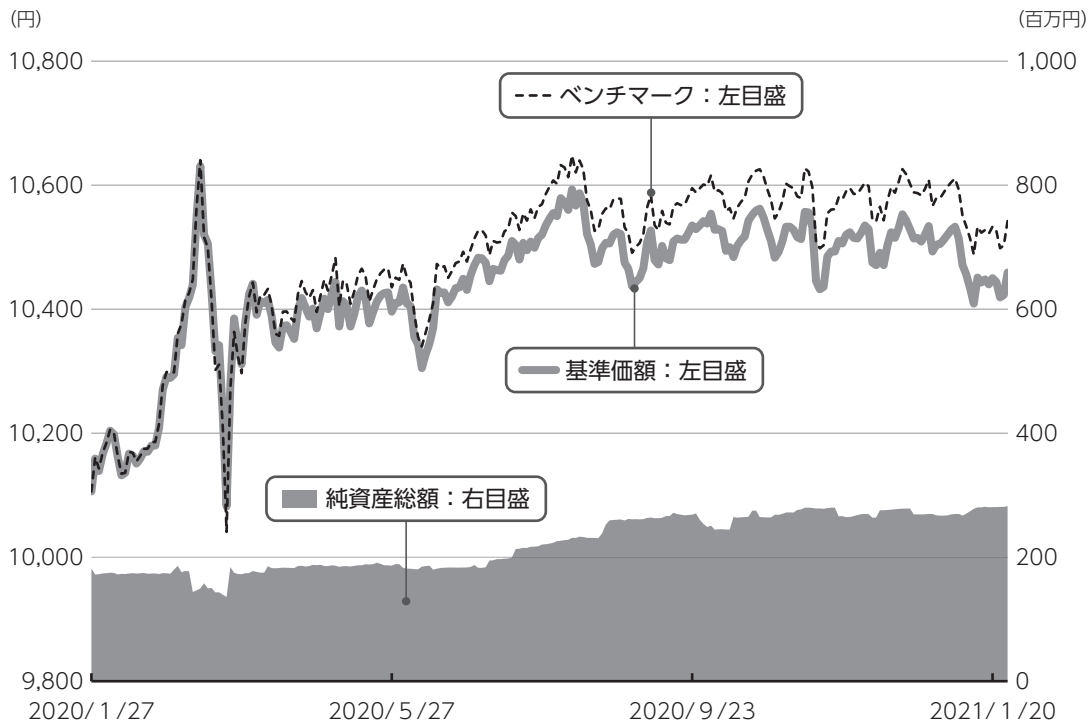
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第5期：2020年1月28日～2021年1月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第5期首	10,106円
第5期末	10,459円
既払分配金	0円
騰落率	3.5%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（4.3%）を0.8%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5期：2020年1月28日～2021年1月26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や世界的な金融緩和スタンス等を背景に、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 $\Delta 0.8\%$ 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

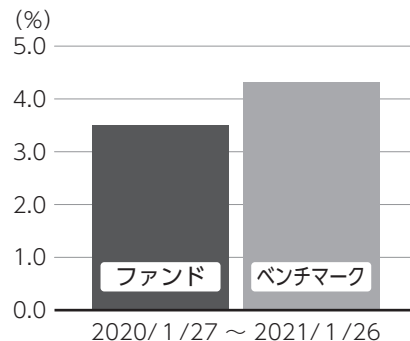
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

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：ありません。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

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5期 2020年1月28日～2021年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	656

（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。

2020年1月28日～2021年1月26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	69	0.658	(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）	(31)	(0.296)	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）	(31)	(0.296)	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）	(7)	(0.066)	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	0.014	(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)	(0.010)	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
（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	70	0.672	

期中の平均基準価額は、10,440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。

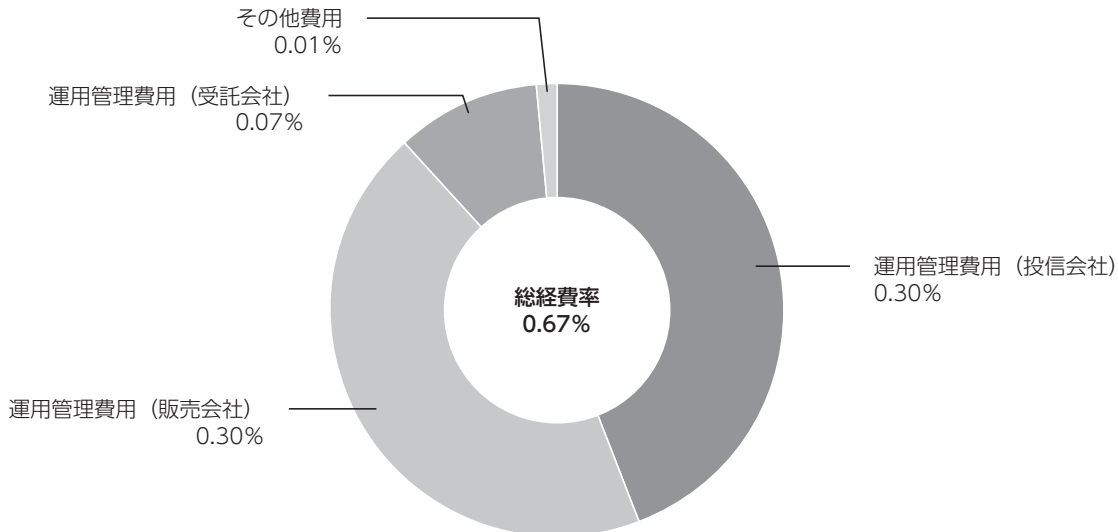
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 249,511	千円 348,113	千口 183,643	千円 256,666

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2021年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >
該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	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	2,934,795	608,117	20.7	2,953,360	606,870	20.5
為替直物取引	124,654	89,244	71.6	120,695	89,614	74.2

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

(2021年1月26日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 134,194	千口 200,062	千円 281,288

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 281,288	% 99.1
コール・ローン等、その他	2,572	0.9
投資信託財産総額	283,860	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（250,489,227千円）の投資信託財産総額（253,412,253千円）に対する比率は98.8%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=103.77円	1 カナダドル=81.40円	1 メキシコペソ=5.16円	1 ユーロ=125.90円
1 イギリスポンド=141.88円	1 スウェーデンクローネ=12.52円	1 ノルウェークローネ=12.14円	1 デンマーククローネ=16.93円
1 ポーランドズロチ=27.73円	1 オーストラリアドル=79.98円	1 シンガポールドル=78.18円	1 イスラエルシェケル=31.68円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	283,860,665
コール・ローン等	2,432,654
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	281,288,011
未収入金	140,000
(B) 負債	1,501,053
未払解約金	626,057
未払信託報酬	869,833
その他未払費用	5,163
(C) 純資産総額(A-B)	282,359,612
元本	269,973,594
次期繰越損益金	12,386,018
(D) 受益権総口数	269,973,594口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,459円

<注記事項>

- ①期首元本額 179,764,395円
 期中追加設定元本額 366,315,115円
 期中一部解約元本額 276,105,916円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0459円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年1月28日～ 2021年1月26日
費用控除後の配当等収益額	3,233,999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	13,777,758円
分配準備積立金額	711,386円
当ファンドの分配対象収益額	17,723,143円
1万口当たり収益分配対象額	656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（2020年1月28日～2021年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 363
受取利息	4
支払利息	△ 367
(B) 有価証券売買損益	3,309,967
売買益	6,904,337
売買損	△ 3,594,370
(C) 信託報酬等	△ 1,474,436
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	1,835,168
(E) 前期繰越損益金	370,847
(F) 追加信託差損益金	10,180,003
(配当等相当額)	(13,357,805)
(売買損益相当額)	(△ 3,177,802)
(G) 計(D+E+F)	12,386,018
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	12,386,018
追加信託差損益金	10,180,003
(配当等相当額)	(13,777,758)
(売買損益相当額)	(△ 3,597,755)
分配準備積立金	3,945,385
繰越損益金	△ 1,739,370

- (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12期》決算日2021年1月26日

[計算期間：2020年1月28日～2021年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第12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12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
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
12期(2021年1月26日)	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	250,742

(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		FTSE世界国債インデックス (<small>債(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2020年1月27日	円 13,512	% —	409.73	% —	% 97.8	% —	% —
1月末	13,616	0.8	412.91	0.8	97.9	—	—
2月末	13,773	1.9	417.52	1.9	98.7	—	—
3月末	13,974	3.4	423.40	3.3	97.5	—	—
4月末	13,955	3.3	423.84	3.4	96.7	—	—
5月末	13,945	3.2	423.57	3.4	100.4	—	—
6月末	14,044	3.9	426.81	4.2	99.7	—	—
7月末	14,182	5.0	431.07	5.2	98.6	—	—
8月末	14,005	3.6	425.73	3.9	99.9	—	—
9月末	14,160	4.8	430.39	5.0	97.7	—	—
10月末	14,133	4.6	429.55	4.8	97.4	—	—
11月末	14,149	4.7	429.92	4.9	99.8	—	—
12月末	14,136	4.6	429.65	4.9	99.6	—	—
(期 末) 2021年1月26日	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	—

(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

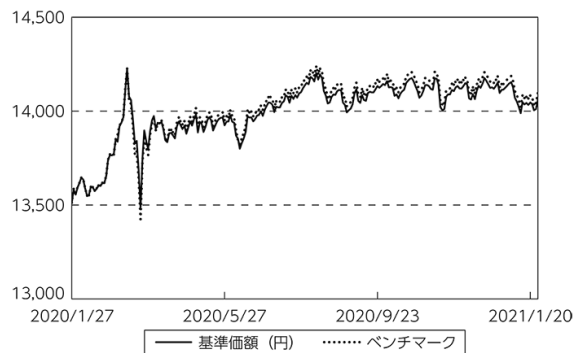
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.1%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(4.3%)を0.2%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や世界的な金融緩和スタンス等を背景に、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4.3%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 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)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	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 ）	(1)	(0.010)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、13,996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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 643,721	千アメリカドル 682,320
	カナダ	千カナダドル 39,530	千カナダドル 32,295
	メキシコ	千メキシコペソ 151,001	千メキシコペソ 135,575
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 107,076	73,249
	イタリア	国債証券 118,817	110,097
	フランス	国債証券 126,061	108,556
	オランダ	国債証券 22,722	21,517
	スペイン	国債証券 75,953	66,562
	ベルギー	国債証券 26,703	24,755
	オーストリア	国債証券 21,553	17,700
	フィンランド	国債証券 6,739	4,316
	アイルランド	国債証券 10,627	6,363
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 68,151	千イギリスポンド 59,346
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 23,353	千スウェーデンクローネ 15,850
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 21,668	千ノルウェークローネ 19,599
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 40,280	千デンマーククローネ 38,577
ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 34,862	千ポーランドズロチ 26,425	
オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 54,655	千オーストラリアドル 28,357	
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 8,785	千シンガポールドル 7,306	
イスラエル	国債証券 千イスラエルシェケル 37,027	千イスラエルシェケル 618	
南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド -	千南アフリカランド 158,148	

(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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	2,934,795	608,117	20.7	2,953,360	606,870	20.5
為替直物取引	124,654	89,244	71.6	120,695	89,614	74.2

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

(2021年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	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 937,640	千アメリカドル 1,035,621	千円 107,466,493	% 42.9	% —	% 19.8	% 16.4	% 6.7
カナダ	千カナダドル 52,650	千カナダドル 59,771	4,865,404	1.9	—	1.0	0.7	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 329,850	千メキシコペソ 377,727	1,949,073	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	124,730	153,155	19,282,224	7.7	—	4.9	2.2	0.6
イタリア	151,640	185,400	23,341,954	9.3	—	6.0	2.7	0.6
フランス	166,760	208,558	26,257,457	10.5	—	7.2	2.9	0.4
オランダ	29,390	37,179	4,680,955	1.9	—	1.4	0.4	0.1
スペイン	95,910	119,897	15,095,044	6.0	—	4.1	1.7	0.2
ベルギー	37,970	48,006	6,044,077	2.4	—	1.9	0.4	0.1
オーストリア	24,300	31,128	3,919,077	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	11,420	12,877	1,621,271	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	13,650	16,244	2,045,161	0.8	—	0.6	0.2	—
イギリス	千イギリスポンド 89,890	千イギリスポンド 120,229	17,058,144	6.8	—	5.3	0.9	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 58,700	千スウェーデンクローネ 66,057	827,044	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 43,750	千ノルウェークローネ 46,139	560,131	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 56,550	千デンマーククローネ 73,015	1,236,148	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 52,200	千ポーランドズロチ 56,819	1,575,605	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 75,940	千オーストラリアドル 86,371	6,907,996	2.8	—	2.0	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 17,920	千シンガポールドル 20,643	1,613,898	0.6	—	0.5	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 27,850	千イスラエルシェケル 35,189	1,114,805	0.4	—	0.3	0.1	0.1
合 計	—	—	247,461,971	98.7	—	57.6	30.7	10.4

(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 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	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
国債証券	0.125 T-NOTE 230515	0.125	5,500	5,498	570,623	2023/5/15
	0.125 T-NOTE 230815	0.125	9,500	9,494	985,237	2023/8/15
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	6,200	6,162	639,453	2025/9/30
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	8,000	7,928	822,766	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	5,350	5,292	549,227	2027/8/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	6,500	6,284	652,162	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	13,200	12,725	1,320,538	2030/8/15
	1.125 T-BOND 400515	1.125	8,400	7,752	804,522	2040/5/15
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	8,000	8,172	848,092	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230215	1.375	5,800	5,948	617,265	2023/2/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,223	438,220	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	7,700	7,945	824,498	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	7,230	750,281	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	7,800	7,912	821,072	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 220815	1.5	5,500	5,618	583,063	2022/8/15
	1.5 T-NOTE 220915	1.5	6,000	6,135	636,701	2022/9/15
	1.5 T-NOTE 230115	1.5	5,000	5,135	532,895	2023/1/15
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	6,300	6,480	672,495	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,899	715,953	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	6,278	651,562	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,300	8,748	907,854	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	6,500	6,856	711,497	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	7,000	7,326	760,269	2030/2/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,598	892,267	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	12,150	12,478	1,294,935	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 221215	1.625	6,800	6,993	725,674	2022/12/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	8,114	842,023	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	5,070	526,150	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,972	723,558	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	7,100	7,525	780,915	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,754	1,012,263	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	4,500	4,778	495,894	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	7,400	7,856	815,291	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	5,200	5,522	573,118	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	7,900	8,368	868,393	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	1,750	1,781	184,874	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	4,400	4,485	465,434	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,163	328,321	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	9,200	9,395	975,008	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,883	403,013	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220615	1.75	3,000	3,068	318,399	2022/6/15
	1.75 T-NOTE 220715	1.75	4,000	4,096	425,084	2022/7/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	4,900	5,035	522,495	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	10,000	10,371	1,076,208	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	9,000	9,471	982,815	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	8,000	8,426	874,456	2024/7/31

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		
		%	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 261231	1.75	6,800	7,274	754,920	2026/12/31
		1.875 T-NOTE 220228	1.875	4,000	4,077	423,154	2022/2/28
		1.875 T-NOTE 220430	1.875	12,000	12,269	1,273,160	2022/4/30
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,787	393,037	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,855	400,112	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 220930	1.875	10,000	10,295	1,068,344	2022/9/30
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,495	674,027	2022/10/31
		2 T-BOND 500215	2.0	6,150	6,453	669,646	2050/2/15
		2 T-NOTE 221130	2.0	10,000	10,347	1,073,776	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	8,900	9,241	958,979	2023/2/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	5,700	6,033	626,054	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	5,500	5,827	604,756	2024/5/31
		2 T-NOTE 250215	2.0	10,500	11,223	1,164,664	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	12,150	13,052	1,354,479	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	8,300	8,987	932,683	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,532	677,884	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	8,500	8,827	916,017	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	8,131	843,849	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	8,700	9,219	956,755	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	10,100	10,716	1,112,026	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	6,300	6,746	700,075	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	12,000	12,922	1,340,967	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	5,730	6,342	658,150	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,336	968,822	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	4,900	5,265	546,409	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	9,500	10,215	1,060,059	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 241231	2.25	5,100	5,493	570,076	2024/12/31
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	9,500	10,343	1,073,383	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 260331	2.25	7,000	7,648	793,637	2026/3/31
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	6,700	7,369	764,730	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	11,300	12,458	1,292,792	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	7,400	8,166	847,447	2027/11/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	6,000	6,818	707,549	2049/11/15
		2.375 T-NOTE 240229	2.375	3,600	3,842	398,758	2024/2/29
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,897	1,027,105	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	10,500	11,646	1,208,588	2027/5/15
		2.375 T-NOTE 290515	2.375	7,400	8,285	859,805	2029/5/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	5,847	606,779	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	5,100	5,911	613,448	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	6,085	631,448	2046/5/15
2.5 T-NOTE 230815	2.5	9,050	9,595	995,685	2023/8/15		
2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,789	1,015,867	2024/5/15		
2.5 T-NOTE 250131	2.5	6,000	6,531	677,780	2025/1/31		
2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,937	616,114	2023/6/30		
2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,300	3,615	375,160	2025/3/31		
2.625 T-NOTE 260131	2.625	4,600	5,104	529,737	2026/1/31		
2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	10,015	1,039,308	2029/2/15		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,450	2,956	306,752	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	3,020	3,639	377,678	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	4,950	6,015	624,259	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	4,500	5,473	568,019	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	3,000	3,183	330,329	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,440	979,666	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	6,800	7,334	761,149	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	7,900	8,738	906,756	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	7,500	8,315	862,851	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	11,400	12,985	1,347,485	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,950	4,858	504,198	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	4,050	5,002	519,097	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,760	4,661	483,756	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	5,500	6,878	713,730	2049/5/15
	2.875 T-NOTE 230930	2.875	6,000	6,437	668,003	2023/9/30
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	9,136	948,060	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	4,900	5,430	563,491	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	11,900	13,246	1,374,556	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	4,800	5,371	557,361	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	9,400	10,812	1,122,058	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	8,900	10,261	1,064,827	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,670	2,091	217,066	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,850	4,842	502,545	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	4,700	5,925	614,868	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,160	3,992	414,272	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	4,910	6,229	646,441	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,700	7,253	752,715	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	7,141	741,099	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	4,430	5,661	587,519	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	12,000	13,464	1,397,198	2025/9/30
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,500	3,183	330,341	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	3,350	4,274	443,526	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	4,596	476,946	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,950	5,064	525,493	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	4,100	5,335	553,625	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	10,600	12,446	1,291,596	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,700	4,923	510,952	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	8,171	847,930	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,700	2,255	234,017	2039/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,150	5,707	592,238	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,950	6,820	707,769	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,650	2,284	237,073	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	4,410	6,179	641,212	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,300	1,817	188,587	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,800	2,611	270,971	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	5,100	7,473	775,565	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	1,390	2,022	209,847	2038/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債		
			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	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,500	3,692	383,219	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,950	2,888	299,780	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	2,230	3,335	346,080	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,400	2,015	209,177	2036/2/15	
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,300	1,920	199,316	2038/5/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,600	2,392	248,243	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,230	3,394	352,226	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,400	3,742	388,320	2041/2/15	
	5 T-BOND 370515	5.0	1,050	1,611	167,251	2037/5/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,400	1,987	206,272	2031/2/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	5,800	7,422	770,200	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	4,800	6,544	679,122	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	6,500	7,516	779,949	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	2,750	4,056	420,939	2030/5/15	
小計					107,466,493		
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	1,205	98,119	2022/3/1	
	1 CAN GOVT 220901	1.0	6,000	6,083	495,178	2022/9/1	
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,543	125,679	2027/6/1	
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	3,850	3,989	324,709	2025/3/1	
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	4,900	5,104	415,472	2030/6/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,350	272,706	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	2,850	3,001	244,327	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	4,000	4,132	336,403	2023/3/1	
	2 CAN GOVT 230901	2.0	4,500	4,709	383,332	2023/9/1	
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,651	134,446	2028/6/1	
	2 CAN GOVT 511201	2.0	2,320	2,650	215,715	2051/12/1	
	2.25 CAN GOVT 240301	2.25	1,200	1,274	103,711	2024/3/1	
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	2,400	2,591	210,959	2025/6/1	
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,200	2,362	192,339	2024/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	950	1,244	101,292	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	1,142	92,980	2064/12/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,920	2,783	226,541	2045/12/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,490	2,222	180,905	2041/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,500	2,367	192,732	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,450	2,044	166,392	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,320	2,048	166,739	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,269	184,716	2027/6/1	
小計					4,865,404		
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	44,750	53,570	276,422	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	12,502	64,513	2036/11/20	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	22,373	115,445	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	36,062	186,082	2022/6/9	
	6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	20,000	21,018	108,453	2023/3/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	35,750	40,762	210,334	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	20,000	23,389	120,688	2031/5/29	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,800	6,792	35,051	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	27,386	141,316	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	21,500	23,621	121,888	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	16,801	86,693	2024/9/5	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	22,000	25,586	132,027	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	33,400	40,663	209,823	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	22,200	27,196	140,331	2038/11/18	
小 計					1,949,073		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	4,050	4,224	531,843	2026/8/15
		0 BUND 290815	—	3,100	3,274	412,261	2029/8/15
		0 BUND 300815	—	2,800	2,960	372,736	2030/8/15
		0 BUND 500815	—	2,720	2,835	357,052	2050/8/15
		0 OBL 220408	—	3,700	3,731	469,777	2022/4/8
		0 OBL 231013	—	3,500	3,575	450,095	2023/10/13
		0 OBL 240405	—	2,300	2,357	296,852	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	5,000	5,146	647,921	2024/10/18
		0.25 BUND 270215	0.25	4,200	4,459	561,503	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	3,600	3,863	486,430	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	4,200	4,519	569,054	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	4,150	4,369	550,128	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	3,400	3,622	456,072	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	4,640	5,024	632,580	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,300	3,590	452,013	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	3,600	3,831	482,433	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	5,400	5,844	735,809	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,600	3,643	458,753	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	2,800	2,901	365,302	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	3,300	3,455	435,012	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	5,500	5,790	728,984	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	3,000	3,229	406,575	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	5,250	5,437	684,577	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,103	264,777	2024/2/15
		2 BUND 230815	2.0	3,100	3,321	418,237	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	2,980	4,975	626,452	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,330	5,714	719,456	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,310	4,136	520,756	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,430	4,198	528,555	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	2,450	4,610	580,443	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	2,981	375,335	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	3,960	6,853	862,849	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,500	5,069	638,253	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	3,640	5,925	746,024	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	3,100	4,510	567,904	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,210	152,378	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	1,700	2,788	351,041	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	2,070	3,065	385,984	2027/7/4

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	
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	3,200	3,251	409,367	2025/2/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,600	2,662	335,185	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 230301	0.95	3,000	3,077	387,444	2023/3/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	4,900	5,029	633,174	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	4,450	4,723	594,658	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	850	867	109,220	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,950	2,006	252,619	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,904	239,803	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	700	743	93,600	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,750	1,851	233,144	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,980	3,173	399,526	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	4,300	4,638	583,928	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	2,950	3,231	406,900	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,200	1,278	160,973	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	2,200	2,377	299,374	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,900	3,171	399,318	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	3,600	4,010	504,919	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	5,000	5,566	700,847	2027/8/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,200	2,467	310,701	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	2,150	2,521	317,405	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,150	2,552	321,335	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	2,420	2,944	370,747	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,500	2,745	345,674	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,700	1,898	239,080	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,430	3,081	387,943	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	3,960	4,679	589,206	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,730	2,254	283,877	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,080	2,668	336,013	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,350	3,254	409,755	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,550	2,032	255,915	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	2,360	3,396	427,590	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	5,200	6,554	825,172	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,389	300,783	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,500	4,985	627,686	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	5,100	5,652	711,686	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,318	417,802	2024/3/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,000	3,380	425,625	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,870	5,116	644,171	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	4,135	520,620	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	3,864	486,502	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	3,850	4,645	584,832	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	3,100	4,701	591,929	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,190	3,573	449,962	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,280	5,400	679,895	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	6,680	9,383	1,181,332	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	5,300	5,840	735,356	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	3,350	5,236	659,284	2033/2/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,170	4,838	609,105	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	4,070	5,743	723,145	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,400	3,373	424,731	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	2,550	3,201	403,074	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 220525	—	1,300	1,311	165,062	2022/5/25
		0 O. A. T 230325	—	4,400	4,466	562,346	2023/3/25
		0 O. A. T 240325	—	5,000	5,110	643,349	2024/3/25
		0 O. A. T 250325	—	4,700	4,829	608,038	2025/3/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	3,750	3,936	495,584	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	4,100	4,308	542,491	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	5,300	5,621	707,723	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	6,180	6,669	839,645	2029/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	6,650	7,270	915,407	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	6,830	7,493	943,478	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	1,590	1,756	221,150	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,600	2,809	353,744	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	4,800	5,283	665,235	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	4,250	5,044	635,075	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	4,450	5,340	672,340	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	5,300	6,303	793,633	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	3,550	4,695	591,102	2050/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	6,400	6,766	851,957	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	4,400	4,814	606,151	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	3,920	5,157	649,366	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	1,660	2,502	315,048	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	3,220	4,659	586,569	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	4,500	4,732	595,817	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	4,450	4,890	615,710	2024/5/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	6,800	8,659	1,090,214	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	6,130	7,522	947,073	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,000	1,045	131,584	2022/4/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	2,970	5,105	642,721	2045/5/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	5,800	7,078	891,218	2026/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	3,160	5,415	681,777	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	2,050	4,415	555,874	2055/4/25
4 O. A. T 600425	4.0	2,040	4,648	585,282	2060/4/25		
4.25 O. A. T 231025	4.25	7,000	7,964	1,002,716	2023/10/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	4,260	8,042	1,012,534	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	3,380	5,770	726,504	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	5,640	8,474	1,066,903	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	4,080	7,014	883,072	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	5,000	6,612	832,565	2025/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	4,150	5,014	631,380	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 520115	—	690	705	88,827	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,350	295,872	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,000	2,133	268,566	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	950	1,084	136,552	2040/1/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,500	2,731	343,894	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	3,830	4,227	532,180	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	3,100	3,293	414,664	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,200	2,412	303,732	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,920	2,608	328,407	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,900	3,370	424,300	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,350	1,470	185,130	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,830	3,394	427,383	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,870	3,195	402,359	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	2,600	3,736	470,462	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	465	58,622	2023/1/15
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 230430	—	6,100	6,171	777,050	2023/4/30
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	3,700	3,780	476,023	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	3,150	3,186	401,230	2022/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	2,700	2,820	355,073	2030/4/30
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	1,400	1,542	194,202	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,300	3,677	463,011	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	3,600	3,940	496,087	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	3,800	4,242	534,152	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	3,300	3,671	462,250	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,240	3,647	459,273	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,350	3,724	468,904	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,350	2,555	321,763	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	2,500	2,806	353,399	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,700	3,191	401,791	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,500	3,928	494,659	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	4,220	5,300	667,327	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	2,000	2,919	367,529	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	3,000	3,366	423,786	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,380	3,544	446,293	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,680	3,026	381,032	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	4,800	5,478	689,738	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,330	3,690	464,583	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,100	3,525	443,865	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,400	2,953	371,890	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,650	4,721	594,491	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,787	350,932	2024/1/31
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,210	3,973	500,271	2040/7/30		
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,949	497,285	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,950	3,832	482,465	2044/10/31		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	3,000	4,906	617,709	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,500	3,366	423,842	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,800	5,664	713,124	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,470	1,536	193,408	2030/6/22
		0.2 BEL GOVT 231022	0.2	1,900	1,947	245,169	2023/10/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	900	946	119,108	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,881	236,820	2024/10/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				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	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	3,100	3,304	416,036	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	3,200	3,487	439,105	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,308	290,665	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,563	322,750	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,416	178,341	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,500	1,707	215,004	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,570	1,856	233,720	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	309	38,971	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,540	2,039	256,727	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,050	1,388	174,787	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	630	1,043	131,427	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	857	107,959	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	930	1,499	188,741	2057/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,200	1,712	215,595	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,360	2,484	312,806	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	840	1,249	157,249	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	1,950	245,509	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,360	4,284	539,407	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,245	156,810	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,800	3,127	393,718	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,290	1,860	234,232	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	1,400	1,423	179,242	2023/7/15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	970	1,038	130,698	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	2,100	2,270	285,864	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,350	1,458	183,562	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,450	1,586	199,746	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,300	1,417	178,497	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	900	1,234	155,479	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	530	880	110,837	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	2,100	2,286	287,877	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,900	2,028	255,356	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	750	1,647	207,359	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	900	1,222	153,862	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	790	1,380	173,756	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	1,750	1,881	236,887	2022/11/22
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	1,250	1,316	165,792	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	640	1,543	194,339	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	2,020	3,446	433,915	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,031	129,859	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,400	2,034	256,142	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	504	63,478	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	662	83,394	2023/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	550	573	72,168	2036/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	743	93,570	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	800	858	108,132	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	700	756	95,220	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	800	868	109,295	2029/9/15

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	
フィンランド	国債証券	0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	450	503	63,411	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	900	966	121,646	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	900	1,064	133,969	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	580	788	99,276	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	577	72,685	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	571	71,919	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	1,050	1,142	143,884	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	450	712	89,648	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	675	85,063	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	750	909	114,507	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	600	641	80,763	2035/5/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,200	1,322	166,440	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	2,100	2,280	287,062	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	950	1,070	134,809	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,100	1,302	163,949	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	280	327	41,260	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	500	664	83,672	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	830	1,062	133,752	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,428	179,891	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,740	2,193	276,191	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	846	106,593	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	1,000	1,099	138,385	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,600	2,004	252,388	2025/3/13
小 計						102,287,224	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.375 GILT 301022	0.375	4,000	4,037	572,836	2030/10/22
		0.5 GILT 220722	0.5	3,380	3,412	484,154	2022/7/22
		0.625 GILT 250607	0.625	3,450	3,554	504,265	2025/6/7
		0.625 GILT 501022	0.625	2,850	2,694	382,236	2050/10/22
		0.75 GILT 230722	0.75	2,650	2,707	384,130	2023/7/22
		0.875 GILT 291022	0.875	2,100	2,221	315,204	2029/10/22
		1 GILT 240422	1.0	2,600	2,693	382,126	2024/4/22
		1.25 GILT 270722	1.25	2,500	2,693	382,173	2027/7/22
		1.5 GILT 260722	1.5	2,600	2,816	399,592	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	2,400	2,787	395,510	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	900	1,004	142,525	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	940	1,328	188,557	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	5,350	5,514	782,336	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	2,800	3,280	465,501	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,490	1,836	260,496	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	2,270	2,973	421,857	2057/7/22
		2.25 GILT 230907	2.25	2,700	2,866	406,693	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,900	3,161	448,575	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,300	1,433	203,418	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,640	3,998	567,285	2044/1/22
3.5 GILT 450122	3.5	2,670	4,238	601,394	2045/1/22		
3.5 GILT 680722	3.5	1,860	3,921	556,452	2068/7/22		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				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	
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	1,890	3,436	487,509	2052/7/22
		4.0	1,650	1,726	244,909	2022/3/7
		4.0	1,710	3,580	508,001	2060/1/22
		4.25	1,930	2,484	352,566	2027/12/7
		4.25	2,750	3,937	558,663	2032/6/7
		4.25	2,000	3,065	434,946	2036/3/7
		4.25	1,680	2,726	386,871	2039/9/7
		4.25	1,560	2,577	365,653	2040/12/7
		4.25	2,140	3,853	546,766	2046/12/7
		4.25	1,580	2,974	422,053	2049/12/7
		4.25	2,270	4,662	661,478	2055/12/7
		4.5	2,600	3,974	563,913	2034/9/7
		4.5	2,300	4,029	571,761	2042/12/7
		4.75	2,700	3,879	550,442	2030/12/7
		4.75	1,780	3,014	427,660	2038/12/7
		5.0	2,830	3,423	485,745	2025/3/7
		6.0	1,170	1,704	241,876	2028/12/7
小	計				17,058,144	
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	3,600	3,830	47,953	2028/5/12
		0.75	7,700	8,241	103,181	2029/11/12
		1.0	10,150	10,872	136,126	2026/11/12
		1.5	11,800	12,424	155,552	2023/11/13
		2.5	7,200	8,082	101,187	2025/5/12
		3.5	11,550	12,152	152,148	2022/6/1
		3.5	6,700	10,454	130,894	2039/3/30
小	計				827,044	
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					
		1.375	4,900	5,067	61,520	2030/8/19
		1.5	2,850	2,966	36,016	2026/2/19
		1.75	8,300	8,690	105,497	2025/3/13
		1.75	4,250	4,493	54,555	2027/2/17
		1.75	6,200	6,608	80,230	2029/9/6
		2.0	7,250	7,522	91,326	2023/5/24
		2.0	5,050	5,451	66,182	2028/4/26
		3.0	4,950	5,337	64,802	2024/3/14
小	計				560,131	
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	3,000	3,250	55,025	2052/11/15
		0.5	10,200	10,937	185,172	2027/11/15
		0.5	10,700	11,615	196,655	2029/11/15
		1.5	8,100	8,593	145,495	2023/11/15
		1.75	10,200	11,373	192,558	2025/11/15
		4.5	14,350	27,243	461,240	2039/11/15
小	計				1,236,148	
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					
		0.75	6,000	6,094	169,003	2025/4/25

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					
	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		
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	1.25 POLAND 301025	1.25	1,500	1,507	41,806	2030/10/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	4,305	119,394	2024/10/25
	2.5 POLAND 230125	2.5	4,800	5,037	139,676	2023/1/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	3,230	89,587	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	5,000	5,535	153,497	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	3,600	4,011	111,234	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	4,222	117,098	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	4,000	4,581	127,041	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	4,003	111,019	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,600	127,581	2023/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,739	75,972	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,946	53,985	2029/4/25
	POLAND 220725	—	5,000	5,002	138,705	2022/7/25
小計					1,575,605	
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	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	2,800	2,800	223,987	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	3,800	3,775	301,930	2030/12/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	4,500	4,671	373,621	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,750	1,597	127,782	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	3,300	3,430	274,375	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,000	2,214	177,127	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	4,220	4,783	382,592	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	4,900	5,317	425,286	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	4,050	4,647	371,685	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	3,550	4,094	327,441	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,800	2,105	168,395	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,240	1,418	113,425	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,680	2,001	160,119	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	9,200	10,356	828,351	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	4,500	5,354	428,275	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,108	88,694	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,600	2,088	167,046	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	5,050	6,053	484,186	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	3,800	5,209	416,641	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	5,800	7,286	582,740	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,912	232,950	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,142	251,337	2022/7/15
小計					6,907,996	
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	1.75 SINGAPORGGOVT 220401	1.75	650	660	51,666	2022/4/1
	2.25 SINGAPORGGOVT 360801	2.25	1,550	1,757	137,400	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGGOV 250601	2.375	1,000	1,082	84,629	2025/6/1
	2.625 SINGAPORGGOV 280501	2.625	1,000	1,126	88,069	2028/5/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 230701	2.75	1,400	1,482	115,865	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 420401	2.75	1,050	1,301	101,749	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 460301	2.75	1,700	2,145	167,727	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGGOV 290701	2.875	2,450	2,833	221,517	2029/7/1

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	2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	936	73,215	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	546	42,713	2024/9/1
	3.125 SINGAPORGOVT 220901	3.125	1,200	1,254	98,046	2022/9/1
	3.375 SINGAPORGOVT 330901	3.375	1,500	1,877	146,763	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	3,120	3,639	284,534	2027/3/1
小 計					1,613,898	
イスラエル			千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券	1.5 ISRAEL FIXED 231130	1.5	4,000	4,166	131,985	2023/11/30
	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	4,000	4,529	143,504	2028/9/28
	5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	8,000	8,440	267,391	2022/1/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	5,850	9,942	314,983	2042/1/31
	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	6,000	8,110	256,940	2026/10/30
小 計					1,114,805	
合 計					247,461,971	

(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

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公社債	千円 247,461,971	% 97.7
コール・ローン等、その他	5,950,282	2.3
投資信託財産総額	253,412,253	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (250,489,227千円) の投資信託財産総額 (253,412,253千円) に対する比率は98.8%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=103.77円	1 カナダドル=81.40円	1 メキシコペソ=5.16円	1 ユーロ=125.90円
1 イギリスポンド=141.88円	1 スウェーデンクローネ=12.52円	1 ノルウェークローネ=12.14円	1 デンマーククローネ=16.93円
1 ポーランドズロチ=27.73円	1 オーストラリアドル=79.98円	1 シンガポールドル=78.18円	1 イスラエルシェケル=31.68円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	504,753,023,049
コール・ローン等	2,152,993,282
公社債(評価額)	247,461,971,324
未収入金	253,314,991,045
未収利息	1,696,203,017
前払費用	126,864,381
(B) 負債	254,010,765,254
未払金	252,183,496,773
未払解約金	1,827,268,053
未払利息	428
(C) 純資産総額(A-B)	250,742,257,795
元本	178,336,920,306
次期繰越損益金	72,405,337,489
(D) 受益権総口数	178,336,920,306口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,060円

<注記事項>

- ①期首元本額 176,023,402,374円
 期中追加設定元本額 79,600,314,681円
 期中一部解約元本額 77,286,796,749円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,060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)	102,265,079,918円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	10,530,785,606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)	9,889,030,256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)	9,068,128,127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)	8,910,306,125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)	7,549,855,078円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,702,728,353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)	3,772,071,358円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,467,512,020円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,722,680,903円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	2,194,160,790円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,118,012,165円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,117,154,370円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	2,111,339,447円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,107,312,096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)	1,517,209,643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)	1,001,038,772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)	559,779,439円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01(適格機関投資家限定)	312,660,303円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	312,015,642円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	311,484,137円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	311,241,135円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	200,062,597円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	180,782,803円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	66,972,125円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	37,517,098円
合計	178,336,920,306円

○損益の状況 (2020年1月28日~2021年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,147,195,240
受取利息	5,148,498,159
その他収益金	10,773
支払利息	△ 1,313,692
(B) 有価証券売買損益	4,283,211,205
売買益	37,469,986,785
売買損	△33,186,775,580
(C) 保管費用等	△ 24,145,315
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,406,261,130
(E) 前期繰越損益金	61,824,007,707
(F) 追加信託差損益金	31,268,055,231
(G) 解約差損益金	△30,092,986,579
(H) 計(D+E+F+G)	72,405,337,489
次期繰越損益金(H)	72,405,337,489

- (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。