

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 |
|--------|---|
| 信託期間 | 2027年2月5日まで（2017年3月27日設定） |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。 |
| 主要運用対象 | 別に示した投資対象ファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 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。 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。） |

※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。

運用報告書（全体版）

海外債券セレクション （ラップ向け）

第1期（決算日：2018年2月5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「海外債券セレクション（ラップ向け）」は、去る2月5日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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。

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 | | | (参考指数) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) | | 債券 組入比率 | 債券 先物比率 | 投資信託 組入比率 | 純資産 総額 |
|---------------|--------|----------|--------|---|--------|------------|------------|--------------|-----------|
| | (分配落) | 税込 分配 | み 金 | 期 騰 | 中 落 | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 2017年3月27日 | 10,000 | — | — | 107,002.70 | — | — | — | — | 10 |
| 1期(2018年2月5日) | 10,690 | 0 | 6.9 | 114,987.24 | 7.5 | 66.3 | — | 30.2 | 3,009 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | (参 考 指 数) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|--|-------|-------------|-------------|-----------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | | |
| (設定日) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2017年3月27日 | 10,000 | — | 107,002.70 | — | — | — | — |
| 3月末 | 10,042 | 0.4 | 108,641.98 | 1.5 | 67.4 | — | — |
| 4月末 | 10,139 | 1.4 | 109,024.53 | 1.9 | 67.2 | — | 30.7 |
| 5月末 | 10,299 | 3.0 | 110,685.94 | 3.4 | 66.0 | — | 30.4 |
| 6月末 | 10,500 | 5.0 | 112,709.17 | 5.3 | 66.5 | — | 30.5 |
| 7月末 | 10,492 | 4.9 | 112,671.90 | 5.3 | 66.1 | — | 30.3 |
| 8月末 | 10,587 | 5.9 | 114,354.58 | 6.9 | 66.6 | — | 30.2 |
| 9月末 | 10,745 | 7.5 | 115,558.22 | 8.0 | 66.7 | — | 30.8 |
| 10月末 | 10,761 | 7.6 | 115,508.10 | 7.9 | 66.1 | — | 30.6 |
| 11月末 | 10,733 | 7.3 | 115,672.53 | 8.1 | 65.7 | — | 30.0 |
| 12月末 | 10,896 | 9.0 | 117,078.37 | 9.4 | 65.4 | — | 30.2 |
| 2018年1月末 | 10,624 | 6.2 | 114,201.85 | 6.7 | 66.3 | — | 30.3 |
| (期 末) | | | | | | | |
| 2018年2月5日 | 10,690 | 6.9 | 114,987.24 | 7.5 | 66.3 | — | 30.2 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

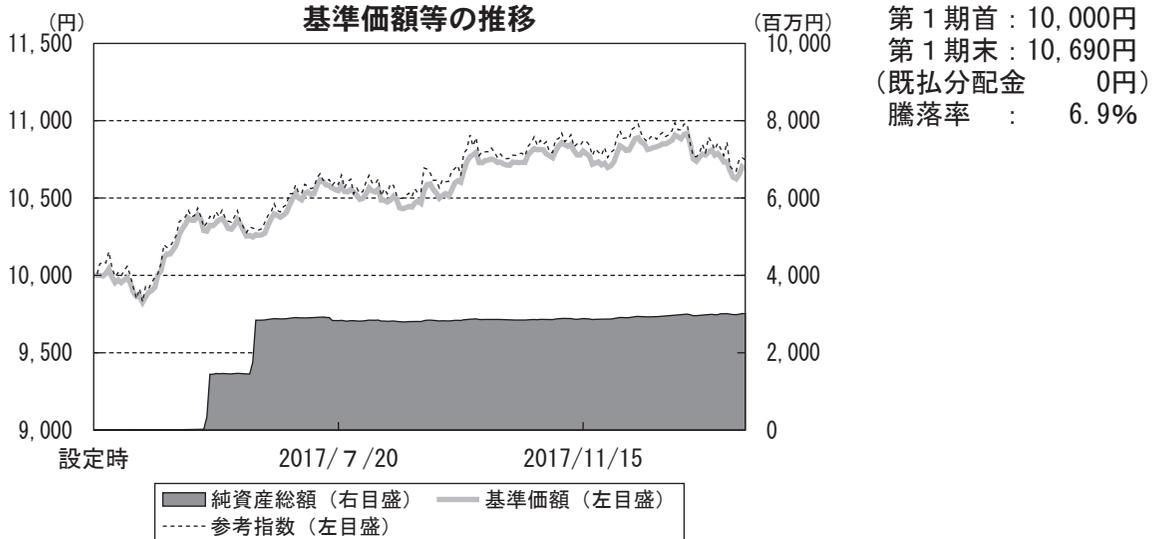
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2017/3/27～2018/2/5）

基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ6.9%の上昇となりました。



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



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金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。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

組み入れを行った投資信託証券のうち、主に「外国債券インデックスマザーファンド」が円安・ユーロ高を背景に上昇したことなどが基準価額のプラス要因となりました。

投資環境について

（第1期：2017/3/27～2018/2/5）

◎海外債券市況

- ・海外債券市況は上昇しました。
- ・2017年9月以降、米国の税制改正法案成立への期待が高まったことなどから主要先進国の長期金利が上昇したことがマイナスとなった一方で、債券利子収入を享受したことや海外債券のスプレッド（国債に対する利回り差）が縮小したことなどがプラスとなり、結果として、海外債券市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは、日米の金利差拡大が円安・米ドル高要因となった一方で、米国における政治的不透明感の高まりや北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まりなどが円高・米ドル安要因となった結果、期を通じてみると米ドルは円に対して下落しました。
- ・ユーロは、欧州中央銀行（ECB）による金融緩和縮小観測の高まりなどから円に対して上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて**i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

- ・投資信託証券への投資を通じて、主として海外債券に実質的な投資を行いました。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定し、期を通じて「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「アセアン投資適格社債マザーファンド」、「アセアン・ハイイールド社債マザーファンド」に投資を行いました。また、2017年4月中旬以降、「グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）」を組み入れました。
- ・前記の運用の結果、主に「外国債券インデックスマザーファンド」が円安・ユーロ高を背景に上昇したことなどから、基準価額は設定時に比べて上昇しました。

（ご参考）投資信託証券別組入比率表

（％）

| 投資信託証券 | 設定時 | 2017年 3月末 | 4月末 | 5月末 | 6月末 | 7月末 | 8月末 | 9月末 | 10月末 | 11月末 | 12月末 | 2018年 1月末 |
|----------------------------|-----|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------------|
| 外国債券インデックスマザーファンド | — | 61.50 | 61.29 | 60.70 | 60.68 | 60.45 | 60.84 | 60.78 | 60.39 | 59.91 | 59.89 | 60.71 |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | — | 5.02 | 4.96 | 4.90 | 4.90 | 4.84 | 4.92 | 4.88 | 4.79 | 4.77 | 4.90 | 4.90 |
| アセアン投資適格社債マザーファンド | — | 1.01 | 1.00 | 0.98 | 0.98 | 0.97 | 0.98 | 0.99 | 0.98 | 0.98 | 0.96 | 0.97 |
| アセアン・ハイイールド社債マザーファンド | — | 1.01 | 1.00 | 0.98 | 0.98 | 0.97 | 0.98 | 1.00 | 0.98 | 0.98 | 0.96 | 0.97 |
| グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）（※） | — | — | 30.71 | 30.44 | 30.52 | 30.29 | 30.25 | 30.78 | 30.58 | 30.04 | 30.23 | 30.28 |

（注）比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

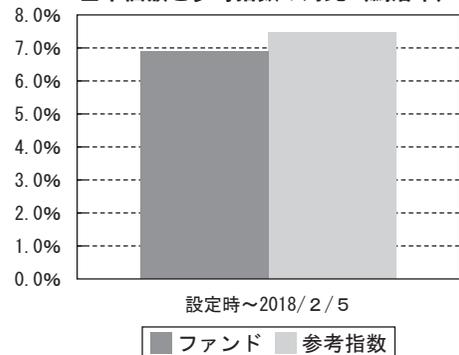
（※）グローバル社債マザーファンドへの投資を行います。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数はF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目 | 第1期 |
|-----------|----------------------|
| | 2017年3月27日～2018年2月5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 | 689 |

(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。)

◎今後の運用方針

- ・ 海外債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用方針を継続します。
- ・ 引き続き、投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年3月27日～2018年2月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 39 | % 0.366 | (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) | (30) | (0.289) | 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) | (4) | (0.038) | 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) | (4) | (0.038) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 2 | 0.017 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.013) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 41 | 0.383 | |
| 期中の平均基準価額は、10,528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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

○ 売買及び取引の状況

(2017年3月27日～2018年2月5日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-------------------------|---------|---------|--------|--------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用） | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| | | 901,556 | 934,430 | 58,806 | 62,820 |

(注) 金額は受渡代金。

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 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 112,405 | 149,230 | 9,398 | 12,950 |
| アセアン投資適格社債マザーファンド | 24,925 | 31,220 | 1,772 | 2,270 |
| アセアン・ハイイールド社債マザーファンド | 24,012 | 31,130 | 1,920 | 2,560 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 944,804 | 1,872,490 | 59,219 | 120,390 |

○利害関係人との取引状況等

(2017年3月27日～2018年2月5日)

利害関係人との取引状況

<海外債券セレクション（ラップ向け）>

| 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 | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

<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 | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

平均保有割合 1.1%

※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。

<新興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 | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

平均保有割合 0.7%

※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。

＜アセアン投資適格社債マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 174 | 百万円 21 | % 12.1 | 百万円 164 | 百万円 33 | % 20.1 |

平均保有割合 2.4%

※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。

＜アセアン・ハイールド社債マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 166 | 百万円 21 | % 12.7 | 百万円 158 | 百万円 28 | % 17.7 |

平均保有割合 2.4%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年3月27日～2018年2月5日)

| 設定時残高(元本) | 当期設定元本 | 当期解約元本 | 期末残高(元本) | 取引の理由 |
|-----------|----------|----------|-----------|-------------|
| 百万円 10 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 10 | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2018年2月5日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------------|---------------|---------------|-----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| グローバル社債ファンドT (適格機関投資家専用) | 千口 842,750 | 千円 908,147 | % 30.2 |
| 合 計 | 842,750 | 908,147 | 30.2 |

(注) 比率は海外債券セレクション（ラップ向け）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|---|---------|-----------|
| | | 口 数 | 評 価 額 |
| | | 千口 | 千円 |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | | 103,007 | 148,062 |
| アセアン投資適格社債マザーファンド | | 23,152 | 29,223 |
| アセアン・ハイイールド社債マザーファンド | | 22,091 | 29,205 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | | 885,585 | 1,824,748 |

○投資信託財産の構成

(2018年2月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 908,147 | 30.1 |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 148,062 | 4.9 |
| アセアン投資適格社債マザーファンド | 29,223 | 1.0 |
| アセアン・ハイイールド社債マザーファンド | 29,205 | 1.0 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 1,824,748 | 60.4 |
| コール・ローン等、その他 | 82,143 | 2.6 |
| 投資信託財産総額 | 3,021,528 | 100.0 |

(注) 新興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（16,663,522千円）の投資信託財産総額（16,950,847千円）に対する比率は98.3%です。

(注) アセアン投資適格社債マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（986,277千円）の投資信託財産総額（991,241千円）に対する比率は99.5%です。

(注) アセアン・ハイイールド社債マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（987,920千円）の投資信託財産総額（993,390千円）に対する比率は99.4%です。

(注) 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（123,141,006千円）の投資信託財産総額（125,375,314千円）に対する比率は98.2%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=109.90円 | 1 カナダドル=88.49円 | 1 アルゼンチンペソ=5.64円 | 1 メキシコペソ=5.91円 |
| 1 ブラジルリアル=34.13円 | 100チリペソ=18.22円 | 100コロンビアペソ=3.87円 | 1 ペルーヌエボソル=34.13円 |
| 1 ウルグアイペソ=3.86円 | 1 ユーロ=136.78円 | 1 イギリスポンド=155.15円 | 1 スイスフラン=118.03円 |
| 1 スウェーデンクローネ=13.88円 | 1 ノルウェークローネ=14.17円 | 1 デンマーククローネ=18.38円 | 1 トルコリラ=29.15円 |
| 1 チェココルナ=5.42円 | 100ハンガリーフォリント=44.18円 | 1 ポーランドズロチ=32.82円 | 1 ロシアルーブル=1.95円 |
| 1 ルーマニアレイ=29.44円 | 1 オーストラリアドル=87.04円 | 1 シンガポールドル=83.25円 | 1 マレーシアリンギット=28.20円 |
| 1 タイバーツ=3.49円 | 1 フィリピンペソ=2.13円 | 100インドネシアルピア=0.82円 | 1 南アフリカランド=9.12円 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年2月5日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,021,528,598 |
| コール・ローン等 | 82,141,195 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 908,147,512 |
| 新興国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 148,062,934 |
| アセアン投資適格社債マザーファンド(評価額) | 29,223,292 |
| アセアン・ハイイールド社債マザーファンド(評価額) | 29,205,145 |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 1,824,748,520 |
| (B) 負債 | 12,072,143 |
| 未払解約金 | 7,706,460 |
| 未払信託報酬 | 4,324,631 |
| 未払利息 | 125 |
| その他未払費用 | 40,927 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,009,456,455 |
| 元本 | 2,815,263,782 |
| 次期繰越損益金 | 194,192,673 |
| (D) 受益権総口数 | 2,815,263,782口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,690円 |

<注記事項>

- ①設定元本額 10,000,000円
 期中追加設定元本額 3,282,072,816円
 期中一部解約元本額 476,809,034円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0690円です。

○損益の状況（2017年3月27日～2018年2月5日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 26,230 |
| 受取利息 | 360 |
| 支払利息 | △ 26,590 |
| (B) 有価証券売買損益 | 105,725,917 |
| 売買益 | 121,870,024 |
| 売買損 | △ 16,144,107 |
| (C) 信託報酬等 | △ 8,169,757 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 97,529,930 |
| (E) 追加信託差損益金 | 96,662,743 |
| (配当等相当額) | (△ 25,068) |
| (売買損益相当額) | (96,687,811) |
| (F) 計(D+E) | 194,192,673 |
| (G) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(F+G) | 194,192,673 |
| 追加信託差損益金 | 96,662,743 |
| (配当等相当額) | (3,611,220) |
| (売買損益相当額) | (93,051,523) |
| 分配準備積立金 | 97,529,930 |

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

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2017年3月27日～ 2018年2月5日 |
|---------------------------|--------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 35,653,896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 | 61,876,034円 |
| 収益調整金額 | 96,662,743円 |
| 分配準備積立金額 | －円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 194,192,673円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 689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、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

外国債券インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2017年5月12日

[計算期間：2016年5月13日～2017年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第16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16期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|-------------|--|
| 運 用 方 針 | シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。 |
| 主 な 組 入 制 限 | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | シティ世界国債インデックス | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|-------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | (除く日本、円換算ベース) | 期 騰 落 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 12期(2013年5月13日) | 17,815 | 33.3 | 99,491.98 | 33.1 | 98.8 | — | 195,142 |
| 13期(2014年5月12日) | 18,707 | 5.0 | 104,415.94 | 4.9 | 98.8 | — | 185,030 |
| 14期(2015年5月12日) | 20,959 | 12.0 | 117,169.90 | 12.2 | 98.8 | — | 159,683 |
| 15期(2016年5月12日) | 19,674 | △ 6.1 | 109,931.94 | △ 6.2 | 98.9 | — | 156,155 |
| 16期(2017年5月12日) | 19,894 | 1.1 | 111,054.04 | 1.0 | 98.8 | — | 132,430 |

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | シティ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|------------------------------------|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2016年5月12日 | 円 | % | | | % | % |
| | 19,674 | — | 109,931.94 | — | 98.9 | — |
| 5月末 | 19,882 | 1.1 | 111,018.88 | 1.0 | 98.8 | — |
| 6月末 | 18,785 | △4.5 | 104,838.53 | △4.6 | 98.9 | — |
| 7月末 | 19,091 | △3.0 | 106,568.13 | △3.1 | 98.7 | — |
| 8月末 | 18,950 | △3.7 | 105,873.31 | △3.7 | 98.2 | — |
| 9月末 | 18,596 | △5.5 | 103,925.95 | △5.5 | 99.0 | — |
| 10月末 | 18,627 | △5.3 | 103,797.35 | △5.6 | 98.8 | — |
| 11月末 | 19,379 | △1.5 | 108,026.33 | △1.7 | 98.6 | — |
| 12月末 | 19,984 | 1.6 | 111,331.80 | 1.3 | 98.5 | — |
| 2017年1月末 | 19,507 | △0.8 | 108,860.69 | △1.0 | 98.9 | — |
| 2月末 | 19,406 | △1.4 | 108,568.93 | △1.2 | 99.0 | — |
| 3月末 | 19,408 | △1.4 | 108,641.98 | △1.2 | 98.7 | — |
| 4月末 | 19,527 | △0.7 | 109,024.53 | △0.8 | 98.7 | — |
| (期 末) 2017年5月12日 | 円 | % | | | % | % |
| | 19,894 | 1.1 | 111,054.04 | 1.0 | 98.8 | — |

(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

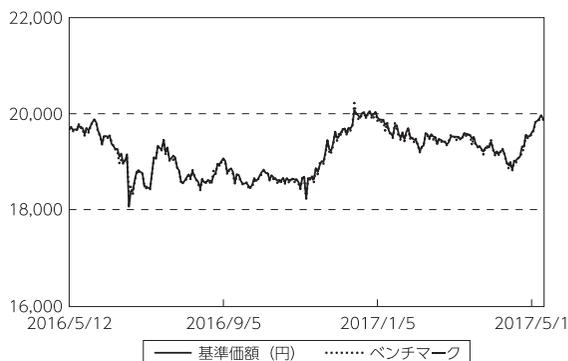
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.1%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(1.0%)を0.1%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で5.1%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円でほぼ横ばいとなりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とし、ベンチマーク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。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.0%の上昇となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

- 管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。
- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

◎今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月13日～2017年5月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 3 | % 0.015 | (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 ） | (3) | (0.015) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 3 | 0.015 | |
| 期中の平均基準価額は、19,261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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月13日～2017年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 20,196 | 百万円 11,410 | % 56.5 | 百万円 45,263 | 百万円 15,571 | % 34.4 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年5月12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 |
| | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 504,950 | 509,877 | 58,095,390 | 43.9 | — | 18.1 | 18.1 | 7.7 |
| | 千カナダドル | 千カナダドル | | | | | | |
| カナダ | 30,120 | 32,879 | 2,733,243 | 2.1 | — | 0.9 | 0.7 | 0.5 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 190,200 | 194,958 | 1,179,500 | 0.9 | — | 0.5 | 0.3 | 0.1 |
| | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 64,070 | 75,084 | 9,295,499 | 7.0 | — | 4.1 | 2.0 | 1.0 |
| イタリア | 89,500 | 100,673 | 12,463,436 | 9.4 | — | 5.4 | 2.8 | 1.2 |
| フランス | 88,660 | 103,434 | 12,805,157 | 9.7 | — | 6.0 | 2.9 | 0.8 |
| オランダ | 19,450 | 23,235 | 2,876,580 | 2.2 | — | 1.4 | 0.5 | 0.2 |
| スペイン | 50,850 | 58,897 | 7,291,500 | 5.5 | — | 3.3 | 1.5 | 0.7 |
| ベルギー | 21,700 | 26,317 | 3,258,154 | 2.5 | — | 1.8 | 0.5 | 0.2 |
| オーストリア | 13,300 | 15,758 | 1,950,868 | 1.5 | — | 0.9 | 0.4 | 0.1 |
| フィンランド | 5,850 | 6,491 | 803,591 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 7,550 | 8,584 | 1,062,742 | 0.8 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | | | | | |
| イギリス | 52,055 | 65,437 | 9,604,323 | 7.3 | — | 5.3 | 1.6 | 0.4 |
| | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | | | | | |
| スイス | 1,760 | 2,118 | 239,568 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ | | | | | | |
| スウェーデン | 40,100 | 45,885 | 588,717 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | | | | |
| ノルウェー | 26,250 | 27,950 | 370,348 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | — |
| | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | | | | |
| デンマーク | 38,600 | 47,725 | 794,151 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 28,550 | 28,991 | 849,437 | 0.6 | — | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | | | | | |
| オーストラリア | 30,650 | 32,814 | 2,759,409 | 2.1 | — | 1.3 | 0.6 | 0.2 |
| | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | | | | |
| シンガポール | 5,910 | 6,181 | 500,124 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.0 |
| | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | | | | |
| マレーシア | 20,850 | 20,831 | 546,198 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.0 |
| | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 92,450 | 84,704 | 721,683 | 0.5 | — | 0.5 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 130,789,630 | 98.8 | — | 51.9 | 33.5 | 13.4 |

(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 | 0.625 T-NOTE 180430 | 0.625 | 2,400 | 2,386 | 271,960 | 2018/4/30 |
| | 0.625 T-NOTE 180630 | 0.625 | 4,000 | 3,973 | 452,786 | 2018/6/30 |
| | 0.75 T-NOTE 180430 | 0.75 | 200 | 199 | 22,690 | 2018/4/30 |
| | 0.75 T-NOTE 180831 | 0.75 | 3,900 | 3,874 | 441,501 | 2018/8/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180930 | 0.75 | 2,600 | 2,581 | 294,103 | 2018/9/30 |
| | 0.75 T-NOTE 181031 | 0.75 | 300 | 297 | 33,921 | 2018/10/31 |
| | 0.75 T-NOTE 190215 | 0.75 | 700 | 693 | 78,963 | 2019/2/15 |
| | 0.75 T-NOTE 190715 | 0.75 | 3,000 | 2,958 | 337,133 | 2019/7/15 |
| | 0.75 T-NOTE 190815 | 0.75 | 2,300 | 2,267 | 258,305 | 2019/8/15 |
| | 0.875 T-NOTE 180531 | 0.875 | 1,400 | 1,395 | 158,973 | 2018/5/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180715 | 0.875 | 2,200 | 2,191 | 249,679 | 2018/7/15 |
| | 0.875 T-NOTE 181015 | 0.875 | 2,500 | 2,485 | 283,236 | 2018/10/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190415 | 0.875 | 2,000 | 1,982 | 225,894 | 2019/4/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190515 | 0.875 | 2,000 | 1,981 | 225,752 | 2019/5/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190615 | 0.875 | 1,800 | 1,781 | 203,001 | 2019/6/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190731 | 0.875 | 900 | 889 | 101,396 | 2019/7/31 |
| | 0.875 T-NOTE 190915 | 0.875 | 3,400 | 3,357 | 382,598 | 2019/9/15 |
| | 1 T-NOTE 180515 | 1.0 | 1,700 | 1,696 | 193,296 | 2018/5/15 |
| | 1 T-NOTE 180531 | 1.0 | 2,600 | 2,594 | 295,595 | 2018/5/31 |
| | 1 T-NOTE 180815 | 1.0 | 2,700 | 2,692 | 306,736 | 2018/8/15 |
| | 1 T-NOTE 180915 | 1.0 | 2,600 | 2,590 | 295,190 | 2018/9/15 |
| | 1 T-NOTE 181130 | 1.0 | 500 | 497 | 56,705 | 2018/11/30 |
| | 1 T-NOTE 190315 | 1.0 | 1,400 | 1,391 | 158,550 | 2019/3/15 |
| | 1 T-NOTE 190630 | 1.0 | 1,100 | 1,091 | 124,359 | 2019/6/30 |
| | 1 T-NOTE 190831 | 1.0 | 600 | 594 | 67,720 | 2019/8/31 |
| | 1 T-NOTE 190930 | 1.0 | 1,800 | 1,782 | 203,049 | 2019/9/30 |
| | 1 T-NOTE 191015 | 1.0 | 1,700 | 1,682 | 191,723 | 2019/10/15 |
| | 1 T-NOTE 191115 | 1.0 | 2,500 | 2,472 | 281,723 | 2019/11/15 |
| | 1 T-NOTE 191130 | 1.0 | 1,800 | 1,779 | 202,808 | 2019/11/30 |
| | 1.125 T-NOTE 180615 | 1.125 | 2,200 | 2,197 | 250,432 | 2018/6/15 |
| | 1.125 T-NOTE 190115 | 1.125 | 1,800 | 1,794 | 204,491 | 2019/1/15 |
| | 1.125 T-NOTE 190131 | 1.125 | 1,700 | 1,694 | 193,085 | 2019/1/31 |
| | 1.125 T-NOTE 190228 | 1.125 | 1,600 | 1,594 | 181,684 | 2019/2/28 |
| | 1.125 T-NOTE 190531 | 1.125 | 1,300 | 1,294 | 147,450 | 2019/5/31 |
| | 1.125 T-NOTE 191231 | 1.125 | 1,600 | 1,586 | 180,708 | 2019/12/31 |
| | 1.125 T-NOTE 200331 | 1.125 | 1,300 | 1,285 | 146,472 | 2020/3/31 |
| | 1.125 T-NOTE 200430 | 1.125 | 4,000 | 3,952 | 450,383 | 2020/4/30 |
| | 1.125 T-NOTE 210228 | 1.125 | 2,400 | 2,344 | 267,153 | 2021/2/28 |
| | 1.125 T-NOTE 210630 | 1.125 | 2,000 | 1,944 | 221,595 | 2021/6/30 |
| | 1.125 T-NOTE 210731 | 1.125 | 2,200 | 2,136 | 243,461 | 2021/7/31 |
| | 1.125 T-NOTE 210831 | 1.125 | 2,700 | 2,619 | 298,504 | 2021/8/31 |
| | 1.125 T-NOTE 210930 | 1.125 | 2,700 | 2,616 | 298,072 | 2021/9/30 |
| | 1.25 T-NOTE 181031 | 1.25 | 2,100 | 2,098 | 239,124 | 2018/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 181115 | 1.25 | 1,600 | 1,599 | 182,197 | 2018/11/15 |
| | 1.25 T-NOTE 181130 | 1.25 | 2,500 | 2,498 | 284,638 | 2018/11/30 |
| | 1.25 T-NOTE 181215 | 1.25 | 2,000 | 1,998 | 227,728 | 2018/12/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | 1.25 T-NOTE 190131 | 1.25 | 1,850 | 1,847 | 210,517 | 2019/1/31 |
| | 1.25 T-NOTE 190430 | 1.25 | 600 | 598 | 68,243 | 2019/4/30 |
| | 1.25 T-NOTE 191031 | 1.25 | 1,400 | 1,393 | 158,799 | 2019/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 200131 | 1.25 | 2,400 | 2,385 | 271,768 | 2020/1/31 |
| | 1.25 T-NOTE 200229 | 1.25 | 1,350 | 1,340 | 152,743 | 2020/2/29 |
| | 1.25 T-NOTE 210331 | 1.25 | 1,700 | 1,666 | 189,929 | 2021/3/31 |
| | 1.25 T-NOTE 211031 | 1.25 | 2,000 | 1,946 | 221,791 | 2021/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 230731 | 1.25 | 1,800 | 1,708 | 194,677 | 2023/7/31 |
| | 1.375 T-NOTE 180630 | 1.375 | 1,800 | 1,803 | 205,460 | 2018/6/30 |
| | 1.375 T-NOTE 180731 | 1.375 | 2,300 | 2,303 | 262,491 | 2018/7/31 |
| | 1.375 T-NOTE 180930 | 1.375 | 2,800 | 2,804 | 319,505 | 2018/9/30 |
| | 1.375 T-NOTE 181130 | 1.375 | 1,000 | 1,001 | 114,069 | 2018/11/30 |
| | 1.375 T-NOTE 181231 | 1.375 | 1,500 | 1,501 | 171,090 | 2018/12/31 |
| | 1.375 T-NOTE 190228 | 1.375 | 1,200 | 1,201 | 136,856 | 2019/2/28 |
| | 1.375 T-NOTE 191215 | 1.375 | 3,400 | 3,392 | 386,593 | 2019/12/15 |
| | 1.375 T-NOTE 200131 | 1.375 | 1,750 | 1,745 | 198,857 | 2020/1/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200215 | 1.375 | 1,700 | 1,694 | 193,054 | 2020/2/15 |
| | 1.375 T-NOTE 200229 | 1.375 | 2,500 | 2,491 | 283,848 | 2020/2/29 |
| | 1.375 T-NOTE 200331 | 1.375 | 2,100 | 2,091 | 238,283 | 2020/3/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200430 | 1.375 | 2,000 | 1,990 | 226,758 | 2020/4/30 |
| | 1.375 T-NOTE 200531 | 1.375 | 1,700 | 1,690 | 192,593 | 2020/5/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200831 | 1.375 | 2,650 | 2,628 | 299,464 | 2020/8/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200930 | 1.375 | 2,600 | 2,576 | 293,536 | 2020/9/30 |
| | 1.375 T-NOTE 201031 | 1.375 | 2,650 | 2,623 | 298,874 | 2020/10/31 |
| | 1.375 T-NOTE 210131 | 1.375 | 2,300 | 2,269 | 258,642 | 2021/1/31 |
| | 1.375 T-NOTE 210430 | 1.375 | 2,400 | 2,362 | 269,161 | 2021/4/30 |
| | 1.375 T-NOTE 210531 | 1.375 | 2,700 | 2,655 | 302,518 | 2021/5/31 |
| | 1.375 T-NOTE 230630 | 1.375 | 2,200 | 2,106 | 239,995 | 2023/6/30 |
| | 1.375 T-NOTE 230831 | 1.375 | 2,700 | 2,579 | 293,890 | 2023/8/31 |
| | 1.375 T-NOTE 230930 | 1.375 | 2,300 | 2,194 | 250,084 | 2023/9/30 |
| | 1.5 T-NOTE 180831 | 1.5 | 3,400 | 3,410 | 388,636 | 2018/8/31 |
| | 1.5 T-NOTE 181231 | 1.5 | 2,800 | 2,808 | 320,004 | 2018/12/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190131 | 1.5 | 2,600 | 2,607 | 297,123 | 2019/1/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190228 | 1.5 | 2,400 | 2,407 | 274,289 | 2019/2/28 |
| | 1.5 T-NOTE 190331 | 1.5 | 1,000 | 1,003 | 114,300 | 2019/3/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190531 | 1.5 | 2,800 | 2,808 | 319,991 | 2019/5/31 |
| | 1.5 T-NOTE 191031 | 1.5 | 1,600 | 1,602 | 182,617 | 2019/10/31 |
| | 1.5 T-NOTE 191130 | 1.5 | 2,900 | 2,903 | 330,839 | 2019/11/30 |
| | 1.5 T-NOTE 200415 | 1.5 | 2,100 | 2,097 | 239,040 | 2020/4/15 |
| | 1.5 T-NOTE 200531 | 1.5 | 2,000 | 1,995 | 227,399 | 2020/5/31 |
| | 1.5 T-NOTE 220131 | 1.5 | 2,300 | 2,257 | 257,209 | 2022/1/31 |
| | 1.5 T-NOTE 230228 | 1.5 | 1,900 | 1,840 | 209,754 | 2023/2/28 |
| | 1.5 T-NOTE 230331 | 1.5 | 1,800 | 1,741 | 198,442 | 2023/3/31 |
| | 1.5 T-NOTE 260815 | 1.5 | 5,500 | 5,093 | 580,355 | 2026/8/15 |
| | 1.625 T-NOTE 190331 | 1.625 | 2,700 | 2,714 | 309,320 | 2019/3/31 |
| | 1.625 T-NOTE 190430 | 1.625 | 1,100 | 1,106 | 126,029 | 2019/4/30 |
| | 1.625 T-NOTE 190630 | 1.625 | 1,700 | 1,708 | 194,711 | 2019/6/30 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|-----------------|------|---------------------|---------|---------|------------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE 190731 | 1.625 | 1,200 | 1,206 | 137,433 | 2019/7/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 190831 | 1.625 | 3,100 | 3,115 | 355,007 | 2019/8/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 191231 | 1.625 | 1,200 | 1,205 | 137,304 | 2019/12/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 200315 | 1.625 | 3,000 | 3,009 | 342,848 | 2020/3/15 |
| | | 1.625 T-NOTE 200630 | 1.625 | 2,700 | 2,702 | 307,950 | 2020/6/30 |
| | | 1.625 T-NOTE 200731 | 1.625 | 2,200 | 2,201 | 250,805 | 2020/7/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 201130 | 1.625 | 2,400 | 2,394 | 272,793 | 2020/11/30 |
| | | 1.625 T-NOTE 220815 | 1.625 | 1,500 | 1,473 | 167,852 | 2022/8/15 |
| | | 1.625 T-NOTE 221115 | 1.625 | 2,400 | 2,350 | 267,794 | 2022/11/15 |
| | | 1.625 T-NOTE 230430 | 1.625 | 3,400 | 3,309 | 377,136 | 2023/4/30 |
| | | 1.625 T-NOTE 230531 | 1.625 | 1,500 | 1,458 | 166,223 | 2023/5/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 231031 | 1.625 | 800 | 774 | 88,289 | 2023/10/31 |
| | | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625 | 4,300 | 4,046 | 461,081 | 2026/2/15 |
| | | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625 | 3,650 | 3,426 | 390,375 | 2026/5/15 |
| | | 1.75 T-NOTE 181031 | 1.75 | 1,000 | 1,006 | 114,736 | 2018/10/31 |
| | | 1.75 T-NOTE 190930 | 1.75 | 2,300 | 2,318 | 264,170 | 2019/9/30 |
| | | 1.75 T-NOTE 201031 | 1.75 | 1,700 | 1,704 | 194,227 | 2020/10/31 |
| | | 1.75 T-NOTE 201231 | 1.75 | 2,400 | 2,402 | 273,776 | 2020/12/31 |
| | | 1.75 T-NOTE 211130 | 1.75 | 1,300 | 1,292 | 147,288 | 2021/11/30 |
| | | 1.75 T-NOTE 220228 | 1.75 | 2,100 | 2,083 | 237,404 | 2022/2/28 |
| | | 1.75 T-NOTE 220331 | 1.75 | 2,200 | 2,181 | 248,533 | 2022/3/31 |
| | | 1.75 T-NOTE 220430 | 1.75 | 2,000 | 1,981 | 225,814 | 2022/4/30 |
| | | 1.75 T-NOTE 220515 | 1.75 | 1,400 | 1,387 | 158,095 | 2022/5/15 |
| | | 1.75 T-NOTE 220930 | 1.75 | 1,800 | 1,776 | 202,432 | 2022/9/30 |
| | | 1.75 T-NOTE 230131 | 1.75 | 2,000 | 1,966 | 224,087 | 2023/1/31 |
| | | 1.75 T-NOTE 230515 | 1.75 | 4,000 | 3,920 | 446,751 | 2023/5/15 |
| | | 1.875 T-NOTE 200630 | 1.875 | 1,000 | 1,008 | 114,963 | 2020/6/30 |
| | | 1.875 T-NOTE 211130 | 1.875 | 2,300 | 2,299 | 261,990 | 2021/11/30 |
| | | 1.875 T-NOTE 220131 | 1.875 | 2,550 | 2,545 | 290,070 | 2022/1/31 |
| | | 1.875 T-NOTE 220228 | 1.875 | 2,600 | 2,595 | 295,757 | 2022/2/28 |
| | | 1.875 T-NOTE 220331 | 1.875 | 1,900 | 1,895 | 215,978 | 2022/3/31 |
| | | 1.875 T-NOTE 220531 | 1.875 | 2,000 | 1,993 | 227,185 | 2022/5/31 |
| | | 1.875 T-NOTE 220831 | 1.875 | 1,700 | 1,690 | 192,593 | 2022/8/31 |
| | | 1.875 T-NOTE 221031 | 1.875 | 2,000 | 1,984 | 226,099 | 2022/10/31 |
| | | 2 T-NOTE 200731 | 2.0 | 1,400 | 1,416 | 161,447 | 2020/7/31 |
| | | 2 T-NOTE 200930 | 2.0 | 1,600 | 1,618 | 184,383 | 2020/9/30 |
| | | 2 T-NOTE 201130 | 2.0 | 1,300 | 1,313 | 149,695 | 2020/11/30 |
| | | 2 T-NOTE 210228 | 2.0 | 1,700 | 1,716 | 195,559 | 2021/2/28 |
| | | 2 T-NOTE 210531 | 2.0 | 2,000 | 2,016 | 229,731 | 2021/5/31 |
| | | 2 T-NOTE 210831 | 2.0 | 2,300 | 2,314 | 263,699 | 2021/8/31 |
| | | 2 T-NOTE 211031 | 2.0 | 2,400 | 2,412 | 274,887 | 2021/10/31 |
| | | 2 T-NOTE 211115 | 2.0 | 3,400 | 3,419 | 389,575 | 2021/11/15 |
| 2 T-NOTE 211231 | 2.0 | 3,000 | 3,013 | 343,342 | 2021/12/31 | | |
| 2 T-NOTE 220215 | 2.0 | 2,200 | 2,211 | 251,931 | 2022/2/15 | | |
| 2 T-NOTE 220731 | 2.0 | 2,000 | 2,002 | 228,129 | 2022/7/31 | | |
| 2 T-NOTE 221130 | 2.0 | 1,900 | 1,896 | 216,080 | 2022/11/30 | | |
| 2 T-NOTE 230215 | 2.0 | 3,550 | 3,536 | 403,001 | 2023/2/15 | | |

| 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 T-NOTE 250215 | 2.0 | 4,200 | 4,113 | 468,677 | 2025/2/15 |
| | 2 T-NOTE 250815 | 2.0 | 4,500 | 4,386 | 499,831 | 2025/8/15 |
| | 2 T-NOTE 261115 | 2.0 | 4,150 | 4,009 | 456,818 | 2026/11/15 |
| | 2.125 T-NOTE 200831 | 2.125 | 2,200 | 2,234 | 254,604 | 2020/8/31 |
| | 2.125 T-NOTE 210131 | 2.125 | 2,200 | 2,230 | 254,153 | 2021/1/31 |
| | 2.125 T-NOTE 210630 | 2.125 | 2,350 | 2,379 | 271,126 | 2021/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 210815 | 2.125 | 3,700 | 3,744 | 426,650 | 2021/8/15 |
| | 2.125 T-NOTE 210930 | 2.125 | 2,500 | 2,527 | 288,010 | 2021/9/30 |
| | 2.125 T-NOTE 211231 | 2.125 | 2,300 | 2,323 | 264,764 | 2021/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 220630 | 2.125 | 1,800 | 1,814 | 206,726 | 2022/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 221231 | 2.125 | 1,650 | 1,656 | 188,779 | 2022/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 231130 | 2.125 | 1,700 | 1,697 | 193,365 | 2023/11/30 |
| | 2.125 T-NOTE 240229 | 2.125 | 1,800 | 1,792 | 204,258 | 2024/2/29 |
| | 2.125 T-NOTE 240331 | 2.125 | 2,000 | 1,990 | 226,794 | 2024/3/31 |
| | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 7,950 | 7,841 | 893,438 | 2025/5/15 |
| | 2.25 T-BOND 460815 | 2.25 | 3,000 | 2,531 | 288,490 | 2046/8/15 |
| | 2.25 T-NOTE 180731 | 2.25 | 300 | 303 | 34,599 | 2018/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210331 | 2.25 | 1,900 | 1,934 | 220,409 | 2021/3/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210430 | 2.25 | 2,200 | 2,239 | 255,191 | 2021/4/30 |
| | 2.25 T-NOTE 210731 | 2.25 | 2,100 | 2,135 | 243,293 | 2021/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 231231 | 2.25 | 1,700 | 1,708 | 194,621 | 2023/12/31 |
| | 2.25 T-NOTE 240131 | 2.25 | 1,900 | 1,908 | 217,416 | 2024/1/31 |
| | 2.25 T-NOTE 241115 | 2.25 | 4,500 | 4,495 | 512,169 | 2024/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 251115 | 2.25 | 4,800 | 4,762 | 542,596 | 2025/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 270215 | 2.25 | 4,650 | 4,587 | 522,660 | 2027/2/15 |
| | 2.375 T-NOTE 180531 | 2.375 | 1,300 | 1,315 | 149,921 | 2018/5/31 |
| | 2.375 T-NOTE 180630 | 2.375 | 1,000 | 1,012 | 115,417 | 2018/6/30 |
| | 2.375 T-NOTE 201231 | 2.375 | 800 | 818 | 93,302 | 2020/12/31 |
| | 2.375 T-NOTE 240815 | 2.375 | 4,000 | 4,037 | 460,032 | 2024/8/15 |
| | 2.5 T-BOND 450215 | 2.5 | 2,900 | 2,600 | 296,247 | 2045/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 2,550 | 2,280 | 259,789 | 2046/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460515 | 2.5 | 2,850 | 2,547 | 290,226 | 2046/5/15 |
| | 2.5 T-NOTE 230815 | 2.5 | 3,300 | 3,373 | 384,373 | 2023/8/15 |
| | 2.5 T-NOTE 240515 | 2.5 | 4,750 | 4,839 | 551,447 | 2024/5/15 |
| | 2.625 T-NOTE 180430 | 2.625 | 1,300 | 1,317 | 150,141 | 2018/4/30 |
| | 2.625 T-NOTE 200815 | 2.625 | 2,300 | 2,373 | 270,415 | 2020/8/15 |
| | 2.625 T-NOTE 201115 | 2.625 | 4,100 | 4,231 | 482,117 | 2020/11/15 |
| | 2.75 T-BOND 420815 | 2.75 | 1,700 | 1,617 | 184,330 | 2042/8/15 |
| | 2.75 T-BOND 421115 | 2.75 | 1,550 | 1,473 | 167,914 | 2042/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 190215 | 2.75 | 1,300 | 1,332 | 151,819 | 2019/2/15 |
| | 2.75 T-NOTE 231115 | 2.75 | 4,900 | 5,078 | 578,675 | 2023/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 240215 | 2.75 | 3,500 | 3,625 | 413,059 | 2024/2/15 |
| | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875 | 2,850 | 2,769 | 315,570 | 2043/5/15 |
| | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875 | 2,900 | 2,805 | 319,635 | 2045/8/15 |
| | 2.875 T-BOND 461115 | 2.875 | 2,700 | 2,610 | 297,471 | 2046/11/15 |
| | 3 T-BOND 420515 | 3.0 | 1,450 | 1,446 | 164,825 | 2042/5/15 |
| | 3 T-BOND 441115 | 3.0 | 2,850 | 2,829 | 322,445 | 2044/11/15 |

| 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 T-BOND 450515 | 3.0 | 2,950 | 2,926 | 333,392 | 2045/5/15 |
| | 3 T-BOND 451115 | 3.0 | 3,700 | 3,667 | 417,889 | 2045/11/15 |
| | 3 T-BOND 470215 | 3.0 | 4,200 | 4,168 | 474,958 | 2047/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125 | 1,050 | 1,073 | 122,356 | 2041/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125 | 1,400 | 1,430 | 162,980 | 2042/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 430215 | 3.125 | 1,800 | 1,831 | 208,729 | 2043/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 3,000 | 3,052 | 347,748 | 2044/8/15 |
| | 3.125 T-NOTE 190515 | 3.125 | 2,700 | 2,795 | 318,489 | 2019/5/15 |
| | 3.125 T-NOTE 210515 | 3.125 | 2,400 | 2,524 | 287,630 | 2021/5/15 |
| | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375 | 3,100 | 3,301 | 376,117 | 2044/5/15 |
| | 3.375 T-NOTE 191115 | 3.375 | 3,000 | 3,141 | 357,936 | 2019/11/15 |
| | 3.5 T-BOND 390215 | 3.5 | 1,000 | 1,097 | 125,049 | 2039/2/15 |
| | 3.5 T-NOTE 200515 | 3.5 | 2,300 | 2,432 | 277,130 | 2020/5/15 |
| | 3.625 T-BOND 430815 | 3.625 | 2,350 | 2,609 | 297,275 | 2043/8/15 |
| | 3.625 T-BOND 440215 | 3.625 | 3,050 | 3,390 | 386,341 | 2044/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 190815 | 3.625 | 2,200 | 2,307 | 262,956 | 2019/8/15 |
| | 3.625 T-NOTE 200215 | 3.625 | 2,900 | 3,066 | 349,438 | 2020/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 210215 | 3.625 | 3,300 | 3,529 | 402,175 | 2021/2/15 |
| | 3.75 T-BOND 410815 | 3.75 | 1,100 | 1,247 | 142,107 | 2041/8/15 |
| | 3.75 T-BOND 431115 | 3.75 | 3,050 | 3,460 | 394,323 | 2043/11/15 |
| | 3.75 T-NOTE 181115 | 3.75 | 2,700 | 2,798 | 318,898 | 2018/11/15 |
| | 3.875 T-BOND 400815 | 3.875 | 1,200 | 1,385 | 157,846 | 2040/8/15 |
| | 3.875 T-NOTE 180515 | 3.875 | 500 | 513 | 58,494 | 2018/5/15 |
| | 4 T-NOTE 180815 | 4.0 | 900 | 930 | 106,042 | 2018/8/15 |
| | 4.25 T-BOND 390515 | 4.25 | 500 | 609 | 69,396 | 2039/5/15 |
| | 4.25 T-BOND 401115 | 4.25 | 1,250 | 1,524 | 173,680 | 2040/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 380215 | 4.375 | 400 | 497 | 56,713 | 2038/2/15 |
| | 4.375 T-BOND 391115 | 4.375 | 550 | 681 | 77,609 | 2039/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 400515 | 4.375 | 1,500 | 1,859 | 211,834 | 2040/5/15 |
| | 4.375 T-BOND 410515 | 4.375 | 1,100 | 1,367 | 155,805 | 2041/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 360215 | 4.5 | 1,100 | 1,387 | 158,087 | 2036/2/15 |
| | 4.5 T-BOND 380515 | 4.5 | 1,950 | 2,466 | 281,044 | 2038/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 390815 | 4.5 | 550 | 692 | 78,931 | 2039/8/15 |
| | 4.625 T-BOND 400215 | 4.625 | 1,500 | 1,922 | 219,098 | 2040/2/15 |
| | 4.75 T-BOND 410215 | 4.75 | 1,400 | 1,832 | 208,741 | 2041/2/15 |
| | 5 T-BOND 370515 | 5.0 | 400 | 536 | 61,153 | 2037/5/15 |
| | 5.25 T-BOND 281115 | 5.25 | 650 | 828 | 94,410 | 2028/11/15 |
| | 5.25 T-BOND 290215 | 5.25 | 400 | 511 | 58,290 | 2029/2/15 |
| | 5.375 T-BOND 310215 | 5.375 | 900 | 1,197 | 136,406 | 2031/2/15 |
| | 5.5 T-BOND 280815 | 5.5 | 600 | 777 | 88,590 | 2028/8/15 |
| | 6 T-BOND 260215 | 6.0 | 500 | 645 | 73,513 | 2026/2/15 |
| | 6.125 T-BOND 271115 | 6.125 | 600 | 805 | 91,757 | 2027/11/15 |
| | 6.25 T-BOND 230815 | 6.25 | 3,500 | 4,355 | 496,213 | 2023/8/15 |
| | 6.25 T-BOND 300515 | 6.25 | 650 | 918 | 104,602 | 2030/5/15 |
| | 6.5 T-BOND 261115 | 6.5 | 500 | 675 | 76,927 | 2026/11/15 |
| | 8 T-BOND 211115 | 8.0 | 800 | 1,011 | 115,236 | 2021/11/15 |
| | 8.125 T-BOND 190815 | 8.125 | 600 | 689 | 78,541 | 2019/8/15 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|------|------|--------------------------|-------|---------|---------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | 国債証券 | 8.75 T-BOND 200815 | 8.75 | 700 | 857 | 97,753 | 2020/8/15 |
| | | 8.875 T-BOND 190215 | 8.875 | 1,000 | 1,132 | 129,077 | 2019/2/15 |
| 小 計 | | | | | | 58,095,390 | |
| カナダ | | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| | 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 180501 | 0.25 | 900 | 896 | 74,540 | 2018/5/1 |
| | | 0.5 CAN GOVT 180801 | 0.5 | 800 | 798 | 66,378 | 2018/8/1 |
| | | 0.5 CAN GOVT 181101 | 0.5 | 1,200 | 1,197 | 99,511 | 2018/11/1 |
| | | 0.5 CAN GOVT 190201 | 0.5 | 400 | 398 | 33,151 | 2019/2/1 |
| | | 0.5 CAN GOVT 220301 | 0.5 | 1,200 | 1,170 | 97,272 | 2022/3/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 190501 | 0.75 | 800 | 800 | 66,560 | 2019/5/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 200901 | 0.75 | 1,600 | 1,594 | 132,557 | 2020/9/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 210301 | 0.75 | 1,300 | 1,291 | 107,378 | 2021/3/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 210901 | 0.75 | 1,000 | 990 | 82,333 | 2021/9/1 |
| | | 1 CAN GOVT 220901 | 1.0 | 250 | 248 | 20,661 | 2022/9/1 |
| | | 1 CAN GOVT 270601 | 1.0 | 500 | 472 | 39,247 | 2027/6/1 |
| | | 1.25 CAN GOVT 180901 | 1.25 | 1,200 | 1,209 | 100,513 | 2018/9/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 200301 | 1.5 | 1,000 | 1,019 | 84,778 | 2020/3/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 230601 | 1.5 | 1,000 | 1,017 | 84,614 | 2023/6/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 260601 | 1.5 | 1,000 | 1,000 | 83,170 | 2026/6/1 |
| | | 1.75 CAN GOVT 190301 | 1.75 | 900 | 917 | 76,243 | 2019/3/1 |
| | | 1.75 CAN GOVT 190901 | 1.75 | 1,500 | 1,534 | 127,575 | 2019/9/1 |
| | | 2.25 CAN GOVT 250601 | 2.25 | 1,000 | 1,065 | 88,565 | 2025/6/1 |
| | | 2.5 CAN GOVT 240601 | 2.5 | 1,000 | 1,080 | 89,849 | 2024/6/1 |
| | | 2.75 CAN GOVT 220601 | 2.75 | 950 | 1,028 | 85,474 | 2022/6/1 |
| | | 2.75 CAN GOVT 481201 | 2.75 | 850 | 946 | 78,708 | 2048/12/1 |
| | | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75 | 320 | 370 | 30,773 | 2064/12/1 |
| | | 3.25 CAN GOVT 210601 | 3.25 | 800 | 872 | 72,568 | 2021/6/1 |
| | | 3.5 CAN GOVT 200601 | 3.5 | 900 | 972 | 80,846 | 2020/6/1 |
| | | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 1,200 | 1,508 | 125,361 | 2045/12/1 |
| | | 3.75 CAN GOVT 190601 | 3.75 | 1,400 | 1,486 | 123,560 | 2019/6/1 |
| | | 4 CAN GOVT 410601 | 4.0 | 1,100 | 1,455 | 121,034 | 2041/6/1 |
| | | 4.25 CAN GOVT 180601 | 4.25 | 1,000 | 1,037 | 86,254 | 2018/6/1 |
| | | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 950 | 1,384 | 115,110 | 2037/6/1 |
| | | 5.75 CAN GOVT 290601 | 5.75 | 950 | 1,355 | 112,683 | 2029/6/1 |
| | | 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 900 | 1,357 | 112,856 | 2033/6/1 |
| | | 8 CAN GOVT 270601 | 8.0 | 250 | 398 | 33,105 | 2027/6/1 |
| 小 計 | | | | | | 2,733,243 | |
| 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 | 19,400 | 22,577 | 136,596 | 2024/12/5 |
| | | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 4,700 | 5,888 | 35,623 | 2036/11/20 |
| | | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 4.75 | 10,600 | 10,386 | 62,840 | 2018/6/14 |
| | | 5 MEXICAN BONOS 191211 | 5.0 | 20,900 | 19,911 | 120,462 | 2019/12/11 |
| | | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 9,000 | 8,153 | 49,326 | 2026/3/5 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5 | 25,400 | 24,833 | 150,241 | 2021/6/10 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 10,000 | 9,726 | 58,845 | 2022/6/9 |
| | | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 7,500 | 7,628 | 46,149 | 2027/6/3 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 9,800 | 10,078 | 60,976 | 2031/5/29 |

| 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 | | |
| メキシコ | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | | |
| 国債証券 | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 7,150 | 7,334 | 44,374 | 2034/11/23 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 14,400 | 14,701 | 88,945 | 2042/11/13 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 8.0 | 11,700 | 11,990 | 72,544 | 2020/6/11 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 7,650 | 7,982 | 48,294 | 2023/12/7 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 8.0 | 1,300 | 1,364 | 8,252 | 2047/11/7 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 8.5 | 17,300 | 17,700 | 107,089 | 2018/12/13 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 6,600 | 7,218 | 43,672 | 2029/5/31 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 6,800 | 7,481 | 45,264 | 2038/11/18 | |
| 小 計 | | | | | 1,179,500 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 BUND 260815 | — | 1,900 | 1,839 | 227,785 | 2026/8/15 |
| | | 0 OBL 200417 | — | 1,250 | 1,272 | 157,554 | 2020/4/17 |
| | | 0 OBL 210409 | — | 1,700 | 1,731 | 214,389 | 2021/4/9 |
| | | 0 OBL 211008 | — | 1,000 | 1,017 | 125,991 | 2021/10/8 |
| | | 0 OBL 220408 | — | 500 | 507 | 62,823 | 2022/4/8 |
| | | 0 SCHATS 180615 | — | 700 | 705 | 87,326 | 2018/6/15 |
| | | 0 SCHATS 180914 | — | 1,200 | 1,211 | 149,958 | 2018/9/14 |
| | | 0 SCHATS 181214 | — | 600 | 606 | 75,084 | 2018/12/14 |
| | | 0.25 BUND 270215 | 0.25 | 500 | 491 | 60,878 | 2027/2/15 |
| | | 0.25 OBL 191011 | 0.25 | 1,700 | 1,736 | 215,016 | 2019/10/11 |
| | | 0.25 OBL 201016 | 0.25 | 1,450 | 1,489 | 184,374 | 2020/10/16 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 1,800 | 1,854 | 229,557 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 2,800 | 2,860 | 354,078 | 2026/2/15 |
| | | 0.5 OBL 190412 | 0.5 | 1,400 | 1,431 | 177,269 | 2019/4/12 |
| | | 1 BUND 240815 | 1.0 | 1,150 | 1,230 | 152,331 | 2024/8/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 1,900 | 2,028 | 251,111 | 2025/8/15 |
| | | 1 OBL 181012 | 1.0 | 1,200 | 1,229 | 152,161 | 2018/10/12 |
| | | 1 OBL 190222 | 1.0 | 1,400 | 1,442 | 178,565 | 2019/2/22 |
| | | 1.5 BUND 220904 | 1.5 | 1,300 | 1,421 | 176,006 | 2022/9/4 |
| | | 1.5 BUND 230215 | 1.5 | 1,200 | 1,316 | 162,984 | 2023/2/15 |
| | | 1.5 BUND 230515 | 1.5 | 1,300 | 1,429 | 176,910 | 2023/5/15 |
| | | 1.5 BUND 240515 | 1.5 | 1,050 | 1,160 | 143,668 | 2024/5/15 |
| | | 1.75 BUND 220704 | 1.75 | 1,700 | 1,878 | 232,509 | 2022/7/4 |
| | | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 1,150 | 1,289 | 159,634 | 2024/2/15 |
| | | 2 BUND 220104 | 2.0 | 1,400 | 1,555 | 192,577 | 2022/1/4 |
| | | 2 BUND 230815 | 2.0 | 1,800 | 2,038 | 252,336 | 2023/8/15 |
| | | 2.25 BUND 200904 | 2.25 | 1,000 | 1,093 | 135,418 | 2020/9/4 |
| | | 2.25 BUND 210904 | 2.25 | 1,100 | 1,228 | 152,065 | 2021/9/4 |
| | | 2.5 BUND 210104 | 2.5 | 1,600 | 1,777 | 220,023 | 2021/1/4 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 1,550 | 2,018 | 249,920 | 2044/7/4 |
| | | 2.5 BUND 460815 | 2.5 | 1,500 | 1,970 | 243,949 | 2046/8/15 |
| | | 3 BUND 200704 | 3.0 | 1,400 | 1,559 | 193,018 | 2020/7/4 |
| | | 3.25 BUND 200104 | 3.25 | 1,300 | 1,435 | 177,727 | 2020/1/4 |
| | | 3.25 BUND 210704 | 3.25 | 2,350 | 2,714 | 336,015 | 2021/7/4 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 1,100 | 1,610 | 199,430 | 2042/7/4 |
| | | 3.5 BUND 190704 | 3.5 | 1,800 | 1,962 | 242,899 | 2019/7/4 |
| | | 3.75 BUND 190104 | 3.75 | 1,900 | 2,039 | 252,541 | 2019/1/4 |

| 銘柄 | | | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ドイツ | 国債証券 | 4 BUND 370104 | 4.0 | 1,700 | 2,631 | 325,790 | 2037/1/4 |
| | | 4.25 BUND 180704 | 4.25 | 1,800 | 1,902 | 235,583 | 2018/7/4 |
| | | 4.25 BUND 390704 | 4.25 | 1,020 | 1,673 | 207,193 | 2039/7/4 |
| | | 4.75 BUND 280704 | 4.75 | 800 | 1,167 | 144,532 | 2028/7/4 |
| | | 4.75 BUND 340704 | 4.75 | 1,450 | 2,358 | 291,953 | 2034/7/4 |
| | | 4.75 BUND 400704 | 4.75 | 1,200 | 2,114 | 261,821 | 2040/7/4 |
| | | 5.5 BUND 310104 | 5.5 | 1,200 | 1,957 | 242,396 | 2031/1/4 |
| | | 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 1,100 | 1,689 | 209,130 | 2028/1/4 |
| | | 6.25 BUND 240104 | 6.25 | 600 | 851 | 105,354 | 2024/1/4 |
| | | 6.25 BUND 300104 | 6.25 | 750 | 1,267 | 156,900 | 2030/1/4 |
| | | 6.5 BUND 270704 | 6.5 | 800 | 1,283 | 158,944 | 2027/7/4 |
| イタリア | 国債証券 | 0.05 ITALY GOVT 191015 | 0.05 | 1,300 | 1,295 | 160,396 | 2019/10/15 |
| | | 0.1 ITALY GOVT 190415 | 0.1 | 900 | 902 | 111,676 | 2019/4/15 |
| | | 0.25 ITALY GOVT 180515 | 0.25 | 200 | 201 | 24,892 | 2018/5/15 |
| | | 0.3 ITALY GOVT 181015 | 0.3 | 700 | 704 | 87,234 | 2018/10/15 |
| | | 0.35 ITALY GOVT 200615 | 0.35 | 800 | 799 | 98,921 | 2020/6/15 |
| | | 0.35 ITALY GOVT 211101 | 0.35 | 400 | 393 | 48,680 | 2021/11/1 |
| | | 0.45 ITALY GOVT 210601 | 0.45 | 1,100 | 1,094 | 135,467 | 2021/6/1 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 201101 | 0.65 | 900 | 907 | 112,401 | 2020/11/1 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 231015 | 0.65 | 500 | 476 | 58,966 | 2023/10/15 |
| | | 0.7 ITALY GOVT 200501 | 0.7 | 1,000 | 1,011 | 125,243 | 2020/5/1 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95 | 1,300 | 1,279 | 158,396 | 2023/3/15 |
| | | 1.05 ITALY GOVT 191201 | 1.05 | 900 | 919 | 113,804 | 2019/12/1 |
| | | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25 | 1,300 | 1,203 | 148,963 | 2026/12/1 |
| | | 1.35 ITALY GOVT 220415 | 1.35 | 1,150 | 1,171 | 144,978 | 2022/4/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45 | 900 | 917 | 113,532 | 2022/9/15 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 190801 | 1.5 | 1,050 | 1,082 | 133,987 | 2019/8/1 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 250601 | 1.5 | 1,350 | 1,310 | 162,281 | 2025/6/1 |
| | | 1.6 ITALY GOVT 260601 | 1.6 | 1,400 | 1,344 | 166,451 | 2026/6/1 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65 | 1,900 | 1,686 | 208,816 | 2032/3/1 |
| | | 1.85 ITALY GOVT 240515 | 1.85 | 150 | 151 | 18,774 | 2024/5/15 |
| | | 2 ITALY GOVT 251201 | 2.0 | 1,300 | 1,298 | 160,811 | 2025/12/1 |
| | | 2.15 ITALY GOVT 211215 | 2.15 | 700 | 742 | 91,911 | 2021/12/15 |
| | | 2.2 ITALY GOVT 270601 | 2.2 | 900 | 893 | 110,621 | 2027/6/1 |
| | | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25 | 900 | 812 | 100,610 | 2036/9/1 |
| | | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45 | 400 | 382 | 47,376 | 2033/9/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 190501 | 2.5 | 1,300 | 1,362 | 168,713 | 2019/5/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 241201 | 2.5 | 1,400 | 1,467 | 181,647 | 2024/12/1 |
| | | 2.7 ITALY GOVT 470301 | 2.7 | 1,100 | 967 | 119,807 | 2047/3/1 |
| | | 2.8 ITALY GOVT 670301 | 2.8 | 400 | 330 | 40,950 | 2067/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 1,000 | 987 | 122,311 | 2046/9/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 180601 | 3.5 | 1,300 | 1,351 | 167,350 | 2018/6/1 |
| 3.5 ITALY GOVT 181201 | 3.5 | 1,400 | 1,477 | 182,930 | 2018/12/1 | | |
| 3.5 ITALY GOVT 300301 | 3.5 | 1,300 | 1,430 | 177,084 | 2030/3/1 | | |
| 3.75 ITALY GOVT 210301 | 3.75 | 2,000 | 2,245 | 277,948 | 2021/3/1 | | |
| 3.75 ITALY GOVT 210501 | 3.75 | 1,900 | 2,136 | 264,493 | 2021/5/1 | | |
| 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3.75 | 2,600 | 2,933 | 363,151 | 2021/8/1 | | |

| 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 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75 | 1,700 | 1,930 | 238,999 | 2024/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 200901 | 4.0 | 1,400 | 1,565 | 193,758 | 2020/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 370201 | 4.0 | 2,000 | 2,296 | 284,356 | 2037/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190201 | 4.25 | 2,300 | 2,468 | 305,566 | 2019/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190901 | 4.25 | 2,100 | 2,298 | 284,555 | 2019/9/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 200301 | 4.25 | 1,650 | 1,833 | 227,025 | 2020/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 180801 | 4.5 | 2,100 | 2,220 | 274,877 | 2018/8/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 190301 | 4.5 | 2,000 | 2,161 | 267,624 | 2019/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 200201 | 4.5 | 1,700 | 1,894 | 234,590 | 2020/2/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 230501 | 4.5 | 1,600 | 1,891 | 234,118 | 2023/5/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 240301 | 4.5 | 1,550 | 1,836 | 227,379 | 2024/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 260301 | 4.5 | 1,500 | 1,793 | 221,980 | 2026/3/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 210901 | 4.75 | 3,000 | 3,511 | 434,762 | 2021/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75 | 2,600 | 3,127 | 387,124 | 2023/8/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75 | 1,400 | 1,714 | 212,289 | 2028/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75 | 1,100 | 1,367 | 169,304 | 2044/9/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 220301 | 5.0 | 1,500 | 1,784 | 220,881 | 2022/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 250301 | 5.0 | 1,750 | 2,148 | 265,964 | 2025/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 340801 | 5.0 | 2,000 | 2,566 | 317,726 | 2034/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 390801 | 5.0 | 1,700 | 2,189 | 271,025 | 2039/8/1 |
| 5 ITALY GOVT 400901 | 5.0 | 1,600 | 2,042 | 252,806 | 2040/9/1 | | |
| 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 1,900 | 2,449 | 303,203 | 2029/11/1 | | |
| 5.5 ITALY GOVT 220901 | 5.5 | 1,400 | 1,718 | 212,708 | 2022/9/1 | | |
| 5.5 ITALY GOVT 221101 | 5.5 | 1,300 | 1,598 | 197,899 | 2022/11/1 | | |
| 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75 | 1,150 | 1,582 | 195,943 | 2033/2/1 | | |
| 6 ITALY GOVT 310501 | 6.0 | 2,250 | 3,127 | 387,197 | 2031/5/1 | | |
| 6.5 ITALY GOVT 271101 | 6.5 | 2,200 | 3,053 | 378,016 | 2027/11/1 | | |
| 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 950 | 1,366 | 169,138 | 2026/11/1 | | |
| 9 ITALY GOVT 231101 | 9.0 | 1,000 | 1,462 | 181,023 | 2023/11/1 | | |
| フランス | 国債証券 | 0 O. A. T 190225 | — | 700 | 706 | 87,491 | 2019/2/25 |
| | | 0 O. A. T 200225 | — | 1,700 | 1,721 | 213,153 | 2020/2/25 |
| | | 0 O. A. T 200525 | — | 2,250 | 2,279 | 282,158 | 2020/5/25 |
| | | 0 O. A. T 210525 | — | 1,600 | 1,615 | 199,994 | 2021/5/25 |
| | | 0 O. A. T 220525 | — | 1,500 | 1,502 | 186,001 | 2022/5/25 |
| | | 0.25 O. A. T 201125 | 0.25 | 1,400 | 1,429 | 176,985 | 2020/11/25 |
| | | 0.25 O. A. T 261125 | 0.25 | 1,450 | 1,375 | 170,251 | 2026/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 191125 | 0.5 | 2,100 | 2,152 | 266,532 | 2019/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 250525 | 0.5 | 2,800 | 2,792 | 345,706 | 2025/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 260525 | 0.5 | 2,100 | 2,059 | 254,905 | 2026/5/25 |
| | | 1 O. A. T 180525 | 1.0 | 1,700 | 1,727 | 213,871 | 2018/5/25 |
| | | 1 O. A. T 181125 | 1.0 | 1,700 | 1,740 | 215,421 | 2018/11/25 |
| | | 1 O. A. T 190525 | 1.0 | 1,700 | 1,752 | 216,998 | 2019/5/25 |
| | | 1 O. A. T 251125 | 1.0 | 1,900 | 1,959 | 242,584 | 2025/11/25 |
| | | 1.25 O. A. T 360525 | 1.25 | 1,350 | 1,278 | 158,335 | 2036/5/25 |
| | | 1.5 O. A. T 310525 | 1.5 | 2,050 | 2,115 | 261,946 | 2031/5/25 |
| | | 1.75 O. A. T 230525 | 1.75 | 2,600 | 2,852 | 353,178 | 2023/5/25 |
| | | 1.75 O. A. T 241125 | 1.75 | 2,650 | 2,912 | 360,550 | 2024/11/25 |

| 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 | |
| フランス | 国債証券 | 1.75 O.A.T 390625 | 1.75 | 900 | 911 | 112,861 | 2039/6/25 |
| | | 1.75 O.A.T 660525 | 1.75 | 550 | 490 | 60,717 | 2066/5/25 |
| | | 2.25 O.A.T 221025 | 2.25 | 2,050 | 2,299 | 284,623 | 2022/10/25 |
| | | 2.25 O.A.T 240525 | 2.25 | 1,800 | 2,042 | 252,916 | 2024/5/25 |
| | | 2.5 O.A.T 201025 | 2.5 | 2,500 | 2,749 | 340,331 | 2020/10/25 |
| | | 2.5 O.A.T 300525 | 2.5 | 3,000 | 3,487 | 431,711 | 2030/5/25 |
| | | 2.75 O.A.T 271025 | 2.75 | 2,400 | 2,839 | 351,515 | 2027/10/25 |
| | | 3 O.A.T 220425 | 3.0 | 3,100 | 3,574 | 442,522 | 2022/4/25 |
| | | 3.25 O.A.T 211025 | 3.25 | 2,800 | 3,229 | 399,800 | 2021/10/25 |
| | | 3.25 O.A.T 450525 | 3.25 | 1,650 | 2,143 | 265,363 | 2045/5/25 |
| | | 3.5 O.A.T 200425 | 3.5 | 2,700 | 3,015 | 373,365 | 2020/4/25 |
| | | 3.5 O.A.T 260425 | 3.5 | 2,850 | 3,552 | 439,856 | 2026/4/25 |
| | | 3.75 O.A.T 191025 | 3.75 | 2,600 | 2,873 | 355,730 | 2019/10/25 |
| | | 3.75 O.A.T 210425 | 3.75 | 3,100 | 3,596 | 445,246 | 2021/4/25 |
| | | 4 O.A.T 381025 | 4.0 | 1,950 | 2,797 | 346,362 | 2038/10/25 |
| | | 4 O.A.T 550425 | 4.0 | 1,040 | 1,585 | 196,309 | 2055/4/25 |
| | | 4 O.A.T 600425 | 4.0 | 920 | 1,426 | 176,634 | 2060/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 181025 | 4.25 | 1,900 | 2,032 | 251,657 | 2018/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 190425 | 4.25 | 2,250 | 2,461 | 304,716 | 2019/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 3,250 | 4,098 | 507,362 | 2023/10/25 |
| | | 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 2,150 | 3,327 | 411,882 | 2041/4/25 |
| | | 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 2,050 | 3,125 | 386,953 | 2035/4/25 |
| | | 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 2,250 | 3,390 | 419,693 | 2029/4/25 |
| | | 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 2,150 | 3,498 | 433,133 | 2032/10/25 |
| | | 6 O.A.T 251025 | 6.0 | 1,900 | 2,759 | 341,656 | 2025/10/25 |
| | | 8.5 O.A.T 191025 | 8.5 | 900 | 1,099 | 136,168 | 2019/10/25 |
| | | 8.5 O.A.T 230425 | 8.5 | 700 | 1,050 | 129,998 | 2023/4/25 |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 220115 | — | 300 | 303 | 37,567 | 2022/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 200115 | 0.25 | 900 | 919 | 113,865 | 2020/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25 | 900 | 894 | 110,760 | 2025/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 1,300 | 1,302 | 161,298 | 2026/7/15 |
| | | 0.75 NETH GOVT 270715 | 0.75 | 250 | 252 | 31,290 | 2027/7/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 190115 | 1.25 | 1,200 | 1,238 | 153,297 | 2019/1/15 |
| | | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1.75 | 1,100 | 1,220 | 151,074 | 2023/7/15 |
| | | 2 NETH GOVT 240715 | 2.0 | 1,100 | 1,245 | 154,178 | 2024/7/15 |
| | | 2.25 NETH GOVT 220715 | 2.25 | 1,000 | 1,127 | 139,585 | 2022/7/15 |
| | | 2.5 NETH GOVT 330115 | 2.5 | 1,000 | 1,236 | 153,034 | 2033/1/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 850 | 1,159 | 143,506 | 2047/1/15 |
| | | 3.25 NETH GOVT 210715 | 3.25 | 2,300 | 2,650 | 328,116 | 2021/7/15 |
| | | 3.5 NETH GOVT 200715 | 3.5 | 700 | 789 | 97,749 | 2020/7/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 230115 | 3.75 | 400 | 488 | 60,440 | 2023/1/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 1,150 | 1,789 | 221,581 | 2042/1/15 |
| | | 4 NETH GOVT 180715 | 4.0 | 1,000 | 1,054 | 130,579 | 2018/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 190715 | 4.0 | 1,100 | 1,210 | 149,853 | 2019/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 1,100 | 1,689 | 209,171 | 2037/1/15 |
| | | 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 1,100 | 1,658 | 205,333 | 2028/1/15 |
| | | 7.5 NETH GOVT 230115 | 7.5 | 700 | 1,004 | 124,296 | 2023/1/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|------------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | 0.25 SPAIN GOVT 180430 | 0.25 | 1,000 | 1,005 | 124,498 | 2018/4/30 |
| | | 0.25 SPAIN GOVT 190131 | 0.25 | 500 | 504 | 62,440 | 2019/1/31 |
| | | 0.4 SPAIN GOVT 220430 | 0.4 | 150 | 149 | 18,554 | 2022/4/30 |
| | | 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75 | 1,900 | 1,946 | 241,027 | 2021/7/30 |
| | | 1.15 SPAIN GOVT 200730 | 1.15 | 1,000 | 1,040 | 128,758 | 2020/7/30 |
| | | 1.3 SPAIN GOVT 261031 | 1.3 | 1,300 | 1,274 | 157,813 | 2026/10/31 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 200131 | 1.4 | 1,600 | 1,669 | 206,641 | 2020/1/31 |
| | | 1.5 SPAIN GOVT 270430 | 1.5 | 1,050 | 1,036 | 128,320 | 2027/4/30 |
| | | 1.6 SPAIN GOVT 250430 | 1.6 | 1,600 | 1,641 | 203,264 | 2025/4/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | 1,450 | 1,509 | 186,828 | 2026/4/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95 | 1,500 | 1,477 | 182,888 | 2030/7/30 |
| | | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15 | 1,600 | 1,696 | 210,064 | 2025/10/31 |
| | | 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 2.35 | 100 | 99 | 12,337 | 2033/7/30 |
| | | 2.75 SPAIN GOVT 190430 | 2.75 | 1,600 | 1,695 | 209,872 | 2019/4/30 |
| | | 2.75 SPAIN GOVT 241031 | 2.75 | 2,250 | 2,507 | 310,416 | 2024/10/31 |
| | | 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2.9 | 800 | 787 | 97,512 | 2046/10/31 |
| | | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45 | 300 | 308 | 38,137 | 2066/7/30 |
| | | 3.75 SPAIN GOVT 181031 | 3.75 | 2,200 | 2,333 | 288,899 | 2018/10/31 |
| | | 3.8 SPAIN GOVT 240430 | 3.8 | 1,200 | 1,427 | 176,682 | 2024/4/30 |
| | | 4 SPAIN GOVT 200430 | 4.0 | 1,600 | 1,794 | 222,197 | 2020/4/30 |
| | | 4.1 SPAIN GOVT 180730 | 4.1 | 1,600 | 1,685 | 208,635 | 2018/7/30 |
| | | 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 4.2 | 1,550 | 1,934 | 239,520 | 2037/1/31 |
| | | 4.3 SPAIN GOVT 191031 | 4.3 | 1,700 | 1,887 | 233,728 | 2019/10/31 |
| | | 4.4 SPAIN GOVT 231031 | 4.4 | 1,500 | 1,839 | 227,740 | 2023/10/31 |
| | | 4.6 SPAIN GOVT 190730 | 4.6 | 1,500 | 1,660 | 205,543 | 2019/7/30 |
| | | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | 1,650 | 2,075 | 256,941 | 2025/7/30 |
| | | 4.7 SPAIN GOVT 410730 | 4.7 | 1,100 | 1,471 | 182,117 | 2041/7/30 |
| | | 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 4.8 | 1,200 | 1,505 | 186,340 | 2024/1/31 |
| | | 4.85 SPAIN GOVT 201031 | 4.85 | 1,550 | 1,812 | 224,354 | 2020/10/31 |
| | | 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 4.9 | 1,150 | 1,568 | 194,233 | 2040/7/30 |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | 950 | 1,275 | 157,877 | 2028/10/31 | | |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15 | 850 | 1,202 | 148,929 | 2044/10/31 | | |
| 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 5.4 | 2,200 | 2,793 | 345,808 | 2023/1/31 | | |
| 5.5 SPAIN GOVT 210430 | 5.5 | 1,700 | 2,065 | 255,761 | 2021/4/30 | | |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 1,450 | 2,112 | 261,544 | 2032/7/30 | | |
| 5.85 SPAIN GOVT 220131 | 5.85 | 1,700 | 2,140 | 264,979 | 2022/1/31 | | |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 5.9 | 1,000 | 1,378 | 170,617 | 2026/7/30 | | |
| 6 SPAIN GOVT 290131 | 6.0 | 1,800 | 2,582 | 319,670 | 2029/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | 0.2 BEL GOVT 231022 | 0.2 | 200 | 200 | 24,820 | 2023/10/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 250622 | 0.8 | 1,900 | 1,944 | 240,725 | 2025/6/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 270622 | 0.8 | 600 | 597 | 73,950 | 2027/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 900 | 926 | 114,642 | 2026/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 310622 | 1.0 | 800 | 777 | 96,261 | 2031/6/22 |
| | | 1.25 BEL GOVT 180622 | 1.25 | 700 | 714 | 88,419 | 2018/6/22 |
| | | 1.6 BEL GOVT 470622 | 1.6 | 450 | 420 | 52,087 | 2047/6/22 |
| | | 1.9 BEL GOVT 380622 | 1.9 | 100 | 105 | 13,119 | 2038/6/22 |
| | | 2.15 BEL GOVT 660622 | 2.15 | 200 | 197 | 24,451 | 2066/6/22 |

| 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 | 2.25 BEL GOVT 230622 | 2.25 | 1,150 | 1,304 | 161,494 | 2023/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 570622 | 2.25 | 200 | 207 | 25,655 | 2057/6/22 |
| | | 2.6 BEL GOVT 240622 | 2.6 | 1,100 | 1,278 | 158,291 | 2024/6/22 |
| | | 3 BEL GOVT 190928 | 3.0 | 1,000 | 1,084 | 134,246 | 2019/9/28 |
| | | 3 BEL GOVT 340622 | 3.0 | 450 | 564 | 69,858 | 2034/6/22 |
| | | 3.75 BEL GOVT 200928 | 3.75 | 1,450 | 1,654 | 204,886 | 2020/9/28 |
| | | 3.75 BEL GOVT 450622 | 3.75 | 700 | 1,002 | 124,052 | 2045/6/22 |
| | | 4 BEL GOVT 190328 | 4.0 | 900 | 977 | 121,001 | 2019/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 220328 | 4.0 | 1,100 | 1,325 | 164,137 | 2022/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 320328 | 4.0 | 550 | 759 | 94,064 | 2032/3/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 210928 | 4.25 | 1,150 | 1,378 | 170,597 | 2021/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 220928 | 4.25 | 1,100 | 1,356 | 167,930 | 2022/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 1,550 | 2,350 | 290,970 | 2041/3/28 |
| | | 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 600 | 806 | 99,805 | 2026/3/28 |
| | | 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 1,450 | 2,297 | 284,454 | 2035/3/28 |
| 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 1,400 | 2,085 | 258,227 | 2028/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 230715 | — | 100 | 99 | 12,329 | 2023/7/15 |
| | | 0.25 AUSTRIA GOVT 191018 | 0.25 | 500 | 509 | 63,071 | 2019/10/18 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | 1,200 | 1,220 | 151,037 | 2026/10/20 |
| | | 1.15 AUSTRIA GOVT 181019 | 1.15 | 500 | 512 | 63,439 | 2018/10/19 |
| | | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020 | 1.2 | 1,000 | 1,066 | 132,038 | 2025/10/20 |
| | | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220 | 1.5 | 250 | 246 | 30,558 | 2047/2/20 |
| | | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65 | 500 | 551 | 68,293 | 2024/10/21 |
| | | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 850 | 942 | 116,694 | 2023/10/20 |
| | | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 1.95 | 500 | 526 | 65,147 | 2019/6/18 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 600 | 722 | 89,492 | 2034/5/23 |
| | | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | 450 | 620 | 76,783 | 2044/6/20 |
| | | 3.4 AUSTRIA GOVT 221122 | 3.4 | 750 | 894 | 110,753 | 2022/11/22 |
| | | 3.5 AUSTRIA GOVT 210915 | 3.5 | 1,350 | 1,572 | 194,700 | 2021/9/15 |
| | | 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 3.65 | 600 | 713 | 88,318 | 2022/4/20 |
| | | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 3.8 | 250 | 415 | 51,447 | 2062/1/26 |
| | | 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 3.9 | 1,000 | 1,138 | 140,910 | 2020/7/15 |
| | | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15 | 850 | 1,288 | 159,545 | 2037/3/15 |
| | | 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 4.35 | 800 | 872 | 108,002 | 2019/3/15 |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 650 | 902 | 111,725 | 2026/3/15 | | |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 600 | 941 | 116,577 | 2027/7/15 | | |
| フィンランド | 国債証券 | 0 FINNISH GOVT 220415 | — | 150 | 151 | 18,706 | 2022/4/15 |
| | | 0 FINNISH GOVT 230915 | — | 500 | 496 | 61,503 | 2023/9/15 |
| | | 0.375 FINNISH GOV 200915 | 0.375 | 400 | 410 | 50,802 | 2020/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 0.5 | 400 | 400 | 49,566 | 2026/4/15 |
| | | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75 | 300 | 293 | 36,305 | 2031/4/15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 100 | 103 | 12,868 | 2025/9/15 |
| | | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 1.125 | 200 | 204 | 25,352 | 2018/9/15 |
| | | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 1.5 | 400 | 435 | 53,900 | 2023/4/15 |
| | | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 1.625 | 400 | 436 | 54,045 | 2022/9/15 |
| | | 2 FINNISH GOVT 240415 | 2.0 | 300 | 337 | 41,809 | 2024/4/15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 350 | 454 | 56,294 | 2042/7/4 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | | | |
|--------|------|--------------------------|-------|-------|-------|----------|------------|------------|--|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| フィンランド | 国債証券 | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 350 | 427 | 52,926 | 2028/7/4 | | |
| | | 3.375 FINNISH GOV 200415 | 3.375 | 500 | 556 | 68,890 | 2020/4/15 | | |
| | | 3.5 FINNISH GOVT 210415 | 3.5 | 400 | 460 | 56,990 | 2021/4/15 | | |
| | | 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 550 | 713 | 88,312 | 2025/7/4 | | |
| | | 4.375 FINNISH GOV 190704 | 4.375 | 550 | 608 | 75,317 | 2019/7/4 | | |
| アイルランド | 国債証券 | 0.8 IRISH GOVT 220315 | 0.8 | 400 | 416 | 51,544 | 2022/3/15 | | |
| | | 1 IRISH GOVT 260515 | 1.0 | 650 | 656 | 81,233 | 2026/5/15 | | |
| | | 1.7 IRISH GOVT 370515 | 1.7 | 300 | 294 | 36,492 | 2037/5/15 | | |
| | | 2 IRISH GOVT 450218 | 2.0 | 500 | 496 | 61,465 | 2045/2/18 | | |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 650 | 729 | 90,348 | 2030/5/15 | | |
| | | 3.4 IRISH GOVT 240318 | 3.4 | 500 | 600 | 74,320 | 2024/3/18 | | |
| | | 3.9 IRISH GOVT 230320 | 3.9 | 400 | 486 | 60,269 | 2023/3/20 | | |
| | | 4.4 IRISH GOVT 190618 | 4.4 | 500 | 551 | 68,293 | 2019/6/18 | | |
| | | 4.5 IRISH GOVT 181018 | 4.5 | 650 | 696 | 86,207 | 2018/10/18 | | |
| | | 4.5 IRISH GOVT 200418 | 4.5 | 1,000 | 1,142 | 141,463 | 2020/4/18 | | |
| | | 5 IRISH GOVT 201018 | 5.0 | 600 | 709 | 87,881 | 2020/10/18 | | |
| | | 5.4 IRISH GOVT 250313 | 5.4 | 900 | 1,225 | 151,726 | 2025/3/13 | | |
| | | 5.9 IRISH GOVT 191018 | 5.9 | 500 | 577 | 71,496 | 2019/10/18 | | |
| | | 小 計 | | | | | | 51,807,531 | |
| | | 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 | 900 | 897 | 131,678 | 2022/7/22 | | |
| | | 1.25 GILT 180722 | 1.25 | 2,100 | 2,128 | 312,441 | 2018/7/22 | | |
| | | 1.25 GILT 270722 | 1.25 | 450 | 450 | 66,109 | 2027/7/22 | | |
| | | 1.5 GILT 210122 | 1.5 | 1,850 | 1,931 | 283,504 | 2021/1/22 | | |
| | | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 1,700 | 1,758 | 258,154 | 2026/7/22 | | |
| | | 1.5 GILT 470722 | 1.5 | 400 | 372 | 54,702 | 2047/7/22 | | |
| | | 1.75 GILT 190722 | 1.75 | 2,100 | 2,175 | 319,232 | 2019/7/22 | | |
| | | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 2,000 | 2,128 | 312,337 | 2022/9/7 | | |
| | | 1.75 GILT 370907 | 1.75 | 300 | 296 | 43,560 | 2037/9/7 | | |
| | | 1.75 GILT 570722 | 1.75 | 1,100 | 1,125 | 165,131 | 2057/7/22 | | |
| | | 2 GILT 200722 | 2.0 | 1,800 | 1,902 | 279,179 | 2020/7/22 | | |
| | | 2 GILT 250907 | 2.0 | 1,600 | 1,734 | 254,528 | 2025/9/7 | | |
| | | 2.25 GILT 230907 | 2.25 | 1,800 | 1,975 | 289,957 | 2023/9/7 | | |
| | | 2.5 GILT 650722 | 2.5 | 810 | 1,038 | 152,462 | 2065/7/22 | | |
| | | 2.75 GILT 240907 | 2.75 | 1,500 | 1,706 | 250,434 | 2024/9/7 | | |
| | | 3.25 GILT 440122 | 3.25 | 1,950 | 2,520 | 370,002 | 2044/1/22 | | |
| | | 3.5 GILT 450122 | 3.5 | 1,600 | 2,172 | 318,891 | 2045/1/22 | | |
| | | 3.5 GILT 680722 | 3.5 | 1,370 | 2,247 | 329,848 | 2068/7/22 | | |
| | | 3.75 GILT 190907 | 3.75 | 1,300 | 1,409 | 206,931 | 2019/9/7 | | |
| | | 3.75 GILT 200907 | 3.75 | 1,200 | 1,342 | 196,966 | 2020/9/7 | | |
| | | 3.75 GILT 210907 | 3.75 | 1,600 | 1,835 | 269,382 | 2021/9/7 | | |
| | | 3.75 GILT 520722 | 3.75 | 1,370 | 2,100 | 308,241 | 2052/7/22 | | |
| | | 4 GILT 220307 | 4.0 | 1,050 | 1,230 | 180,632 | 2022/3/7 | | |
| | | 4 GILT 600122 | 4.0 | 800 | 1,374 | 201,686 | 2060/1/22 | | |
| | | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 850 | 1,110 | 162,934 | 2027/12/7 | | |
| | | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 1,200 | 1,633 | 239,759 | 2032/6/7 | | |
| | | 4.25 GILT 360307 | 4.25 | 1,635 | 2,297 | 337,254 | 2036/3/7 | | |

| 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 | 4.25 GILT 390907 | 4.25 1,120 | 1,620 | 237,805 | 2039/9/7 |
| | | 4.25 GILT 401207 | 4.25 1,250 | 1,831 | 268,735 | 2040/12/7 |
| | | 4.25 GILT 461207 | 4.25 1,250 | 1,942 | 285,045 | 2046/12/7 |
| | | 4.25 GILT 491207 | 4.25 1,030 | 1,659 | 243,632 | 2049/12/7 |
| | | 4.25 GILT 551207 | 4.25 1,250 | 2,158 | 316,752 | 2055/12/7 |
| | | 4.5 GILT 190307 | 4.5 1,300 | 1,404 | 206,097 | 2019/3/7 |
| | | 4.5 GILT 340907 | 4.5 1,500 | 2,138 | 313,833 | 2034/9/7 |
| | | 4.5 GILT 421207 | 4.5 1,150 | 1,778 | 260,984 | 2042/12/7 |
| | | 4.75 GILT 200307 | 4.75 1,200 | 1,355 | 199,017 | 2020/3/7 |
| | | 4.75 GILT 301207 | 4.75 1,050 | 1,481 | 217,390 | 2030/12/7 |
| | | 4.75 GILT 381207 | 4.75 1,220 | 1,868 | 274,304 | 2038/12/7 |
| | | 5 GILT 250307 | 5.0 850 | 1,116 | 163,889 | 2025/3/7 |
| | | 6 GILT 281207 | 6.0 750 | 1,135 | 166,687 | 2028/12/7 |
| | | 8 GILT 210607 | 8.0 800 | 1,050 | 154,200 | 2021/6/7 |
| 小 | 計 | | | | 9,604,323 | |
| スイス | | | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | |
| | 国債証券 | 2 SWISS GOVT 210428 | 2.0 340 | 376 | 42,541 | 2021/4/28 |
| | | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 2.25 310 | 339 | 38,385 | 2020/7/6 |
| | | 3 SWISS GOVT 190512 | 3.0 400 | 431 | 48,731 | 2019/5/12 |
| | | 4 SWISS GOVT 230211 | 4.0 280 | 352 | 39,904 | 2023/2/11 |
| | | 4 SWISS GOVT 280408 | 4.0 430 | 619 | 70,004 | 2028/4/8 |
| 小 | 計 | | | | 239,568 | |
| スウェーデン | | | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ | | |
| | 国債証券 | 1 SWD GOVT 261112 | 1.0 4,700 | 4,865 | 62,419 | 2026/11/12 |
| | | 1.5 SWD GOVT 231113 | 1.5 6,600 | 7,146 | 91,685 | 2023/11/13 |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 4,700 | 5,467 | 70,148 | 2025/5/12 |
| | | 3.5 SWD GOVT 220601 | 3.5 6,850 | 8,077 | 103,628 | 2022/6/1 |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 3,250 | 4,388 | 56,310 | 2039/3/30 |
| | | 4.25 SWD GOVT 190312 | 4.25 7,200 | 7,848 | 100,702 | 2019/3/12 |
| | | 5 SWD GOVT 201201 | 5.0 6,800 | 8,092 | 103,822 | 2020/12/1 |
| 小 | 計 | | | | 588,717 | |
| 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 2,600 | 2,592 | 34,349 | 2026/2/19 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1.75 3,050 | 3,116 | 41,289 | 2025/3/13 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 270217 | 1.75 1,550 | 1,565 | 20,748 | 2027/2/17 |
| | | 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 4,200 | 4,385 | 58,101 | 2023/5/24 |
| | | 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 3,250 | 3,598 | 47,681 | 2024/3/14 |
| | | 3.75 NORWE GOVT 210525 | 3.75 5,900 | 6,550 | 86,791 | 2021/5/25 |
| | | 4.5 NORWE GOVT 190522 | 4.5 5,700 | 6,142 | 81,386 | 2019/5/22 |
| 小 | 計 | | | | 370,348 | |
| デンマーク | | | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | |
| | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 181115 | 0.25 3,200 | 3,239 | 53,901 | 2018/11/15 |
| | | 0.5 DMK GOVT 271115 | 0.5 1,550 | 1,520 | 25,308 | 2027/11/15 |
| | | 1.5 DMK GOVT 231115 | 1.5 3,600 | 3,927 | 65,359 | 2023/11/15 |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 1.75 7,100 | 7,917 | 131,754 | 2025/11/15 |
| | | 3 DMK GOVT 211115 | 3.0 6,800 | 7,788 | 129,607 | 2021/11/15 |
| | | 4 DMK GOVT 191115 | 4.0 6,950 | 7,716 | 128,409 | 2019/11/15 |

| 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 | | |
| 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 | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 | 9,400 | 15,613 | 259,809 | 2039/11/15 |
| 小計 | | | | | 794,151 | |
| ポーランド | | | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | | |
| 国債証券 | 1.5 POLAND 200425 | 1.5 | 1,900 | 1,860 | 54,517 | 2020/4/25 |
| | 1.75 POLAND 210725 | 1.75 | 2,700 | 2,609 | 76,443 | 2021/7/25 |
| | 2 POLAND 210425 | 2.0 | 2,000 | 1,958 | 57,381 | 2021/4/25 |
| | 2.25 POLAND 220425 | 2.25 | 850 | 829 | 24,302 | 2022/4/25 |
| | 2.5 POLAND 180725 | 2.5 | 1,600 | 1,617 | 47,386 | 2018/7/25 |
| | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 2,900 | 2,731 | 80,037 | 2026/7/25 |
| | 2.5 POLAND 270725 | 2.5 | 1,400 | 1,298 | 38,031 | 2027/7/25 |
| | 3.25 POLAND 190725 | 3.25 | 2,000 | 2,052 | 60,147 | 2019/7/25 |
| | 3.25 POLAND 250725 | 3.25 | 1,900 | 1,912 | 56,035 | 2025/7/25 |
| | 4 POLAND 231025 | 4.0 | 2,250 | 2,384 | 69,870 | 2023/10/25 |
| | 5.25 POLAND 201025 | 5.25 | 1,300 | 1,422 | 41,678 | 2020/10/25 |
| | 5.5 POLAND 191025 | 5.5 | 1,300 | 1,404 | 41,157 | 2019/10/25 |
| | 5.75 POLAND 211025 | 5.75 | 1,300 | 1,467 | 43,007 | 2021/10/25 |
| | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 1,650 | 1,885 | 55,258 | 2022/9/23 |
| | 5.75 POLAND 290425 | 5.75 | 600 | 741 | 21,718 | 2029/4/25 |
| | POLAND 181025 | — | 2,000 | 1,948 | 57,096 | 2018/10/25 |
| | POLAND 190425 | — | 900 | 865 | 25,367 | 2019/4/25 |
| 小計 | | | | | 849,437 | |
| オーストラリア | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 201121 | 1.75 | 1,450 | 1,440 | 121,146 | 2020/11/21 |
| | 2 AUST GOVT 211221 | 2.0 | 1,050 | 1,046 | 87,963 | 2021/12/21 |
| | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25 | 950 | 904 | 76,039 | 2028/5/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 1,800 | 1,842 | 154,949 | 2019/10/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 1,950 | 1,991 | 167,447 | 2024/4/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75 | 1,450 | 1,454 | 122,295 | 2027/11/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 281121 | 2.75 | 900 | 896 | 75,391 | 2028/11/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 550 | 514 | 43,251 | 2035/6/21 |
| | 3 AUST GOVT 470321 | 3.0 | 600 | 533 | 44,858 | 2047/3/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 181021 | 3.25 | 900 | 920 | 77,403 | 2018/10/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 250421 | 3.25 | 2,100 | 2,209 | 185,807 | 2025/4/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 1,450 | 1,512 | 127,216 | 2029/4/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 300 | 292 | 24,619 | 2039/6/21 |
| | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 700 | 746 | 62,738 | 2037/4/21 |
| | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 2,300 | 2,602 | 218,815 | 2026/4/21 |
| | 4.5 AUST GOVT 200415 | 4.5 | 2,000 | 2,151 | 180,892 | 2020/4/15 |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 800 | 944 | 79,464 | 2033/4/21 |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 2,000 | 2,364 | 198,813 | 2027/4/21 |
| | 5.25 AUST GOVT 190315 | 5.25 | 1,700 | 1,809 | 152,131 | 2019/3/15 |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 1,750 | 2,062 | 173,461 | 2023/4/21 |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 2,150 | 2,459 | 206,830 | 2021/5/15 |
| | 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 1,800 | 2,115 | 177,870 | 2022/7/15 |
| 小計 | | | | | 2,759,409 | |
| 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 | 200 | 197 | 15,971 | 2021/10/1 |

| 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 | |
| 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 | 1.625 SINGAPORGOV 191001 | 1.625 | 550 | 553 | 44,816 | 2019/10/1 |
| | 1.75 SINGAPORGOV 220401 | 1.75 | 50 | 50 | 4,061 | 2022/4/1 |
| | 2 SINGAPORGOV 200701 | 2.0 | 150 | 152 | 12,340 | 2020/7/1 |
| | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 2.125 | 100 | 100 | 8,103 | 2026/6/1 |
| | 2.25 SINGAPORGOV 210601 | 2.25 | 600 | 614 | 49,711 | 2021/6/1 |
| | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 2.375 | 300 | 306 | 24,807 | 2025/6/1 |
| | 2.5 SINGAPORGOV 190601 | 2.5 | 500 | 512 | 41,481 | 2019/6/1 |
| | 2.75 SINGAPORGOV 230701 | 2.75 | 400 | 419 | 33,949 | 2023/7/1 |
| | 2.75 SINGAPORGOV 420401 | 2.75 | 340 | 354 | 28,706 | 2042/4/1 |
| | 2.75 SINGAPORGOV 460301 | 2.75 | 190 | 198 | 16,053 | 2046/3/1 |
| | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 100 | 105 | 8,568 | 2029/7/1 |
| | 2.875SINGAPORGOV 300901 | 2.875 | 300 | 317 | 25,685 | 2030/9/1 |
| | 3 SINGAPORGOV 240901 | 3.0 | 350 | 373 | 30,215 | 2024/9/1 |
| | 3.125SINGAPORGOV 220901 | 3.125 | 350 | 374 | 30,266 | 2022/9/1 |
| | 3.25 SINGAPORGOV 200901 | 3.25 | 400 | 422 | 34,208 | 2020/9/1 |
| | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 230 | 258 | 20,944 | 2033/9/1 |
| | 3.5 SINGAPORGOV 270301 | 3.5 | 500 | 556 | 45,050 | 2027/3/1 |
| | 4 SINGAPORGOV 180901 | 4.0 | 300 | 311 | 25,180 | 2018/9/1 |
| 小 計 | | | | | 500,124 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | |
| 国債証券 | 3.418MALAYSIAGOV 220815 | 3.418 | 900 | 884 | 23,192 | 2022/8/15 |
| | 3.48 MALAYSIAGOV 230315 | 3.48 | 1,200 | 1,179 | 30,913 | 2023/3/15 |
| | 3.492 MALAYSIAGOV 200331 | 3.492 | 700 | 698 | 18,327 | 2020/3/31 |
| | 3.502MALAYSIAGOV 270531 | 3.502 | 300 | 281 | 7,369 | 2027/5/31 |
| | 3.58 MALAYSIAGOV 180928 | 3.58 | 200 | 200 | 5,265 | 2018/9/28 |
| | 3.654 MALAYSIAGOV 191031 | 3.654 | 1,100 | 1,104 | 28,964 | 2019/10/31 |
| | 3.659 MALAYSIAGOV 201015 | 3.659 | 1,000 | 1,002 | 26,285 | 2020/10/15 |
| | 3.733 MALAYSIAGO 280615 | 3.733 | 600 | 569 | 14,939 | 2028/6/15 |
| | 3.759 MALAYSIAGOV 190315 | 3.759 | 600 | 605 | 15,863 | 2019/3/15 |
| | 3.795 MALAYSIAGOV 220930 | 3.795 | 900 | 900 | 23,612 | 2022/9/30 |
| | 3.8 MALAYSIAGOV 230817 | 3.8 | 200 | 199 | 5,224 | 2023/8/17 |
| | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 600 | 562 | 14,754 | 2033/4/15 |
| | 3.889 MALAYSIAGO 200731 | 3.889 | 700 | 706 | 18,517 | 2020/7/31 |
| | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 500 | 487 | 12,794 | 2027/3/15 |
| | 3.9 MALAYSIAGOV 261130 | 3.9 | 500 | 497 | 13,047 | 2026/11/30 |
| | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 1,150 | 1,145 | 30,045 | 2025/9/15 |
| | 4.048 MALAYSIA 210930 | 4.048 | 900 | 913 | 23,951 | 2021/9/30 |
| | 4.127 MALAYSIA 320415 | 4.127 | 600 | 582 | 15,285 | 2032/4/15 |
| | 4.16 MALAYSIAGOV 210715 | 4.16 | 1,050 | 1,070 | 28,067 | 2021/7/15 |
| | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 1,000 | 1,014 | 26,587 | 2024/7/15 |
| | 4.232MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 800 | 785 | 20,587 | 2031/6/30 |
| | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254 | 350 | 338 | 8,863 | 2035/5/31 |
| | 4.378MALAYSIAGOV 191129 | 4.378 | 1,750 | 1,787 | 46,874 | 2019/11/29 |
| | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 1,000 | 1,021 | 26,795 | 2026/4/15 |
| | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 900 | 906 | 23,779 | 2030/4/15 |
| | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736 | 500 | 497 | 13,049 | 2046/3/15 |
| | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935 | 350 | 353 | 9,281 | 2043/9/30 |

| 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 | |
| マレーシア | | % | 千マレーシアリングギット | 千マレーシアリングギット | 千円 | |
| | 国債証券 | 5.248 MALAYSIA 280915 | 200 | 217 | 5,707 | 2028/9/15 |
| | | 5.734MALAYSIAGOVT 190730 | 300 | 314 | 8,247 | 2019/7/30 |
| 小 | 計 | | | | 546,198 | |
| 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 | 12,900 | 14,373 | 122,459 | 2026/12/21 |
| | | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 8,050 | 5,793 | 49,361 | 2036/3/31 |
| | | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 6,400 | 4,548 | 38,753 | 2041/2/28 |
| | | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 3,700 | 3,581 | 30,516 | 2021/3/31 |
| | | 7 SOUTH AFRICA 310228 | 8,300 | 6,884 | 58,654 | 2031/2/28 |
| | | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 4,600 | 4,565 | 38,896 | 2020/1/15 |
| | | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 5,000 | 4,908 | 41,822 | 2023/2/28 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 3,000 | 3,023 | 25,758 | 2018/12/21 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 6,500 | 5,938 | 50,594 | 2030/1/31 |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 5,300 | 4,850 | 41,325 | 2032/3/31 |
| | | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 6,900 | 6,251 | 53,264 | 2037/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 5,900 | 5,359 | 45,659 | 2044/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 10,000 | 9,064 | 77,226 | 2048/2/28 |
| | | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 2,700 | 2,555 | 21,776 | 2035/2/28 |
| | | 9 SOUTH AFRICA 400131 | 3,200 | 3,006 | 25,612 | 2040/1/31 |
| 小 | 計 | | | | 721,683 | |
| 合 | 計 | | | | 130,789,630 | |

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

○投資信託財産の構成

(2017年5月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 130,789,630 | % 96.8 |
| コール・ローン等、その他 | 4,269,249 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 135,058,879 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (131,760,236千円) の投資信託財産総額 (135,058,879千円) に対する比率は97.6%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=113.94円 | 1 カナダドル=83.13円 | 1 メキシコペソ=6.05円 | 1 ユーロ=123.80円 |
| 1 イギリスポンド=146.77円 | 1 スイスフラン=113.06円 | 1 スウェーデンクローネ=12.83円 | 1 ノルウェークローネ=13.25円 |
| 1 デンマーククローネ=16.64円 | 1 ポーランドズロチ=29.30円 | 1 オーストラリアドル=84.09円 | 1 シンガポールドル=80.91円 |
| 1 マレーシアリングギット=26.22円 | 1 南アフリカランド=8.52円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 135,979,672,180 |
| コール・ローン等 | 1,288,484,942 |
| 公社債(評価額) | 130,789,630,361 |
| 未収入金 | 2,785,838,363 |
| 未収利息 | 1,028,010,670 |
| 前払費用 | 87,707,844 |
| (B) 負債 | 3,549,613,893 |
| 未払金 | 1,441,196,550 |
| 未払解約金 | 2,108,413,364 |
| 未払利息 | 3,979 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 132,430,058,287 |
| 元本 | 66,568,708,547 |
| 次期繰越損益金 | 65,861,349,740 |
| (D) 受益権総口数 | 66,568,708,547口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 19,894円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 79,369,567,734円
 期中追加設定元本額 13,460,264,160円
 期中一部解約元本額 26,261,123,347円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9894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)

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| ファンド・マネジャー(海外債券) | 821,265,780円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | 11,507,288,833円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,382,417,182円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 235,783,018円 |
| コアバランス | 1,384,859円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 340,241円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 201,099円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 470,926円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス | 72,793,229円 |
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 3,753,251円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 22,528,484円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | 7,007,945,425円 |
| eMAXIS バランス(4資産均等型) | 41,113,041円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 18,601,350円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 14,975,628円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 21,995,342円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフoward) | 6,029,049円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 1,099,638円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | 1,302,553,961円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 3,286,110,907円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定) | 2,107,382,988円 |
| MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 19,104,565,071円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定) | 7,767,247,723円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定) | 2,012,259,532円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | 462,962,970円 |

○損益の状況 (2016年5月13日~2017年5月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,481,304,903 |
| 受取利息 | 3,481,412,296 |
| その他収益金 | 116,880 |
| 支払利息 | △ 224,273 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 2,469,113,070 |
| 売買益 | 4,743,560,191 |
| 売買損 | △ 7,212,673,261 |
| (C) 保管費用等 | △ 21,156,552 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 991,035,281 |
| (E) 前期繰越損益金 | 76,786,082,214 |
| (F) 追加信託差損益金 | 12,413,548,035 |
| (G) 解約差損益金 | △24,329,315,790 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 65,861,349,740 |
| 次期繰越損益金(H) | 65,861,349,740 |

- (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。

| | |
|--|-----------------|
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定) | 223,771,422円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 72,586,651円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 2,746,567,790円 |
| 三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,048,392円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 160,215,991円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 204,350,336円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 4,601,010円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 3,103,338円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 9,684,414円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 11,193,604円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 4,769,489円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | 87,143,429円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 59,945,011円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 108,282,119円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 98,999,047円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 171,593,156円 |
| 外国債券インデックスファンドi (適格機関投資家限定) | 2,114,453,069円 |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド | 2,002,966,302円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型) | 208,380,073円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 550,346,235円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型) | 386,384,049円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型) | 132,254,093円 |
| 合計 | 66,568,708,547円 |

新興国債券インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2018年1月26日

[計算期間：2017年1月27日～2018年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第8期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第8期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|---------|---|
| 運 用 方 針 | 主として対象インデックス（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。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、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主要運用対象 | 新興国の現地通貨建て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 | | J PモルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|----------------|---------|--------------|--|--------------|----------------|----------------|--------------|
| | 円 | 騰 落 中 率 % | 騰 落 中 率 % | 騰 落 中 率 % | | | |
| 4期(2014年1月27日) | 12,503 | △ 2.1 | 28,701.99 | △ 1.7 | 95.2 | — | 百万円 3,441 |
| 5期(2015年1月26日) | 14,203 | 13.6 | 32,849.46 | 14.5 | 95.0 | — | 7,742 |
| 6期(2016年1月26日) | 11,515 | △18.9 | 26,826.64 | △18.3 | 95.9 | — | 9,861 |
| 7期(2017年1月26日) | 12,647 | 9.8 | 29,442.31 | 9.8 | 96.1 | — | 12,443 |
| 8期(2018年1月26日) | 14,464 | 14.4 | 34,033.56 | 15.6 | 96.7 | — | 16,676 |

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|----------------------|---------|-------|---|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2017年 1月26日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,647 | — | 29,442.31 | — | 96.1 | — |
| 1 月 末 | 12,720 | 0.6 | 29,693.26 | 0.9 | 94.9 | — |
| 2 月 末 | 12,907 | 2.1 | 30,171.93 | 2.5 | 95.3 | — |
| 3 月 末 | 13,142 | 3.9 | 30,919.90 | 5.0 | 95.1 | — |
| 4 月 末 | 13,126 | 3.8 | 30,676.64 | 4.2 | 95.8 | — |
| 5 月 末 | 13,303 | 5.2 | 31,119.95 | 5.7 | 94.9 | — |
| 6 月 末 | 13,540 | 7.1 | 31,744.16 | 7.8 | 96.4 | — |
| 7 月 末 | 13,619 | 7.7 | 31,848.89 | 8.2 | 95.7 | — |
| 8 月 末 | 13,835 | 9.4 | 32,368.41 | 9.9 | 96.7 | — |
| 9 月 末 | 14,037 | 11.0 | 32,822.58 | 11.5 | 96.6 | — |
| 10 月 末 | 13,746 | 8.7 | 32,215.86 | 9.4 | 95.9 | — |
| 11 月 末 | 13,806 | 9.2 | 32,395.22 | 10.0 | 96.9 | — |
| 12 月 末 | 14,163 | 12.0 | 33,242.23 | 12.9 | 94.8 | — |
| (期 末) 2018年 1月26日 | 14,464 | 14.4 | 34,033.56 | 15.6 | 96.7 | — |

(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

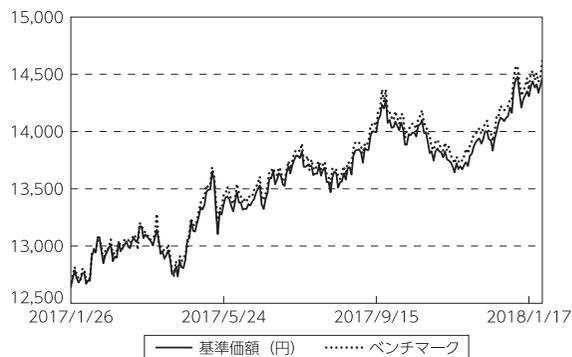
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(15.6%)を1.2%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。

●投資環境について

◎債券市況

- ・新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから、期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

- ・ブラジルリアルなど一部を除き、大半の新興国通貨が対円で買われました。
- ・特に、欧州経済の回復期待などを背景に中東欧通貨が対円で大きく上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）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。

●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15.6%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 1.2\%$ 程度となりました。

| | ポートフォリオ要因 | 管理コスト等要因 | 評価時価差異に基づく要因 | 合計 |
|-------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| ベンチマークとのカイ離 | $\Delta 0.4\%$ 程度 | $\Delta 0.2\%$ 程度 | $\Delta 0.6\%$ 程度 | $\Delta 1.2\%$ 程度 |

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.6\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

◎今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年1月27日～2018年1月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | 15 | 0.115 | 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 ） | (14) | (0.105) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | (1) | (0.010) | |
| 期中の平均基準価額は、13,495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。

○利害関係人との取引状況等

(2017年1月27日～2018年1月26日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|--|--------------------|---------------|--|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 1,435 | % 27.9 | | 百万円 524 | % 18.5 | |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年1月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 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 |
| アルゼンチン | 千アルゼンチンペソ 22,500 | 千アルゼンチンペソ 24,348 | 千円 136,353 | % 0.8 | % 0.8 | % 0.4 | % 0.4 | % — |
| メキシコ | 千メキシコペソ 262,900 | 千メキシコペソ 268,302 | 1,582,982 | 9.5 | — | 5.9 | 2.7 | 0.8 |
| ブラジル | 千ブラジルレアル 51,170 | 千ブラジルレアル 47,821 | 1,666,588 | 10.0 | 10.0 | 1.8 | 6.6 | 1.6 |
| チリ | 千チリペソ 2,000,000 | 千チリペソ 2,096,040 | 384,204 | 2.3 | — | — | 2.3 | — |
| コロンビア | 千コロンビアペソ 25,970,000 | 千コロンビアペソ 28,425,172 | 1,117,109 | 6.7 | — | 4.4 | 2.1 | 0.1 |
| ペルー | 千ペルーヌエボソル 10,850 | 千ペルーヌエボソル 12,559 | 429,424 | 2.6 | — | 2.4 | 0.2 | — |
| ウルグアイ | 千ウルグアイペソ 10,000 | 千ウルグアイペソ 10,070 | 38,974 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| トルコ | 千トルコリラ 41,300 | 千トルコリラ 38,172 | 1,115,019 | 6.7 | 6.7 | 2.9 | 3.0 | 0.8 |
| チェコ | 千チェココルナ 102,000 | 千チェココルナ 112,470 | 603,966 | 3.6 | — | 2.0 | 1.5 | 0.2 |
| ハンガリー | 千ハンガリーフォリント 1,409,300 | 千ハンガリーフォリント 1,647,129 | 725,395 | 4.3 | — | 2.0 | 2.0 | 0.3 |
| ポーランド | 千ポーランドズロチ 43,500 | 千ポーランドズロチ 44,273 | 1,454,840 | 8.7 | — | 3.0 | 4.4 | 1.3 |
| ロシア | 千ロシアルーブル 619,800 | 千ロシアルーブル 634,092 | 1,249,162 | 7.5 | — | 4.6 | 2.0 | 1.0 |
| ルーマニア | 千ルーマニアレイ 14,300 | 千ルーマニアレイ 15,044 | 438,086 | 2.6 | — | 1.1 | 1.4 | 0.1 |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 31,900 | 千マレーシアリンギット 32,001 | 903,722 | 5.4 | — | 3.0 | 1.4 | 1.1 |
| タイ | 千タイバーツ 347,500 | 千タイバーツ 375,875 | 1,315,562 | 7.9 | — | 4.4 | 2.6 | 0.9 |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 20,000 | 千フィリピンペソ 21,690 | 46,850 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 167,470,000 | 千インドネシアルピア 187,898,290 | 1,559,555 | 9.4 | — | 7.4 | 1.5 | 0.4 |
| 南アフリカ | 千南アフリカランド 159,200 | 千南アフリカランド 148,132 | 1,364,299 | 8.2 | — | 7.5 | 0.4 | 0.3 |
| 合 計 | — | — | 16,132,097 | 96.7 | 17.5 | 53.1 | 34.7 | 8.9 |

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | 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 | | |
| アルゼンチン | | % | 千アルゼンチンペソ | 千アルゼンチンペソ | 千円 | | |
| | 国債証券 | 15.5 REPUBLIC OF 261017 | 15.5 | 10,500 | 11,103 | 62,181 | 2026/10/17 |
| | | 18.2 REPUBLIC OF 211003 | 18.2 | 12,000 | 13,245 | 74,172 | 2021/10/3 |
| 小 | 計 | | | | | 136,353 | |
| 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 | 35,400 | 40,302 | 237,785 | 2024/12/5 |
| | | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 9,000 | 11,081 | 65,383 | 2036/11/20 |
| | | 5 MEXICAN BONOS 191211 | 5.0 | 23,700 | 22,715 | 134,022 | 2019/12/11 |
| | | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 17,700 | 15,853 | 93,537 | 2026/3/5 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5 | 29,000 | 28,241 | 166,624 | 2021/6/10 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 21,200 | 20,492 | 120,904 | 2022/6/9 |
| | | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 16,800 | 16,776 | 98,980 | 2027/6/3 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 16,200 | 16,381 | 96,652 | 2031/5/29 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 10,800 | 10,907 | 64,356 | 2034/11/23 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 21,100 | 21,200 | 125,081 | 2042/11/13 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 8.0 | 28,500 | 28,883 | 170,411 | 2020/6/11 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 8,500 | 8,739 | 51,562 | 2023/12/7 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 8.0 | 4,700 | 4,849 | 28,613 | 2047/11/7 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 9,300 | 9,961 | 58,770 | 2029/5/31 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 11,000 | 11,914 | 70,296 | 2038/11/18 |
| 小 | 計 | | | | | 1,582,982 | |
| ブラジル | | | 千ブラジルレアル | 千ブラジルレアル | | | |
| | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT 270101 | 10.0 | 4,770 | 4,887 | 170,339 | 2027/1/1 |
| | | 10 (IN)BRAZIL NTN 250101 | 10.0 | 3,550 | 3,658 | 127,515 | 2025/1/1 |
| | | 10(IN)BRAZIL NTN-F210101 | 10.0 | 9,400 | 9,810 | 341,896 | 2021/1/1 |
| | | 10(IN)BRAZIL NTN-F230101 | 10.0 | 6,850 | 7,104 | 247,580 | 2023/1/1 |
| | | BRAZIL-LTN 190701 | — | 3,700 | 3,351 | 116,783 | 2019/7/1 |
| | | BRAZIL-LTN 200101 | — | 5,100 | 4,401 | 153,388 | 2020/1/1 |
| | | BRAZIL-LTN 200701 | — | 17,500 | 14,384 | 501,300 | 2020/7/1 |
| | | BRAZIL-LTN 210701 | — | 300 | 223 | 7,782 | 2021/7/1 |
| 小 | 計 | | | | | 1,666,588 | |
| チリ | | | 千チリペソ | 千チリペソ | | | |
| | 国債証券 | 5.5 CHILE (GL) 200805 | 5.5 | 2,000,000 | 2,096,040 | 384,204 | 2020/8/5 |
| 小 | 計 | | | | | 384,204 | |
| コロンビア | | | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | | | |
| | 国債証券 | 10 TITULOS DE TES 240724 | 10.0 | 4,350,000 | 5,262,199 | 206,804 | 2024/7/24 |
| | | 11 TITULOS DE TES 200724 | 11.0 | 3,620,000 | 4,120,446 | 161,933 | 2020/7/24 |
| | | 4.375 COLOMBI(GL) 230321 | 4.375 | 1,680,000 | 1,598,184 | 62,808 | 2023/3/21 |
| | | 6 TITULOS DE TESO 280428 | 6.0 | 1,850,000 | 1,775,561 | 69,779 | 2028/4/28 |
| | | 7 TITULOS DE TESO 190911 | 7.0 | 550,000 | 569,302 | 22,373 | 2019/9/11 |
| | | 7 TITULOS DE TESO 220504 | 7.0 | 3,610,000 | 3,815,892 | 149,964 | 2022/5/4 |
| | | 7 TITULOS DE TESO 320630 | 7.0 | 1,600,000 | 1,630,089 | 64,062 | 2032/6/30 |
| | | 7.5 TITULOS DE TE 260826 | 7.5 | 3,700,000 | 3,988,163 | 156,734 | 2026/8/26 |
| | | 7.75 COLOMBI (GL) 210414 | 7.75 | 1,000,000 | 1,067,304 | 41,945 | 2021/4/14 |
| | | 7.75 TITULOS DE T 300918 | 7.75 | 2,720,000 | 2,971,918 | 116,796 | 2030/9/18 |

| 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 | | |
| コロンビア | | % | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | 千円 | |
| 国債証券 | 9.85 COLOMBI (GL) 270628 | 9.85 | 1,290,000 | 1,626,109 | 63,906 | 2027/6/28 |
| 小計 | | | | | 1,117,109 | |
| ペルー | | | 千ペルーヌエボソル | 千ペルーヌエボソル | | |
| 国債証券 | 5.7 PERU 240812 | 5.7 | 1,600 | 1,767 | 60,444 | 2024/8/12 |
| | 6.15 PERU 320812 | 6.15 | 1,900 | 2,118 | 72,431 | 2032/8/12 |
| | 6.35 PERU 280812 | 6.35 | 1,600 | 1,807 | 61,795 | 2028/8/12 |
| | 6.9 PERU 370812 | 6.9 | 1,400 | 1,630 | 55,763 | 2037/8/12 |
| | 6.95 PERU 310812 | 6.95 | 2,000 | 2,378 | 81,305 | 2031/8/12 |
| | 7.84 PERU 200812 | 7.84 | 750 | 842 | 28,818 | 2020/8/12 |
| | 8.2 PERU 260812 | 8.2 | 1,600 | 2,014 | 68,866 | 2026/8/12 |
| 小計 | | | | | 429,424 | |
| ウルグアイ | | | 千ウルグアイペソ | 千ウルグアイペソ | | |
| 国債証券 | 8.5 URUGUAY (GL) 280315 | 8.5 | 5,000 | 4,880 | 18,886 | 2028/3/15 |
| | 9.875 URUGUAY (GL) 220620 | 9.875 | 5,000 | 5,190 | 20,087 | 2022/6/20 |
| 小計 | | | | | 38,974 | |
| トルコ | | | 千トルコリラ | 千トルコリラ | | |
| 国債証券 | 10.4 TURKEY GOVT 190327 | 10.4 | 1,100 | 1,073 | 31,343 | 2019/3/27 |
| | 10.4 TURKEY GOVT 240320 | 10.4 | 1,000 | 952 | 27,807 | 2024/3/20 |
| | 10.5 TURKEY GOVT 200115 | 10.5 | 1,600 | 1,546 | 45,182 | 2020/1/15 |
| | 10.5 TURKEY GOVT 270811 | 10.5 | 2,000 | 1,882 | 54,998 | 2027/8/11 |
| | 10.6 TURKEY GOVT 260211 | 10.6 | 3,800 | 3,621 | 105,781 | 2026/2/11 |
| | 10.7 TURKEY GOVT 210217 | 10.7 | 3,200 | 3,078 | 89,920 | 2021/2/17 |
| | 10.7 TURKEY GOVT 220817 | 10.7 | 1,800 | 1,724 | 50,369 | 2022/8/17 |
| | 11 TURKEY GOVT 220302 | 11.0 | 2,400 | 2,320 | 67,790 | 2022/3/2 |
| | 11 TURKEY GOVT 270224 | 11.0 | 2,300 | 2,228 | 65,083 | 2027/2/24 |
| | 7.1 TURKEY GOVT 230308 | 7.1 | 3,100 | 2,563 | 74,885 | 2023/3/8 |
| | 7.4 TURKEY GOVT 200205 | 7.4 | 2,000 | 1,817 | 53,074 | 2020/2/5 |
| | 8 TURKEY GOVT 250312 | 8.0 | 2,300 | 1,915 | 55,963 | 2025/3/12 |
| | 8.5 TURKEY GOVT 190710 | 8.5 | 1,900 | 1,797 | 52,502 | 2019/7/10 |
| | 8.5 TURKEY GOVT 220914 | 8.5 | 1,600 | 1,423 | 41,571 | 2022/9/14 |
| | 8.8 TURKEY GOVT 230927 | 8.8 | 1,900 | 1,679 | 49,061 | 2023/9/27 |
| | 9 TURKEY GOVT 240724 | 9.0 | 2,000 | 1,784 | 52,110 | 2024/7/24 |
| | 9.2 TURKEY GOVT 210922 | 9.2 | 2,200 | 2,015 | 58,863 | 2021/9/22 |
| | 9.4 TURKEY GOVT 200708 | 9.4 | 2,800 | 2,616 | 76,430 | 2020/7/8 |
| | 9.5 TURKEY GOVT 220112 | 9.5 | 2,300 | 2,132 | 62,278 | 2022/1/12 |
| 小計 | | | | | 1,115,019 | |
| チェコ | | | 千チェココルナ | 千チェココルナ | | |
| 国債証券 | 0 CZECH REPUBLIC 200210 | — | 5,000 | 4,968 | 26,680 | 2020/2/10 |
| | 0.95 CZECH REPUB 300515 | 0.95 | 3,200 | 2,791 | 14,992 | 2030/5/15 |
| | 1.5 CZECH REPUBLI 191029 | 1.5 | 5,000 | 5,119 | 27,489 | 2019/10/29 |
| | 2.4 CZECH REPUBLI 250917 | 2.4 | 17,300 | 18,296 | 98,250 | 2025/9/17 |
| | 2.5 CZECH REPUBLI 280825 | 2.5 | 17,700 | 18,669 | 100,252 | 2028/8/25 |
| | 3.75 CZECH REPUB 200912 | 3.75 | 15,600 | 16,905 | 90,782 | 2020/9/12 |
| | 3.85 CZECH REPUB 210929 | 3.85 | 11,800 | 13,093 | 70,310 | 2021/9/29 |
| | 4.7 CZECH REPUBLI 220912 | 4.7 | 9,400 | 10,969 | 58,906 | 2022/9/12 |

| 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 | |
| チェコ | | % | 千チェココルナ | 千チェココルナ | 千円 | |
| | 国債証券 5.7 CZECH REPUBLI 240525 | 5.7 | 17,000 | 21,657 | 116,301 | 2024/5/25 |
| 小 | 計 | | | | 603,966 | |
| ハンガリー | | | 千ハンガリーフォリント | 千ハンガリーフォリント | | |
| | 国債証券 1.75 HUNGARY 221026 | 1.75 | 35,000 | 36,070 | 15,885 | 2022/10/26 |
| | 2 HUNGARY 191030 | 2.0 | 50,000 | 51,739 | 22,786 | 2019/10/30 |
| | 2.5 HUNGARY 211027 | 2.5 | 40,000 | 42,350 | 18,651 | 2021/10/27 |
| | 3 HUNGARY 240626 | 3.0 | 134,000 | 146,290 | 64,426 | 2024/6/26 |
| | 3 HUNGARY 271027 | 3.0 | 99,000 | 106,501 | 46,903 | 2027/10/27 |
| | 3.5 HUNGARY 200624 | 3.5 | 194,000 | 208,779 | 91,946 | 2020/6/24 |
| | 5.5 HUNGARY 250624 | 5.5 | 190,000 | 238,438 | 105,008 | 2025/6/24 |
| | 6 HUNGARY 231124 | 6.0 | 216,000 | 272,721 | 120,106 | 2023/11/24 |
| | 6.5 HUNGARY 190624 | 6.5 | 71,800 | 78,286 | 34,477 | 2019/6/24 |
| | 7 HUNGARY 220624 | 7.0 | 211,500 | 265,597 | 116,969 | 2022/6/24 |
| | 7.5 HUNGARY 201112 | 7.5 | 168,000 | 200,353 | 88,235 | 2020/11/12 |
| 小 | 計 | | | | 725,395 | |
| ポーランド | | | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | | |
| | 国債証券 1.5 POLAND 200425 | 1.5 | 3,500 | 3,483 | 114,467 | 2020/4/25 |
| | 1.75 POLAND 210725 | 1.75 | 4,900 | 4,826 | 158,582 | 2021/7/25 |
| | 2 POLAND 210425 | 2.0 | 2,700 | 2,689 | 88,367 | 2021/4/25 |
| | 2.25 POLAND 220425 | 2.25 | 3,000 | 2,974 | 97,751 | 2022/4/25 |
| | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 4,500 | 4,244 | 139,478 | 2026/7/25 |
| | 2.5 POLAND 270725 | 2.5 | 3,600 | 3,347 | 110,013 | 2027/7/25 |
| | 3.25 POLAND 190725 | 3.25 | 3,700 | 3,795 | 124,704 | 2019/7/25 |
| | 3.25 POLAND 250725 | 3.25 | 3,400 | 3,428 | 112,668 | 2025/7/25 |
| | 4 POLAND 231025 | 4.0 | 4,200 | 4,457 | 146,465 | 2023/10/25 |
| | 5.25 POLAND 201025 | 5.25 | 2,800 | 3,047 | 100,147 | 2020/10/25 |
| | 5.5 POLAND 191025 | 5.5 | 2,700 | 2,882 | 94,724 | 2019/10/25 |
| | 5.75 POLAND 211025 | 5.75 | 2,000 | 2,250 | 73,935 | 2021/10/25 |
| | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 2,500 | 2,846 | 93,535 | 2022/9/23 |
| 小 | 計 | | | | 1,454,840 | |
| ロシア | | | 千ロシアルーブル | 千ロシアルーブル | | |
| | 国債証券 6.4 RUSSIA OFZ 200527 | 6.4 | 35,600 | 35,343 | 69,627 | 2020/5/27 |
| | 6.7 RUSSIA GOVT B 190515 | 6.7 | 53,800 | 53,834 | 106,054 | 2019/5/15 |
| | 6.8 RUSSIA GOVT 191211 | 6.8 | 27,300 | 27,352 | 53,884 | 2019/12/11 |
| | 7 RUSSIA GOVT 230125 | 7.0 | 36,500 | 36,801 | 72,498 | 2023/1/25 |
| | 7 RUSSIA GOVT BON 230816 | 7.0 | 62,000 | 62,454 | 123,035 | 2023/8/16 |
| | 7.05 RUSSIA GOVT 280119 | 7.05 | 40,800 | 40,200 | 79,194 | 2028/1/19 |
| | 7.1 RUSSIA OFZ 241016 | 7.1 | 17,200 | 17,221 | 33,926 | 2024/10/16 |
| | 7.4 RUSSIA OFZ 221207 | 7.4 | 30,100 | 30,888 | 60,851 | 2022/12/7 |
| | 7.5 RUSSIA OFZ 210818 | 7.5 | 43,900 | 44,883 | 88,420 | 2021/8/18 |
| | 7.6 RUSSIA GOVT 210414 | 7.6 | 23,000 | 23,629 | 46,550 | 2021/4/14 |
| | 7.6 RUSSIA GOVT 220720 | 7.6 | 31,000 | 31,943 | 62,929 | 2022/7/20 |
| | 7.7 RUSSIA OFZ 330323 | 7.7 | 49,700 | 50,526 | 99,537 | 2033/3/23 |
| | 7.75 RUSSIA OFZ 260916 | 7.75 | 75,400 | 78,379 | 154,406 | 2026/9/16 |
| | 8.15 RUSSIA GOVT 270203 | 8.15 | 55,500 | 59,151 | 116,529 | 2027/2/3 |

| 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 | | | |
| ロシア | | % | 千ロシアルーブル | 千ロシアルーブル | 千円 | | | |
| | 国債証券 | 8.5 | RUSSIA OFZ 310917 | 8.5 | 38,000 | 41,480 | 81,717 | 2031/9/17 |
| 小 | 計 | | | | | | 1,249,162 | |
| ルーマニア | | | 千ルーマニアレイ | 千ルーマニアレイ | | | | |
| | 国債証券 | 2.5 | ROMANIA GOVER 190429 | 2.5 | 400 | 400 | 11,648 | 2019/4/29 |
| | | 3.4 | ROMANIA GOVER 220308 | 3.4 | 1,200 | 1,178 | 34,326 | 2022/3/8 |
| | | 3.5 | ROMANIA GOVER 221219 | 3.5 | 400 | 391 | 11,398 | 2022/12/19 |
| | | 4.75 | ROMANIA GOVE 250224 | 4.75 | 2,600 | 2,669 | 77,747 | 2025/2/24 |
| | | 5.75 | ROMANIA GOVE 200429 | 5.75 | 4,000 | 4,235 | 123,332 | 2020/4/29 |
| | | 5.8 | ROMANIA GOV 270726 | 5.8 | 600 | 663 | 19,331 | 2027/7/26 |
| | | 5.85 | ROMANIA GOVE 230426 | 5.85 | 2,900 | 3,141 | 91,477 | 2023/4/26 |
| | | 5.95 | ROMANIA 210611 | 5.95 | 2,200 | 2,363 | 68,823 | 2021/6/11 |
| 小 | 計 | | | | | | 438,086 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | | |
| | 国債証券 | 3.48 | MALAYSIAGOV 230315 | 3.48 | 2,200 | 2,166 | 61,176 | 2023/3/15 |
| | | 3.492 | MALAYSIAGOV 200331 | 3.492 | 1,700 | 1,706 | 48,184 | 2020/3/31 |
| | | 3.62 | MALAYSIAGOV 211130 | 3.62 | 2,400 | 2,412 | 68,129 | 2021/11/30 |
| | | 3.654 | MALAYSIAGOV 191031 | 3.654 | 1,800 | 1,812 | 51,186 | 2019/10/31 |
| | | 3.659 | MALAYSIAGOV 201015 | 3.659 | 2,000 | 2,016 | 56,938 | 2020/10/15 |
| | | 3.759 | MALAYSIAGOV 190315 | 3.759 | 800 | 804 | 22,730 | 2019/3/15 |
| | | 3.8 | MALAYSIAGOV 230817 | 3.8 | 1,900 | 1,898 | 53,614 | 2023/8/17 |
| | | 3.899 | MALAYSIAGOV 271116 | 3.899 | 600 | 599 | 16,921 | 2027/11/16 |
| | | 3.9 | MALAYSIAGOV 261130 | 3.9 | 1,200 | 1,188 | 33,559 | 2026/11/30 |
| | | 3.955 | MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 3,500 | 3,499 | 98,812 | 2025/9/15 |
| | | 4.059 | MALAYSIAGOV 240930 | 4.059 | 1,800 | 1,814 | 51,241 | 2024/9/30 |
| | | 4.16 | MALAYSIAGOV 210715 | 4.16 | 1,900 | 1,941 | 54,814 | 2021/7/15 |
| | | 4.181 | MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 1,600 | 1,622 | 45,825 | 2024/7/15 |
| | | 4.232 | MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 3,200 | 3,122 | 88,167 | 2031/6/30 |
| | | 4.378 | MALAYSIAGOV 191129 | 4.378 | 3,600 | 3,665 | 103,522 | 2019/11/29 |
| | | 4.39 | MALAYSI INV 230707 | 4.39 | 1,400 | 1,426 | 40,294 | 2023/7/7 |
| | | 4.762 | MALAYSIAGOV 370407 | 4.762 | 300 | 304 | 8,601 | 2037/4/7 |
| 小 | 計 | | | | | | 903,722 | |
| タイ | | | 千タイバーツ | 千タイバーツ | | | | |
| | 国債証券 | 1.875 | THAILAND 220617 | 1.875 | 32,800 | 33,026 | 115,593 | 2022/6/17 |
| | | 2.0 | THAILAND 221217 | 2.0 | 7,500 | 7,580 | 26,532 | 2022/12/17 |
| | | 2.125 | THAILAND 261217 | 2.125 | 16,800 | 16,544 | 57,904 | 2026/12/17 |
| | | 2.55 | THAILAND 200626 | 2.55 | 29,900 | 30,670 | 107,345 | 2020/6/26 |
| | | 3.4 | THAILAND 360617 | 3.4 | 20,000 | 21,522 | 75,327 | 2036/6/17 |
| | | 3.625 | THAILAND 230616 | 3.625 | 42,400 | 46,238 | 161,834 | 2023/6/16 |
| | | 3.65 | THAILAND 211217 | 3.65 | 50,200 | 53,985 | 188,948 | 2021/12/17 |
| | | 3.65 | THAILAND 310620 | 3.65 | 24,600 | 27,331 | 95,661 | 2031/6/20 |
| | | 3.85 | THAILAND 251212 | 3.85 | 43,300 | 48,500 | 169,750 | 2025/12/12 |
| | | 3.875 | THAILAND 190613 | 3.875 | 41,800 | 43,248 | 151,369 | 2019/6/13 |
| | | 4.875 | THAILAND 290622 | 4.875 | 38,200 | 47,227 | 165,295 | 2029/6/22 |
| 小 | 計 | | | | | | 1,315,562 | |

| 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 | | |
| フィリピン | 国債証券 | 4.95 PHILIPPI(GL) 210115 | 4.95 | 10,000 | 10,337 | 22,329 | 2021/1/15 |
| | | 6.25 PHILIPPI(GL) 360114 | 6.25 | 10,000 | 11,352 | 24,521 | 2036/1/14 |
| 小 計 | | | | | | 46,850 | |
| インドネシア | | | | 千インドネシアルピア | 千インドネシアルピア | | |
| 国債証券 | 10.5 INDONESIA 300815 | 10.5 | 4,550,000 | 5,968,053 | 49,534 | 2030/8/15 | |
| | 11 INDONESIA 201115 | 11.0 | 2,550,000 | 2,900,938 | 24,077 | 2020/11/15 | |
| | 11 INDONESIA 250915 | 11.0 | 3,450,000 | 4,455,809 | 36,983 | 2025/9/15 | |
| | 12.8 INDONESIA 210615 | 12.8 | 2,590,000 | 3,184,257 | 26,429 | 2021/6/15 | |
| | 5.625 INDONESIA 230515 | 5.625 | 4,800,000 | 4,837,420 | 40,150 | 2023/5/15 | |
| | 6.125 INDONESIA 280515 | 6.125 | 5,050,000 | 5,044,177 | 41,866 | 2028/5/15 | |
| | 6.625 INDONESIA 330515 | 6.625 | 6,400,000 | 6,376,396 | 52,924 | 2033/5/15 | |
| | 7 INDONESIA 220515 | 7.0 | 7,450,000 | 7,829,950 | 64,988 | 2022/5/15 | |
| | 7 INDONESIA 270515 | 7.0 | 11,850,000 | 12,454,350 | 103,371 | 2027/5/15 | |
| | 7.5 INDONESIA 320815 | 7.5 | 1,500,000 | 1,594,828 | 13,237 | 2032/8/15 | |
| | 7.5 INDONESIA 380515 | 7.5 | 2,500,000 | 2,646,250 | 21,963 | 2038/5/15 | |
| | 7.875 INDONESIA 190415 | 7.875 | 7,700,000 | 7,967,513 | 66,130 | 2019/4/15 | |
| | 8.25 INDONESIA 210715 | 8.25 | 15,700,000 | 17,087,785 | 141,828 | 2021/7/15 | |
| | 8.25 INDONESIA 320615 | 8.25 | 7,000,000 | 7,961,828 | 66,083 | 2032/6/15 | |
| | 8.25 INDONESIA 360515 | 8.25 | 11,000,000 | 12,397,000 | 102,895 | 2036/5/15 | |
| | 8.375 INDONESIA 240315 | 8.375 | 18,000,000 | 20,439,846 | 169,650 | 2024/3/15 | |
| | 8.375 INDONESIA 260915 | 8.375 | 16,930,000 | 19,349,500 | 160,600 | 2026/9/15 | |
| 8.375 INDONESIA 340315 | 8.375 | 12,100,000 | 13,733,500 | 113,988 | 2034/3/15 | | |
| 8.75 INDONESIA 310515 | 8.75 | 9,300,000 | 10,932,150 | 90,736 | 2031/5/15 | | |
| 9 INDONESIA 290315 | 9.0 | 12,900,000 | 15,581,148 | 129,323 | 2029/3/15 | | |
| 9.5 INDONESIA 310715 | 9.5 | 4,150,000 | 5,155,586 | 42,791 | 2031/7/15 | | |
| 小 計 | | | | | 1,559,555 | | |
| 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 | 23,800 | 26,867 | 247,452 | 2026/12/21 | |
| | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 6.25 | 11,300 | 8,296 | 76,408 | 2036/3/31 | |
| | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 6.5 | 14,300 | 10,342 | 95,254 | 2041/2/28 | |
| | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 6.75 | 6,500 | 6,395 | 58,904 | 2021/3/31 | |
| | 7 SOUTH AFRICA 310228 | 7.0 | 12,600 | 10,737 | 98,889 | 2031/2/28 | |
| | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 7.25 | 5,400 | 5,427 | 49,982 | 2020/1/15 | |
| | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 7.75 | 8,100 | 8,126 | 74,846 | 2023/2/28 | |
| | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 8.0 | 12,700 | 11,879 | 109,410 | 2030/1/31 | |
| | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25 | 10,100 | 9,442 | 86,968 | 2032/3/31 | |
| | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 8.5 | 11,500 | 10,587 | 97,512 | 2037/1/31 | |
| | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75 | 14,000 | 12,955 | 119,316 | 2044/1/31 | |
| 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75 | 19,200 | 17,777 | 163,728 | 2048/2/28 | | |
| 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 8.875 | 7,600 | 7,293 | 67,176 | 2035/2/28 | | |
| 9 SOUTH AFRICA 400131 | 9.0 | 2,100 | 2,003 | 18,448 | 2040/1/31 | | |
| 小 計 | | | | | 1,364,299 | | |
| 合 計 | | | | | 16,132,097 | | |

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

○投資信託財産の構成

(2018年1月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 16,132,097 | % 96.4 |
| コール・ローン等、その他 | 600,508 | 3.6 |
| 投資信託財産総額 | 16,732,605 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (16,632,531千円) の投資信託財産総額 (16,732,605千円) に対する比率は99.4%です。

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

| | | | |
|------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| 1 アメリカドル=109.78円 | 1 アルゼンチンペソ=5.60円 | 1 メキシコペソ=5.90円 | 1 ブラジルレアル=34.85円 |
| 100チリペソ=18.33円 | 100コロンビアペソ=3.93円 | 1 ペルーヌエボソル=34.19円 | 1 ウルグアイペソ=3.87円 |
| 1 トルコリラ=29.21円 | 1 チェココルナ=5.37円 | 100ハンガリーフォリント=44.04円 | 1 ポーランドズロチ=32.86円 |
| 1 ロシアルーブル=1.97円 | 1 ルーマニアレイ=29.12円 | 1 マレーシアリングット=28.24円 | 1 タイバーツ=3.50円 |
| 1 フィリピンペソ=2.16円 | 100インドネシアルピア=0.83円 | 1 南アフリカランド=9.21円 | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 16,782,655,722 |
| コール・ローン等 | 323,613,336 |
| 公社債(評価額) | 16,132,097,835 |
| 未収入金 | 50,302,600 |
| 未収利息 | 252,361,008 |
| 前払費用 | 24,280,943 |
| (B) 負債 | 105,706,347 |
| 前受収益 | 7,065 |
| 未払金 | 100,019,993 |
| 未払解約金 | 5,679,216 |
| 未払利息 | 73 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 16,676,949,375 |
| 元本 | 11,529,608,091 |
| 次期繰越損益金 | 5,147,341,284 |
| (D) 受益権総口数 | 11,529,608,091口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,464円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 9,838,910,954円
 期中追加設定元本額 2,812,429,380円
 期中一部解約元本額 1,121,732,243円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,464円です。

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

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,260,258,462円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 343,440,703円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 315,746,527円 |
| コアバランス | 1,577,020円 |
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 103,007,468円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 735,722,020円 |
| つみたて8資産均等バランス | 11,345,160円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 741,663円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 907,875円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 87,021円 |
| eMAXIS 新興国債券インデックス | 4,400,564,847円 |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド | 3,108,565,930円 |
| 新興国債券インデックスファンド(ラップ向け) | 10,285,636円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 15,280,816円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 89,046,984円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 81,765,595円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 15,032,159円 |
| アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 12,059,784円 |
| アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 16,055,007円 |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定) | 8,117,414円 |
| 合計 | 11,529,608,091円 |

○損益の状況 (2017年1月27日~2018年1月26日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 918,162,721 |
| 受取利息 | 918,321,798 |
| その他収益金 | 107,997 |
| 支払利息 | △ 267,074 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,015,010,359 |
| 売買益 | 1,283,664,637 |
| 売買損 | △ 268,654,278 |
| (C) 保管費用等 | △ 16,292,333 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,916,880,747 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,604,625,102 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,024,722,454 |
| (G) 解約差損益金 | △ 398,887,019 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 5,147,341,284 |
| 次期繰越損益金(H) | 5,147,341,284 |

- (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。

【お 知 ら せ】

- ①当マザーファンドに投資する新設ベビーファンドの約款記載に合わせて、投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)

アセアン投資適格社債マザーファンド

《第7期》決算日2017年12月15日

[計算期間：2017年6月16日～2017年12月15日]

「アセアン投資適格社債マザーファンド」は、12月15日に第7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7期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|-------------|--|
| 運 用 方 針 | アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格社債等を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、市況動向などに応じて、一部、米国国債やアセアン諸国の現地通貨建ての公社債等に投資する場合があります。投資する債券は、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付けを取得しているもの、もしくは委託者の格付基準によりBBB一格相当以上の格付けを付与されているものに限りません。デュレーション調整等のため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格社債等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 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------|---------|--------|-------------|-------------|-----------|
| | 円 | 騰 落 率 | | | |
| 3期(2015年12月15日) | 12,344 | △ 1.5% | 97.7% | — | 1,089 百万円 |
| 4期(2016年6月15日) | 11,567 | △ 6.3% | 98.5% | — | 1,021 |
| 5期(2016年12月15日) | 12,721 | 10.0% | 98.5% | — | 1,020 |
| 6期(2017年6月15日) | 12,441 | △ 2.2% | 97.5% | — | 864 |
| 7期(2017年12月15日) | 13,017 | 4.6% | 96.2% | — | 990 |

(注) 当ファンドは、アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格社債等に投資を行い、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(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 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|--------------------------|------------------|-----------|-----------|--------|
| | | | | |
| (期 首) 2017年 6 月 15 日 | 円 12,441 | % — | % 97.5 | % — |
| 6 月 末 | 12,711 | 2.2 | 97.8 | — |
| 7 月 末 | 12,551 | 0.9 | 97.5 | — |
| 8 月 末 | 12,689 | 2.0 | 96.8 | — |
| 9 月 末 | 12,954 | 4.1 | 96.3 | — |
| 10 月 末 | 13,076 | 5.1 | 97.7 | — |
| 11 月 末 | 12,966 | 4.2 | 97.4 | — |
| (期 末) 2017年 12 月 15 日 | 円 13,017 | 4.6 | 96.2 | — |

(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4.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●投資環境について

◎アセアン投資適格社債市況

- ・アセアン投資適格社債市況は、社債のスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したことなどから上昇しました。期初は、英国中央銀行（BOE）などの高官らが金融緩和策の解除を示唆する発言をしたことなどから、グローバルに金利が上昇する展開となり、米国金利も上昇しました。2017年7月から8月にかけては、市場のインフレ期待が低下したことや、北朝鮮情勢に対する懸念などから金利が低下する局面もありましたが、期末にかけて米国の税制改革進展への期待が高まったことなどから金利は上昇に転じ、期を通じてみると金利は上昇しました。
- ・また、社債のスプレッドは、世界的な景気の先行き懸念や北朝鮮情勢に対する懸念が和らいだことなどから、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどを背景に縮小基調で推移しました。11月中旬にかけて米国ハイイールド社債市場からの資金流出などを受けて、アセアン社債もハイイールドセクターを中心にスプレッドが拡大する局面もありましたが、11月下旬にかけてリスク回避姿勢が後退したことなどから縮小傾向で推移し、影響は限定的でした。

◎為替市況

- ・米国金利上昇による日米の金利差拡大などから米ドルは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・当期においては、世界的に景気の先行き懸念が和らいだ局面で、債券格付別ではA A格相当の組入比率を引き下げ、A格相当の組入比率を引き上げました。また、セクター別では業況が安定している金融セクターへ多めの配分を維持しました。
- ・前記のような運用を行った結果、債券利子収入を獲得したことに加え、米ドルが対円で上昇したことなどから基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国において、当面の米国長期金利は、もみ合う展開が想定されます。米連邦公開市場委員会（FOMC）は、米経済は力強さを増したと位置づけており、引き続き緩やかなペースでの金融緩和の解除を指向することから、中短期金利は上昇し易い局面にあると考えます。一方で、長期金利は国内インフレ動向が落ち着いていることや政策金利引き上げに伴う将来の成長見通し鈍化を受けて、概ね横ばい圏での推移を見込みます。また、日欧などの先進国に加えて中国の金融緩和策は維持されています。

- ・アセアン各国については、インフラの整備・拡充を通じた投資拡大や中間層・富裕層の増加を通じた消費拡大などを背景に今後も相対的に高い経済成長が見込めると考えます。特に、インドネシアではインフラ関連投資を中心とした政府による歳出実行の加速、フィリピンにおいては海外就労者からの本国送金を背景とした旺盛な個人消費の継続などが期待されます。一方、マレーシアについては政治情勢や財政収支動向、タイについては政治情勢や景気動向などに留意が必要と考えます。米国の金融引き締めペースや、財政・貿易政策等を受けた新興国からの資金流出などは懸念されますが、前述のアセアン各国の成長を背景に、アセアン各国の社債スプレッドは全体では概ね底堅く推移するものと予想します。

◎今後の運用方針

- ・国別では輸出依存度が高く資源価格低迷に伴う景気や財政収支悪化の懸念が高まりやすいマレーシア、個別では過剰な米ドル建て債務から為替差損を抱えやすい企業については留意が必要と考え、慎重に分析・銘柄選択を行ってまいります。以上の見通しの下、割安で相対的に業況が安定していると判断されるB B B格相当や金融セクターへの配分を多めに維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2017年6月16日～2017年12月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (2) | (0.014) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 2 | 0.015 | |
| 期中の平均基準価額は、12,824円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年6月16日～2017年12月15日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|---------|---------|
| 外 国 | アメリカ | 千アメリカドル | 千アメリカドル |
| | 特殊債券 | 507 | — |
| | 社債券 | 1,390 | 1,103 |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2017年6月16日～2017年12月15日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|--------|------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 117 | 百万円 16 | % 13.7 | 百万円 30 | 百万円 20 | % 66.7 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年12月15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 7,900 | 千アメリカドル 8,474 | 千円 952,559 | % 96.2 | % — | % 68.9 | % 20.3 | % 7.0 |
| 合 計 | 7,900 | 8,474 | 952,559 | 96.2 | — | 68.9 | 20.3 | 7.0 |

(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 | | | 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 | |
| 特殊債券 | 2.48 EXPT-IMPT BA 211020 | 2.48 | 200 | 198 | 22,329 | 2021/10/20 |
| | 3.875 INDONESIA E 240406 | 3.875 | 300 | 306 | 34,432 | 2024/4/6 |
| 普通社債券 | 2.375 TEMASEK FIN 230123 | 2.375 | 250 | 248 | 27,952 | 2023/1/23 |
| | 2.7 SP POWERASSET 220914 | 2.7 | 200 | 201 | 22,611 | 2022/9/14 |
| | 2.95 BDO UNIBANK 230306 | 2.95 | 150 | 148 | 16,653 | 2023/3/6 |
| | 3.25 OPTUS FINAN 250630 | 3.25 | 200 | 204 | 22,942 | 2025/6/30 |
| | 3.5 SIAM COMMERC I 190407 | 3.5 | 400 | 404 | 45,513 | 2019/4/7 |
| | 3.875 GLOBAL LOGI 250604 | 3.875 | 400 | 387 | 43,606 | 2025/6/4 |
| | 4.25 GOHL CAPITAL 270124 | 4.25 | 200 | 206 | 23,227 | 2027/1/24 |
| | 4.25 OVERSEA-CHIN 240619 | 4.25 | 200 | 208 | 23,473 | 2024/6/19 |
| | 4.25 PT PELABUHAN 250505 | 4.25 | 400 | 411 | 46,196 | 2025/5/5 |
| | 4.25 PTT GLOBAL C 220919 | 4.25 | 200 | 209 | 23,599 | 2022/9/19 |
| | 4.25 RIZAL COMMER 200122 | 4.25 | 100 | 102 | 11,576 | 2020/1/22 |
| | 4.5 PETRONAS CAPI 450318 | 4.5 | 200 | 226 | 25,417 | 2045/3/18 |
| | 4.5 SINGTEL GROUP 210908 | 4.5 | 200 | 213 | 24,005 | 2021/9/8 |
| | 4.8 BANGKOK BANK 201018 | 4.8 | 200 | 211 | 23,729 | 2020/10/18 |
| | 4.875 PELABUHAN 241001 | 4.875 | 200 | 213 | 23,997 | 2024/10/1 |
| | 4.875 PERTAMINA P 220503 | 4.875 | 200 | 213 | 23,976 | 2022/5/3 |
| | 4.875 THAI OIL PC 430123 | 4.875 | 200 | 219 | 24,715 | 2043/1/23 |
| | 5.125 PERUSAHAAN 240516 | 5.125 | 200 | 215 | 24,185 | 2024/5/16 |
| | 5.25 PETRONAS CAP 190812 | 5.25 | 200 | 209 | 23,515 | 2019/8/12 |
| | 5.5 DEV BANK PHIL 210325 | 5.5 | 200 | 218 | 24,525 | 2021/3/25 |
| | 6 PERTAMINA PERSE 420503 | 6.0 | 200 | 227 | 25,555 | 2042/5/3 |
| | 6.35 PTTEP CANADA 420612 | 6.35 | 200 | 264 | 29,773 | 2042/6/12 |
| | 6.5 PERTAMINA PT 410527 | 6.5 | 200 | 240 | 26,988 | 2041/5/27 |
| | 7.39 POWER SECTOR 241202 | 7.39 | 200 | 256 | 28,841 | 2024/12/2 |
| | 7.625 PETROLIAM N 261015 | 7.625 | 100 | 133 | 14,988 | 2026/10/15 |
| | 7.75 MAJAPAHIT HO 200120 | 7.75 | 200 | 219 | 24,699 | 2020/1/20 |
| | 7.875 MAJAPAHIT H 370629 | 7.875 | 300 | 406 | 45,741 | 2037/6/29 |
| | 7.875 TELEKOM MAL 250801 | 7.875 | 100 | 129 | 14,556 | 2025/8/1 |
| | VAR MALAYAN BANKI 261029 | 3.905 | 200 | 205 | 23,054 | 2026/10/29 |
| | VAR OVERSEA-CHINE 230311 | 3.15 | 400 | 400 | 45,029 | 2023/3/11 |
| | VAR PTTEP TREASUR 660117 | 4.6 | 200 | 203 | 22,831 | 2166/1/17 |
| | VAR UNITED OVERSE 240919 | 3.75 | 200 | 203 | 22,854 | 2024/9/19 |
| | VAR UNITED OVERSE 260916 | 3.5 | 400 | 404 | 45,461 | 2026/9/16 |
| 合 | 計 | | | | 952,559 | |

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

○投資信託財産の構成

(2017年12月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 952,559 | 95.1 |
| コール・ローン等、その他 | 49,599 | 4.9 |
| 投資信託財産総額 | 1,002,158 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(976,283千円)の投資信託財産総額(1,002,158千円)に対する比率は97.4%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=112.40円 | | |
|-----------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年12月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,011,709,542 |
| コール・ローン等 | 40,181,186 |
| 公社債(評価額) | 952,559,619 |
| 未収入金 | 9,550,600 |
| 未収利息 | 9,001,467 |
| 前払費用 | 416,670 |
| (B) 負債 | 21,676,700 |
| 未払金 | 21,420,531 |
| 未払解約金 | 256,150 |
| 未払利息 | 19 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 990,032,842 |
| 元本 | 760,552,967 |
| 次期繰越損益金 | 229,479,875 |
| (D) 受益権総口数 | 760,552,967口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,017円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 694,658,719円
 期中追加設定元本額 94,977,007円
 期中一部解約元本額 29,082,759円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,017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)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 21,965,992円 |
| アセアン社債ファンド(毎月決算型) | 278,053,629円 |
| アセアン社債ファンド(ラップ向け) | 6,285,457円 |
| MUAM アセアン社債ファンド | 445,838,888円 |
| アドバンスト・バランスⅠ(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 3,762,285円 |
| アドバンスト・バランスⅡ(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 4,646,716円 |
| 合計 | 760,552,967円 |

○損益の状況 (2017年6月16日~2017年12月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 19,209,339 |
| 受取利息 | 18,941,155 |
| その他収益金 | 269,760 |
| 支払利息 | △ 1,576 |
| (B) 有価証券売買損益 | 20,844,221 |
| 売買益 | 26,417,073 |
| 売買損 | △ 5,572,852 |
| (C) 保管費用等 | △ 135,378 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 39,918,182 |
| (E) 前期繰越損益金 | 169,585,063 |
| (F) 追加信託差損益金 | 28,161,155 |
| (G) 解約差損益金 | △ 8,184,525 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 229,479,875 |
| 次期繰越損益金(H) | 229,479,875 |

- (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。

アセアン・ハイイールド社債マザーファンド

《第7期》決算日2017年12月15日

[計算期間：2017年6月16日～2017年12月15日]

「アセアン・ハイイールド社債マザーファンド」は、12月15日に第7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7期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|-------------|---|
| 運 用 方 針 | アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド社債等を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、市況動向などに応じて、一部、米国国債やアセアン諸国の現地通貨建ての公社債等に投資する場合があります。投資する債券は、原則として取得時においてB-格相当以上の格付けを取得しているもの、もしくは委託者の格付基準によりB-格相当以上の格付けを付与されているものに限ります。 デュレーション調整等のため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド社債等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 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|-------|-----------|-----------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2015年12月15日) | 12,534 | △ 1.1 | 97.2 | — | 1,092 |
| 4期(2016年6月15日) | 11,650 | △ 7.1 | 96.6 | — | 1,018 |
| 5期(2016年12月15日) | 13,232 | 13.6 | 96.1 | — | 1,026 |
| 6期(2017年6月15日) | 12,865 | △ 2.8 | 97.8 | — | 863 |
| 7期(2017年12月15日) | 13,557 | 5.4 | 95.4 | — | 989 |

(注) 当ファンドは、アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド社債等に投資を行い、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(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 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|---|-------------|---|------------------|-----------|-----------|-----|
| | | | | | | |
| | (期 首) | | 円 | % | | % |
| | 2017年6月15日 | | 12,865 | — | 97.8 | — |
| | 6月末 | | 13,132 | 2.1 | 97.8 | — |
| | 7月末 | | 13,014 | 1.2 | 96.3 | — |
| | 8月末 | | 13,112 | 1.9 | 96.4 | — |
| | 9月末 | | 13,488 | 4.8 | 96.0 | — |
| | 10月末 | | 13,634 | 6.0 | 97.4 | — |
| | 11月末 | | 13,500 | 4.9 | 95.4 | — |
| | (期 末) | | | | | |
| | 2017年12月15日 | | 13,557 | 5.4 | 95.4 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

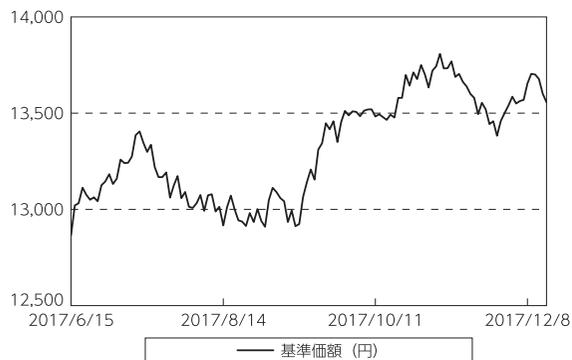
○運用経過

●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5.4%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●投資環境について

◎アセアン・ハイイールド社債市況

- ・アセアン・ハイイールド社債市況は、社債のスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したことなどから上昇しました。期初は、英国中央銀行（BOE）などの高官らが金融緩和策の解除を示唆する発言をしたことなどから、グローバルに金利が上昇する展開となり、米国金利も上昇しました。2017年7月から8月にかけては、市場のインフレ期待が低下したことや、北朝鮮情勢に対する懸念などから金利が低下する局面もありましたが、期末にかけて米国の税制改革進展への期待が高まったことなどから金利は上昇に転じ、期を通じてみると金利は上昇しました。
- ・また、社債のスプレッドは、世界的な景気の先行き懸念や北朝鮮情勢に対する懸念が和らいだことなどから、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどを背景に縮小基調で推移しました。11月中旬にかけて米国ハイイールド社債市場からの資金流出などを受けて、アセアン社債もハイイールドセクターを中心にスプレッドが拡大する局面もありましたが、11月下旬にかけてリスク回避姿勢が後退したことなどから縮小傾向で推移し、影響は限定的でした。

◎為替市況

- ・米国金利上昇による日米の金利差拡大などから米ドルは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・当期においては、債券格付別では、BB格相当へ多めの配分を維持しました。また、セクター別では業況が安定している金融セクターおよび生活必需品セクターへ多めの配分としました。
- ・前記のような運用を行った結果、債券利子収入を獲得したことに加え、米ドルが対円で上昇したことなどから基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国において、当面の米国長期金利は、もみ合う展開が想定されます。米連邦公開市場委員会（FOMC）は、米経済は力強さを増したと位置づけており、引き続き緩やかなペースでの金融緩和の解除を指向することから、中短期金利は上昇し易い局面にあると考えます。一方で、長期金利は国内インフレ動向が落ち着いていることや政策金利引き上げに伴う将来の成長見通し鈍化を受けて、概ね横ばい圏での推移を見込みます。また、日欧などの先進国に加えて中国の金融緩和策は維持されています。

- ・アセアン各国については、インフラの整備・拡充を通じた投資拡大や中間層・富裕層の増加を通じた消費拡大などを背景に今後も相対的に高い経済成長が見込めると考えます。特に、インドネシアではインフラ関連投資を中心とした政府による歳出実行の加速、フィリピンにおいては海外就労者からの本国送金を背景とした旺盛な個人消費の継続などが期待されます。一方、マレーシアについては政治情勢や財政収支動向、タイについては政治情勢や景気動向などに留意が必要と考えます。米国の金融引き締めペースや、財政・貿易政策等を受けた新興国からの資金流出などは懸念されますが、前述のアセアン各国の成長を背景に、アセアン各国の社債スプレッドは全体では概ね底堅く推移するものと予想します。

◎今後の運用方針

- ・国別では輸出依存度が高く資源価格低迷に伴う景気や財政収支悪化の懸念が高まりやすいマレーシア、個別で過剰な米ドル建て債務から為替差損を抱えやすい企業については留意が必要と考え、慎重に分析・銘柄選択を行ってまいります。以上の見通しの下、割安で相対的に業況が安定していると判断されるBB格相当や金融セクターおよび生活必需品セクターへの配分を多めに維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2017年6月16日～2017年12月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | 2 | 0.016 | 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) | (2) | (0.015) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 2 | 0.016 | |
| 期中の平均基準価額は、13,313円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年6月16日～2017年12月15日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|-----|------------------|------------------|
| 外 国 | アメリカ | 社債券 | 千アメリカドル 1,851 | 千アメリカドル 1,152 |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2017年6月16日～2017年12月15日)

利害関係人との取引状況

| 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 | $\frac{D}{C}$ |
|--------|------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 百万円 111 | 百万円 16 | % 14.4 | 百万円 30 | 百万円 18 | % 60.0 |

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年12月15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 8,100 | 千アメリカドル 8,394 | 千円 943,570 | % 95.4 | % 81.3 | % 56.0 | % 34.7 | % 4.7 |
| 合 計 | 8,100 | 8,394 | 943,570 | 95.4 | 81.3 | 56.0 | 34.7 | 4.7 |

(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 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 | |
| | 普通社債券 | | | | | |
| | 4.076 CAPITALAND 220920 | 4.076 | 200 | 207 | 23,320 | 2022/9/20 |
| | 4.25 MEGAWORLD CO 230417 | 4.25 | 200 | 202 | 22,802 | 2023/4/17 |
| | 4.25 SM INVESTMEN 191017 | 4.25 | 200 | 205 | 23,143 | 2019/10/17 |
| | 4.375 JGSH PHILIP 230123 | 4.375 | 200 | 207 | 23,314 | 2023/1/23 |
| | 4.45 SAKA ENERGI 240505 | 4.45 | 400 | 405 | 45,604 | 2024/5/5 |
| | 4.5 FPC TREASURY 230416 | 4.5 | 200 | 204 | 22,962 | 2023/4/16 |
| | 4.5 OLAM INTE 210412 | 4.5 | 200 | 202 | 22,706 | 2021/4/12 |
| | 4.875 SM INVESTME 240610 | 4.875 | 200 | 212 | 23,889 | 2024/6/10 |
| | 4.95 LISTRINDO 260914 | 4.95 | 400 | 406 | 45,634 | 2026/9/14 |
| | 5 PAKUWON PRIMA 240214 | 5.0 | 200 | 201 | 22,648 | 2024/2/14 |
| | 5.25 TBG GLOBAL P 220210 | 5.25 | 200 | 204 | 23,014 | 2022/2/10 |
| | 5.5 GLOBAL PRIME 231018 | 5.5 | 400 | 403 | 45,359 | 2023/10/18 |
| | 5.5 JAPFA COMFEED 220331 | 5.5 | 200 | 202 | 22,791 | 2022/3/31 |
| | 5.75 VLL INTERNAT 241128 | 5.75 | 200 | 202 | 22,771 | 2024/11/28 |
| | 6 FPC FINANCE LTD 190628 | 6.0 | 200 | 208 | 23,491 | 2019/6/28 |
| | 6.375 INDO ENERGY 230124 | 6.375 | 200 | 204 | 23,031 | 2023/1/24 |
| | 6.5 ENERGY DEVELO 210120 | 6.5 | 200 | 222 | 25,037 | 2021/1/20 |
| | 6.5 FIRST GEN COR 231009 | 6.5 | 200 | 214 | 24,091 | 2023/10/9 |
| | 6.75 THETA CAPITA 261031 | 6.75 | 200 | 199 | 22,399 | 2026/10/31 |
| | 6.875 INDIKA ENER 220410 | 6.875 | 400 | 418 | 47,040 | 2022/4/10 |
| | 6.95 ALAM SYNERGY 200327 | 6.95 | 200 | 202 | 22,711 | 2020/3/27 |
| | 6.95 MODERNLAND O 240413 | 6.95 | 200 | 204 | 22,931 | 2024/4/13 |
| | 7 THETA CAPITAL 220411 | 7.0 | 200 | 207 | 23,296 | 2022/4/11 |
| | 7.5 OLAM INTERNAT 200812 | 7.5 | 300 | 327 | 36,783 | 2020/8/12 |
| | 7.625 PB INTERNAT 220126 | 7.625 | 200 | 213 | 24,023 | 2022/1/26 |
| | 7.75 BUKIT MAKUR 220213 | 7.75 | 200 | 214 | 24,162 | 2022/2/13 |
| | 8.25 GOLDEN LEGAC 210607 | 8.25 | 200 | 217 | 24,485 | 2021/6/7 |
| | 8.5 MEDCO STRAITS 220817 | 8.5 | 200 | 212 | 23,928 | 2022/8/17 |
| | VAR KRUNG THAI BA 241226 | 5.2 | 200 | 206 | 23,231 | 2024/12/26 |
| | VAR PARKWAY PANTA 660127 | 4.25 | 200 | 201 | 22,602 | 2166/1/27 |
| | VAR PETRON CORP 490206 | 7.5 | 200 | 205 | 23,053 | 2049/2/6 |
| | VAR ROYAL CAPITAL 491229 | 4.875 | 400 | 406 | 45,690 | 2049/12/29 |
| | VAR SMC GLOBAL PO 491107 | 7.5 | 200 | 212 | 23,884 | 2049/11/7 |
| | VAR SMC GLOBAL PO 491229 | 6.75 | 400 | 424 | 47,731 | 2049/12/29 |
| 合 | 計 | | | | 943,570 | |

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

○投資信託財産の構成

(2017年12月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 943,570 | % 95.3 |
| コール・ローン等、その他 | 46,546 | 4.7 |
| 投資信託財産総額 | 990,116 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (976,836千円) の投資信託財産総額 (990,116千円) に対する比率は98.7%です。

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

| | | | |
|------------------|--|--|--|
| 1 アメリカドル=112.40円 | | | |
|------------------|--|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年12月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 998,543,626 |
| コール・ローン等 | 33,656,197 |
| 公社債(評価額) | 943,570,068 |
| 未収入金 | 8,427,000 |
| 未収利息 | 11,671,274 |
| 前払費用 | 1,219,087 |
| (B) 負債 | 9,441,862 |
| 未払金 | 8,428,425 |
| 未払解約金 | 1,013,419 |
| 未払利息 | 18 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 989,101,764 |
| 元本 | 729,583,558 |
| 次期繰越損益金 | 259,518,206 |
| (D) 受益権総口数 | 729,583,558口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,557円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 671,244,364円
 期中追加設定元本額 88,722,706円
 期中一部解約元本額 30,383,512円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,557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)

| | |
|---------------------------------|--------------|
| 海外債券セクション(ラップ向け) | 21,069,104円 |
| アセアン社債ファンド(毎月決算型) | 266,854,390円 |
| アセアン社債ファンド(ラップ向け) | 6,032,206円 |
| MUAM アセアン社債ファンド | 427,649,093円 |
| アドバンスト・バランスⅠ(FOF s用)(適格機関投資家限定) | 3,387,785円 |
| アドバンスト・バランスⅡ(FOF s用)(適格機関投資家限定) | 4,590,980円 |
| 合計 | 729,583,558円 |

○損益の状況

(2017年6月16日~2017年12月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 25,821,034 |
| 受取利息 | 25,620,310 |
| その他収益金 | 202,320 |
| 支払利息 | △ 1,596 |
| (B) 有価証券売買損益 | 20,810,313 |
| 売買益 | 25,815,527 |
| 売買損 | △ 5,005,214 |
| (C) 保管費用等 | △ 143,511 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 46,487,836 |
| (E) 前期繰越損益金 | 192,285,110 |
| (F) 追加信託差損益金 | 30,907,279 |
| (G) 解約差損益金 | △ 10,162,019 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 259,518,206 |
| 次期繰越損益金(H) | 259,518,206 |

- (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。

グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）

損益の状況、組入資産の明細は「グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）」の第1期（2017年4月7日～2017年9月5日）の決算資料から抜粋したものです。

■損益及び剰余金計算書

| 項目 | 第1期 自 平成29年4月7日 至 平成29年9月5日 | |
|--------------------------------------|-----------------------------------|--------------|
| | 金額（円） | |
| I 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | | 710,719,778 |
| 営業収益合計 | | 710,719,778 |
| II 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | | 2,338,747 |
| 委託者報酬 | | 18,050,297 |
| その他費用 | | 417,521 |
| 営業費用合計 | | 20,806,565 |
| 営業利益金額または損失金額（△） | | 689,913,213 |
| 経常利益金額または損失金額（△） | | 689,913,213 |
| 当期純利益金額または純損失金額（△） | | 689,913,213 |
| III 一部解約に伴う当期純利益金額 または純損失金額（△）分配額 | | 13,425,410 |
| IV 期首剰余金または欠損金（△） | | — |
| V 剰余金増加額 | | 83,989,058 |
| （当期追加信託に伴う剰余金増加額） | | (83,989,058) |
| VI 剰余金減少額 | | 1,440,040 |
| （当期一部解約に伴う剰余金減少額） | | (1,440,040) |
| VII 分配金 | | — |
| VIII 期末剰余金または欠損金（△） | | 759,036,821 |

■組入資産の明細

| 種類 | 銘柄 | 券面総額（口） | 評価額（円） | 備考 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託 受益証券 | グローバル社債マザーファンド | 13,779,413,997 | 14,563,462,653 | |
| | 合計 | 13,779,413,997 | 14,563,462,653 | |

下記は、グローバル社債マザーファンドの内容です。

有価証券明細表 (債券)

(平成29年9月5日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|---|------------|------------|----|
| 社債券 | 日本円 | ソニー130%コールオプション条 項付第6回無担保転換社債型新 株予約権付社債 | 32,000,000 | 37,040,000 | |
| | 計 | 銘柄数： 1 | 32,000,000 | 37,040,000 | |
| | | 組入時価比率： 0.3% | | 0.3% | |
| | 米ドル | 21ST CENTURY FOX AMERICA | 400,000.00 | 428,899.92 | |
| | | ABBOTT LABORATORIES | 500,000.00 | 515,233.52 | |
| | | ABBOTT LABORATORIES | 100,000.00 | 111,570.50 | |
| | | ABBVIE INC | 425,000.00 | 424,953.88 | |
| | | ABU DHABI NATIONAL ENERG | 325,000.00 | 339,035.45 | |
| | | ACTAVIS FUNDING SCS | 125,000.00 | 136,074.92 | |
| | | AERCAP IRELAND CAP/GLOBA | 300,000.00 | 307,805.21 | |
| | | AERCAP IRELAND CAP/GLOBA | 150,000.00 | 154,145.06 | |
| | | AIR LEASE CORP | 250,000.00 | 257,881.90 | |
| | | AIR LEASE CORP | 325,000.00 | 324,597.66 | |
| | | AIR LIQUIDE FINANCE | 550,000.00 | 537,760.85 | |
| | | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 325,000.00 | 316,064.12 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE E | 250,000.00 | 259,268.11 | |
| | | ALIBABA GROUP HOLDING | 525,000.00 | 530,282.02 | |
| | | ALIMENTATION COUCHE-TARD | 375,000.00 | 379,102.66 | |
| | | ALLERGAN FUNDING SCS | 600,000.00 | 612,280.10 | |
| | | AMAZON.COM INC | 625,000.00 | 672,557.32 | |
| | | AMAZON.COM INC | 275,000.00 | 286,259.52 | |
| | | AMBER CIRCLE FUNDING LTD | 250,000.00 | 256,423.50 | |
| | | AMER AIRLINE 16-2 AA PTT | 146,100.00 | 148,496.04 | |
| | | AMER AIRLN 13-1 A PASS T | 200,260.43 | 209,722.73 | |
| | | AMERICAN EXPRESS CREDIT | 400,000.00 | 408,118.31 | |
| | | AMGEN INC | 700,000.00 | 672,696.00 | |
| | | AMGEN INC | 100,000.00 | 108,420.62 | |
| | | ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN | 275,000.00 | 285,981.94 | |
| | | ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN | 700,000.00 | 789,929.28 | |
| | | APPALACHIAN POWER CO | 400,000.00 | 415,200.09 | |
| | | APPLE INC | 450,000.00 | 436,317.47 | |
| | | APPLE INC | 300,000.00 | 310,325.20 | |
| | | APPLE INC | 475,000.00 | 541,912.40 | |
| | | AT&T INC | 925,000.00 | 956,486.28 | |
| | | AT&T INC | 625,000.00 | 631,518.01 | |
| | | AT&T INC | 575,000.00 | 530,911.55 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES | 275,000.00 | 273,059.39 | |
| | | BAIDU INC | 300,000.00 | 303,259.50 | |
| | | BANCO SANTANDER | 200,000.00 | 203,500.00 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|--------------------------|------------|------------|----|
| 社債券 | 米ドル | BANK OF AMERICA CORP | 275,000.00 | 275,921.47 | |
| | | BANK OF AMERICA CORP | 550,000.00 | 568,704.92 | |
| | | BANK OF AMERICA CORP | 875,000.00 | 890,457.23 | |
| | | BANK OF AMERICA CORP | 325,000.00 | 375,775.31 | |
| | | BANK OF MONTREAL | 575,000.00 | 571,614.24 | |
| | | BARRICK GOLD CORP | 275,000.00 | 303,900.44 | |
| | | BASF SE | 250,000.00 | 254,312.50 | |
| | | BAXALTA INC | 100,000.00 | 115,523.86 | |
| | | BB&T | 525,000.00 | 525,435.78 | |
| | | BECTON DICKINSON AND CO | 275,000.00 | 275,960.79 | |
| | | BECTON DICKINSON AND CO | 150,000.00 | 157,127.74 | |
| | | BERKSHIRE HATHAWAY FIN | 700,000.00 | 695,932.39 | |
| | | BHP BILLITON FIN USA LTD | 400,000.00 | 434,279.64 | |
| | | BLACK HILLS CORP | 225,000.00 | 222,603.49 | |
| | | BMW US CAPITAL LLC | 200,000.00 | 199,991.34 | |
| | | BNP PARIBAS | 675,000.00 | 737,342.94 | |
| | | BOSTON PROPERTIES LP | 350,000.00 | 370,201.80 | |
| | | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 250,000.00 | 261,738.88 | |
| | | BP CAPITAL MARKETS PLC | 375,000.00 | 390,126.15 | |
| | | BP CAPITAL MARKETS PLC | 525,000.00 | 530,280.28 | |
| | | BPCE SA | 500,000.00 | 539,146.94 | |
| | | BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN | 550,000.00 | 542,398.34 | |
| | | BRIXMOR OPERATING PART | 450,000.00 | 456,247.27 | |
| | | BUCKEYE PARTNERS LP | 400,000.00 | 415,378.79 | |
| | | BURLINGTN NORTH SANTA FE | 375,000.00 | 415,022.40 | |
| | | CAPITAL ONE FINANCIAL CO | 525,000.00 | 529,718.53 | |
| | | CAPITAL ONE FINANCIAL CO | 700,000.00 | 699,478.64 | |
| | | CBQ FINANCE LTD | 250,000.00 | 248,070.75 | |
| | | CENCOSUD SA | 300,000.00 | 330,284.37 | |
| | | CENTERPOINT ENER HOUSTON | 425,000.00 | 421,774.28 | |
| | | CHARTER COMM OPT LLC | 200,000.00 | 214,082.98 | |
| | | CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 225,000.00 | 258,730.44 | |
| | | CIMAREX ENERGY CO | 250,000.00 | 253,588.01 | |
| | | CISCO SYSTEMS INC | 800,000.00 | 795,845.23 | |
| | | CITIGROUP INC | 325,000.00 | 335,483.49 | |
| | | CITIGROUP INC | 275,000.00 | 430,565.90 | |
| | | CITIGROUP INC | 450,000.00 | 609,737.18 | |
| | | CITIZENS BANK NA/RI | 300,000.00 | 302,609.60 | |
| | | CNOOC FINANCE 2012 LTD | 500,000.00 | 527,149.00 | |
| | | COMCAST CORP | 875,000.00 | 874,766.27 | |
| | | COMMONWEALTH BANK OF AUS | 475,000.00 | 509,472.55 | |
| | | CONOCOPHILLIPS COMPANY | 500,000.00 | 561,314.97 | |
| | | COOPERATIEVE RABOBANK U. | 500,000.00 | 527,215.26 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|--------------------------|------------|------------|----|
| 社債券 | 米ドル | COSTCO WHOLESALE CORP | 575,000.00 | 578,533.22 | |
| | | CRED SUIS GP FUN LTD | 600,000.00 | 644,492.28 | |
| | | CREDIT AGRICOLE LONDON | 750,000.00 | 801,056.70 | |
| | | CREDIT SUISSE GROUP AG | 250,000.00 | 257,282.65 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 500,000.00 | 534,586.50 | |
| | | CSX CORP | 225,000.00 | 216,766.56 | |
| | | CUBESMART LP | 175,000.00 | 169,284.03 | |
| | | DAIMLER FINANCE NA LLC | 525,000.00 | 521,148.62 | |
| | | DANONE SA | 725,000.00 | 720,515.31 | |
| | | DARDEN RESTAURANTS INC | 325,000.00 | 337,039.56 | |
| | | DCP MIDSTREAM LLC | 150,000.00 | 158,625.00 | |
| | | DELTA AIR LINES INC | 675,000.00 | 696,849.85 | |
| | | DEUTSCHE BANK NY | 650,000.00 | 654,515.82 | |
| | | DEUTSCHE TELEKOM INT FIN | 675,000.00 | 689,019.56 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST LP | 425,000.00 | 432,878.44 | |
| | | DISCOVER BANK | 440,000.00 | 450,779.56 | |
| | | DISCOVER FINANCIAL SERVI | 500,000.00 | 516,405.37 | |
| | | DOLLAR GENERAL CORP | 300,000.00 | 307,989.29 | |
| | | DOLLAR GENERAL CORP | 100,000.00 | 107,170.69 | |
| | | DUKE ENERGY CORP | 225,000.00 | 217,992.17 | |
| | | E. I. DU PONT DE NEMOURS | 500,000.00 | 503,542.17 | |
| | | EASTMAN CHEMICAL CO | 250,000.00 | 259,654.52 | |
| | | EDP FINANCE BV | 725,000.00 | 734,483.00 | |
| | | EMBRAER NETHERLANDS FINA | 275,000.00 | 294,263.75 | |
| | | EMERA US FINANCE LP | 600,000.00 | 610,865.42 | |
| | | ENABLE MIDSTREAM PARTNER | 325,000.00 | 325,348.67 | |
| | | ENEL SPA | 350,000.00 | 423,937.50 | |
| | | ENERGY LOUISIANA LLC | 325,000.00 | 321,919.47 | |
| | | EXPRESS SCRIPTS HOLDING | 250,000.00 | 269,564.29 | |
| | | EXPRESS SCRIPTS HOLDING | 175,000.00 | 183,133.03 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE LP | 300,000.00 | 325,500.00 | |
| | | EXXON MOBIL CORPORATION | 200,000.00 | 213,300.21 | |
| | | FIVE CORNERS FUNDING | 600,000.00 | 652,346.01 | |
| | | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 775,000.00 | 790,534.79 | |
| | | GE CAPITAL INTL FUNDING | 625,000.00 | 632,350.46 | |
| | | GE CAPITAL INTL FUNDING | 475,000.00 | 516,764.41 | |
| | | GENERAL MOTORS CO | 250,000.00 | 292,266.41 | |
| | | GEORGIA POWER CO | 575,000.00 | 575,776.77 | |
| | | GOLDCORP INC | 150,000.00 | 169,470.09 | |
| | | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 600,000.00 | 602,631.37 | |
| | | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 425,000.00 | 557,793.35 | |
| | | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 525,000.00 | 585,580.80 | |
| | | GUARDIAN LIFE INSURANCE | 250,000.00 | 270,777.03 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|--------------------------|--------------|--------------|----|
| 社債券 | 米ドル | HARRIS CORPORATION | 150,000.00 | 166,561.63 | |
| | | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 150,000.00 | 142,500.00 | |
| | | HOME DEPOT INC | 325,000.00 | 307,288.68 | |
| | | HSBC FINANCE CORP | 725,000.00 | 825,750.86 | |
| | | HSBC USA INC | 1,025,000.00 | 1,064,453.94 | |
| | | HUMANA INC | 250,000.00 | 264,630.83 | |
| | | ILLUMINA INC | 300,000.00 | 322,312.50 | |
| | | INDIAN RAILWAY FINANCE C | 250,000.00 | 255,674.25 | |
| | | ING BANK NV | 925,000.00 | 1,055,556.86 | |
| | | INTERNATIONAL PAPER CO | 575,000.00 | 558,771.91 | |
| | | INTESA SANPAOLO SPA | 500,000.00 | 555,258.57 | |
| | | INTESA SANPAOLO SPA | 225,000.00 | 237,629.04 | |
| | | JPMORGAN CHASE | 1,400,000.00 | 1,471,961.79 | |
| | | JPMORGAN CHASE & CO | 875,000.00 | 860,660.67 | |
| | | KINDER MORGAN ENER PART | 350,000.00 | 386,252.31 | |
| | | KINDER MORGAN ENER PART | 350,000.00 | 364,637.30 | |
| | | KRAFT HEINZ FOODS CO | 375,000.00 | 362,705.85 | |
| | | KROGER | 325,000.00 | 322,899.93 | |
| | | LIBERTY MUTUAL GROUP INC | 200,000.00 | 217,742.74 | |
| | | LINCOLN NATIONAL CORP | 200,000.00 | 271,058.62 | |
| | | LOCKHEED MARTIN CORP | 325,000.00 | 339,584.99 | |
| | | LOWE'S COS INC | 275,000.00 | 264,855.40 | |
| | | LYONDELLBASELL IND NV | 225,000.00 | 226,793.54 | |
| | | MACYS RETAIL HLDGS INC | 325,000.00 | 307,117.22 | |
| | | MASS MUTUAL LIFE INS CO | 100,000.00 | 104,021.34 | |
| | | MASTEC INC | 200,000.00 | 204,000.00 | |
| | | MCDONALD'S CORP | 325,000.00 | 341,877.70 | |
| | | MCDONALD'S CORP | 200,000.00 | 217,293.81 | |
| | | MEAD JOHNSON NUTRITION C | 250,000.00 | 257,400.84 | |
| | | MEDTRONIC INC | 250,000.00 | 283,600.20 | |
| | | METLIFE INC | 325,000.00 | 405,152.45 | |
| | | MEXICHEM SAB DE CV | 200,000.00 | 207,972.00 | |
| | | MICROSOFT CORP | 1,150,000.00 | 1,133,130.63 | |
| | | MICROSOFT CORP | 300,000.00 | 337,611.79 | |
| | | MPLX LP | 100,000.00 | 107,193.90 | |
| | | MPLX LP | 200,000.00 | 205,755.16 | |
| | | NATIONWIDE BLDG SOCIETY | 525,000.00 | 529,044.50 | |
| | | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 350,000.00 | 363,362.55 | |
| | | NISSAN MOTOR ACCEPTANCE | 525,000.00 | 531,456.76 | |
| | | NOVA CHEMICALS CORP | 150,000.00 | 155,625.00 | |
| | | NOVA CHEMICALS CORP | 150,000.00 | 150,187.50 | |
| | | NOVARTIS CAPITAL CORP | 275,000.00 | 306,630.15 | |
| | | OMNICOM GROUP INC | 375,000.00 | 380,911.32 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|--------------------------|------------|------------|----|
| 社債券 | 米ドル | ON SEMICONDUCTOR CORP | 275,000.00 | 317,968.75 | |
| | | ONCOR ELECTRIC DELIVERY | 525,000.00 | 527,702.88 | |
| | | ORACLE CORP | 600,000.00 | 610,547.86 | |
| | | PFIZER INC | 250,000.00 | 254,162.01 | |
| | | PHILIP MORRIS INTL INC | 150,000.00 | 162,402.95 | |
| | | PHILLIPS 66 PARTNERS LP | 300,000.00 | 301,557.86 | |
| | | PLAINS ALL AMER PIPELINE | 200,000.00 | 204,391.97 | |
| | | PNC FINANCIAL SERVICES | 800,000.00 | 850,123.22 | |
| | | PRICELINE GROUP INC/THE | 275,000.00 | 313,843.75 | |
| | | PRUDENTIAL FINANCIAL | 475,000.00 | 517,156.25 | |
| | | QUALCOMM INC | 625,000.00 | 630,908.08 | |
| | | RECKITT BENCKISER TSY | 525,000.00 | 525,862.26 | |
| | | ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 275,000.00 | 281,531.24 | |
| | | SABINE PASS LIQUEFACTION | 525,000.00 | 526,637.91 | |
| | | SANTANDER ISSUANCES | 200,000.00 | 215,664.59 | |
| | | SANTANDER UK GROUP HLDGS | 725,000.00 | 743,391.28 | |
| | | SANTANDER UK PLC | 250,000.00 | 272,231.75 | |
| | | SGSP AUSTRALIA ASSETS | 200,000.00 | 199,330.20 | |
| | | SHELL INTERNATIONAL FIN | 525,000.00 | 527,113.13 | |
| | | SHELL INTERNATIONAL FIN | 300,000.00 | 320,951.92 | |
| | | SHUTTERFLY INC | 300,000.00 | 298,500.00 | |
| | | SIEMENS FINANCIERINGSMAT | 800,000.00 | 760,570.62 | |
| | | SKANDINAVISKA ENSKILDA | 575,000.00 | 579,831.23 | |
| | | SOUTHERN COPPER CORP | 250,000.00 | 263,667.43 | |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL IN | 300,000.00 | 305,064.00 | |
| | | SPRINT CORP | 200,000.00 | 220,250.00 | |
| | | SPRINT SPECTRUM / SPEC I | 850,000.00 | 865,937.50 | |
| | | STANDARD CHARTERED PLC | 525,000.00 | 525,134.30 | |
| | | SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 575,000.00 | 569,141.73 | |
| | | SWEDBANK AB | 575,000.00 | 579,952.47 | |
| | | SYNCHRONY FINANCIAL | 575,000.00 | 579,156.57 | |
| | | TD AMERITRADE HOLDING CO | 450,000.00 | 457,503.00 | |
| | | TELEFONICA EMISIONES SAU | 525,000.00 | 548,863.71 | |
| | | TELENOR EAST HOLDING II | 400,000.00 | 451,800.00 | |
| | | TESLA INC | 175,000.00 | 197,421.87 | |
| | | TEVA PHARMACEUTICALS NE | 825,000.00 | 758,228.23 | |
| | | THAI OIL PCL | 325,000.00 | 337,486.52 | |
| | | THERMO FISHER SCIENTIFIC | 375,000.00 | 370,462.95 | |
| | | TIME WARNER INC | 375,000.00 | 378,899.62 | |
| | | TORONTO-DOMINION BANK | 475,000.00 | 475,349.64 | |
| | | TRANS-ALLEGHENY INTERSTA | 300,000.00 | 317,115.64 | |
| | | TRANSALTA INC | 200,000.00 | 204,384.00 | |
| | | TYCO ELECTRONICS GROUP S | 150,000.00 | 151,170.93 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------------------|------------|--------------------------|------------|------------------|---------------|
| 社債券 | 米ドル | TYSON FOODS INC | 150,000.00 | 166,834.50 | |
| | | UBS AG | 550,000.00 | 589,773.80 | |
| | | UBS GROUP FUNDING SWITZE | 475,000.00 | 488,451.30 | |
| | | UNITED TECHNOLOGIES CORP | 300,000.00 | 321,135.35 | |
| | | UNITEDHEALTH GROUP | 775,000.00 | 823,697.59 | |
| | | VALE OVERSEAS LIMITED | 150,000.00 | 172,117.50 | |
| | | VERIZON COMM INC | 675,000.00 | 629,987.76 | |
| | | VERIZON COMMUNICATIONS | 525,000.00 | 535,289.17 | |
| | | VIACOM INC | 100,000.00 | 102,694.16 | |
| | | VIAVI SOLUTIONS INC | 275,000.00 | 300,609.37 | |
| | | VIRGINIA ELEC & POWER CO | 300,000.00 | 324,342.64 | |
| | | VISA INC | 250,000.00 | 277,628.28 | |
| | | VODAFONE GROUP PLC | 225,000.00 | 228,210.65 | |
| | | WAL-MART STORES INC | 450,000.00 | 556,269.50 | |
| | | WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 200,000.00 | 200,405.25 | |
| | | WEC ENERGY GROUP INC | 500,000.00 | 521,834.68 | |
| | | WELLS FARGO & COMPANY | 525,000.00 | 536,304.54 | |
| | | WELLS FARGO & COMPANY | 825,000.00 | 813,283.19 | |
| | | WELLS FARGO & COMPANY | 275,000.00 | 277,291.38 | |
| | | WESTPAC BANKING CORP | 425,000.00 | 421,057.21 | |
| | | WOODSIDE FINANCE LTD | 475,000.00 | 479,167.17 | |
| | | 計 | 銘柄数 : | 229 | 93,161,360.43 |
| | | | | (10,614,730,721) | |
| | | 組入時価比率 : | 72.9% | 75.1% | |
| ユーロ | ユーロ | ABN AMRO BANK NV | 450,000.00 | 478,188.00 | |
| | | ADIF ALTA VELOCIDAD | 400,000.00 | 463,040.80 | |
| | | AIRBUS SE | 300,000.00 | 315,750.00 | |
| | | ALLIANZ SE | 500,000.00 | 544,523.50 | |
| | | AMERICA MOVIL SAB DE CV | 300,000.00 | 296,805.00 | |
| | | AQUARIUS AND INVESTMENT | 550,000.00 | 644,688.55 | |
| | | ASR NEDERLAND NV | 450,000.00 | 509,906.25 | |
| | | ASSICURAZIONI GENERALI | 500,000.00 | 578,505.00 | |
| | | ATF NETHERLANDS BV | 100,000.00 | 102,593.50 | |
| | | AURIZON NETWORK PTY LTD | 250,000.00 | 280,672.50 | |
| | | AXA SA | 350,000.00 | 421,319.15 | |
| | | AXA SA | 275,000.00 | 304,734.37 | |
| | | BANCO BILBAO VIZCAYA ARG | 200,000.00 | 210,018.40 | |
| | | BAYER AG | 400,000.00 | 429,820.00 | |
| | | BBVA SUB CAPITAL UNIPERS | 500,000.00 | 525,027.50 | |
| | | BNP PARIBAS | 300,000.00 | 317,073.30 | |
| | | BRAMBLES FINANCE LIMITED | 350,000.00 | 385,703.50 | |
| | | BRITISH TELECOMMUNICATIO | 150,000.00 | 155,289.75 | |
| CK HUTCHISON FINANCE 16 | 300,000.00 | 296,425.80 | | | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----|-----|--------------------------|------------|------------|----|
| 社債券 | ユーロ | COOPERATIEVE RABOBANK UA | 650,000.00 | 690,336.40 | |
| | | COOPERATIEVE RABOBANK UA | 375,000.00 | 400,140.00 | |
| | | CREDIT AGRICOLE | 600,000.00 | 638,533.80 | |
| | | CREDIT AGRICOLE ASSRNCES | 400,000.00 | 439,250.00 | |
| | | ECOLAB INC | 200,000.00 | 202,919.40 | |
| | | ELECTRICITE DE FRANCE | 300,000.00 | 324,795.60 | |
| | | ENBW | 150,000.00 | 158,584.05 | |
| | | ENEL FINANCE INTL NV | 200,000.00 | 201,740.20 | |
| | | ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 200,000.00 | 220,691.80 | |
| | | EUROPCAR GROUPE SA | 225,000.00 | 238,410.00 | |
| | | FCA BANK S.P.A. | 475,000.00 | 488,004.07 | |
| | | FCC AQUALIA SA | 300,000.00 | 303,004.20 | |
| | | FROMAGERIES BEL | 100,000.00 | 102,460.80 | |
| | | GAS NATURAL FENOSA FINAN | 400,000.00 | 430,170.00 | |
| | | GAS NETWORKS IRELAND | 475,000.00 | 488,303.80 | |
| | | HEATHROW FUNDING LTD | 350,000.00 | 375,915.75 | |
| | | IE2 HOLDCO | 200,000.00 | 216,073.60 | |
| | | INGENICO GROUP SA | 200,000.00 | 211,539.00 | |
| | | INMOBILIARIA COLONIAL SA | 300,000.00 | 298,584.00 | |
| | | INTERNATIONAL GAME | 175,000.00 | 194,057.50 | |
| | | INTRUM JUSTITIA AB | 100,000.00 | 100,788.30 | |
| | | ITALGAS SPA | 350,000.00 | 360,966.20 | |
| | | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 200,000.00 | 202,300.00 | |
| | | JOHNSON CONTROLS INTERNA | 300,000.00 | 304,445.40 | |
| | | LLOYDS TSB BANK PLC | 550,000.00 | 637,233.30 | |
| | | MUENCHENER RUECKVERSICHE | 500,000.00 | 600,847.50 | |
| | | NATIONWIDE BUILDING SOCI | 750,000.00 | 765,534.74 | |
| | | ORIGIN ENERGY FINANCE | 125,000.00 | 131,548.75 | |
| | | POSTE VITA SPA | 150,000.00 | 157,111.65 | |
| | | REPSOL | 200,000.00 | 212,856.00 | |
| | | ROYAL BK OF SCOTLAND PLC | 500,000.00 | 569,660.50 | |
| | | RYANAIR DAC | 250,000.00 | 256,227.75 | |
| | | SANTANDER ISSUANCES | 600,000.00 | 641,807.40 | |
| | | SAP SE | 150,000.00 | 157,950.75 | |
| | | SCENTRE MGMT LTD | 225,000.00 | 244,639.57 | |
| | | SOCIETE GENERALE | 500,000.00 | 537,369.50 | |
| | | SOLVAY FINANCE | 175,000.00 | 201,253.15 | |
| | | STATE GRID EUROPE DEVELO | 150,000.00 | 155,040.00 | |
| | | TELEFONICA EUROPE BV | 300,000.00 | 342,861.00 | |
| | | TOTAL SA | 150,000.00 | 162,657.75 | |
| | | TRANSURBAN FINANCE CO | 375,000.00 | 396,316.87 | |
| | | VESTEDA FINANCE BV | 275,000.00 | 299,254.72 | |
| | | VIENNA INSURANCE GRP AGW | 400,000.00 | 478,493.20 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 | | |
|--------------------------|--------------|------------------------|------------------|------------------------|-----------------|------------|--|
| 社債券 | ユーロ | VILMORIE ET COMP | 200,000.00 | 209,060.00 | | | |
| | | VODAFONE GROUP PLC | 275,000.00 | 296,080.95 | | | |
| | | VOLKSWAGEN INTL FIN NV | 300,000.00 | 301,216.20 | | | |
| | | VOLKSWAGEN INTL FIN NV | 375,000.00 | 396,680.62 | | | |
| | | VONOVIA FINANCE B.V. | 200,000.00 | 211,141.40 | | | |
| | | VONOVIA FINANCE BV | 200,000.00 | 227,099.60 | | | |
| | | ZIMMER BIOMET HOLDINGS | 225,000.00 | 234,755.77 | | | |
| | | 計 | 銘柄数： 69 | 21,950,000.00 | 23,676,797.38 | | |
| | | | | | (3,088,164,682) | | |
| | | | 組入時価比率： 21.2% | | 21.9% | | |
| | | 英ポンド | 英ポンド | ANGLIAN WATER SERV FIN | 300,000.00 | 302,263.80 | |
| | | | | ANNINGTON FUNDING PLC | 150,000.00 | 164,503.50 | |
| | | | | APT PIPELINES LTD | 400,000.00 | 426,951.20 | |
| J SAINSBURY PLC | 200,000.00 | | | 202,880.00 | | | |
| JOHN LEWIS PLC | 350,000.00 | | | 376,525.80 | | | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCI | 200,000.00 | | | 207,894.00 | | | |
| NGG FINANCE PLC | 225,000.00 | | | 256,740.75 | | | |
| RWE | 200,000.00 | | | 214,098.20 | | | |
| VIRGIN MEDIA SECURED FIN | 150,000.00 | | | 158,793.75 | | | |
| WELLS FARGO & COMPANY | 400,000.00 | | | 412,556.80 | | | |
| 計 | 銘柄数： 10 | | | 2,575,000.00 | 2,723,207.80 | | |
| | | | | | (385,824,080) | | |
| | 組入時価比率： 2.6% | | | | 2.7% | | |
| 合計 | | | 14,125,759,483 | | | | |
| | | | (14,088,719,483) | | | | |

(注1) 通貨種類毎の計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()は、外貨建有価証券に関わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各計欄の合計金額に対する比率であります。