

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	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）

海外債券セクション （ラップ向け）

第5期（決算日：2022年2月7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「海外債券セクション（ラップ向け）」は、去る2月7日に第5期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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 騰 落	期 騰 落	中 率				
(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
2期(2019年2月5日)	10,410	0	△2.6	113,019.80	△1.7	62.8	—	34.7	5,700
3期(2020年2月5日)	11,178	0	7.4	120,270.89	6.4	64.3	—	32.8	6,384
4期(2021年2月5日)	11,579	0	3.6	124,867.08	3.8	63.4	—	33.2	8,265
5期(2022年2月7日)	11,855	0	2.4	127,308.73	2.0	63.0	—	32.8	14,001

(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	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2021年 2 月 5 日	円 11,579	% —	124,867.08	% —	% 63.4	% —	% 33.2
2 月 末	11,530	△0.4	124,359.44	△0.4	63.2	—	33.1
3 月 末	11,722	1.2	126,595.03	1.4	62.5	—	32.8
4 月 末	11,758	1.5	126,569.17	1.4	62.8	—	32.8
5 月 末	11,924	3.0	128,227.80	2.7	62.7	—	32.9
6 月 末	11,945	3.2	128,117.08	2.6	62.7	—	32.7
7 月 末	11,997	3.6	128,989.36	3.3	63.2	—	33.1
8 月 末	11,981	3.5	128,937.19	3.3	63.3	—	33.1
9 月 末	11,941	3.1	128,115.00	2.6	62.7	—	33.0
10 月 末	12,174	5.1	130,788.36	4.7	62.7	—	32.8
11 月 末	12,014	3.8	129,217.14	3.5	63.3	—	33.0
12 月 末	12,119	4.7	130,157.13	4.2	63.4	—	33.1
2022年 1 月 末	11,890	2.7	128,015.91	2.5	63.0	—	32.7
(期 末) 2022年 2 月 7 日	11,855	2.4	127,308.73	2.0	63.0	—	32.8

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第5期：2021年2月6日～2022年2月7日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第5期首	11,579円
第5期末	11,855円
既払分配金	0円
騰落率	2.4%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.4%の上昇となりました。

▶ 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「グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）」が、円安・米ドル高等を背景に上昇したこと等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

▶ 海外債券市況

海外債券市況は下落しました。

期初から、新型コロナウイルスワクチン接種の進展による景気回復期待等から米欧を中心に長期金利は上昇しました。その後上下する展開となったものの、2021年12月に主要国中央銀行が金融政策の正常化に前向きな姿勢を示したこと等から米国や欧州主要国の長期金利がともに上昇したこと等から、海外債券市況は下落しました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

円・米ドル相場は、期初から米国長期金利が本邦長期金利に比べて大きく上昇したこと等から米ドル高が進行し、米ドルは対円で上昇しました。

円・ユーロ相場は、欧州の景気回復期待の高まりや欧州長期金利が本邦長期金利に比べて大きく上昇したこと等から、ユーロ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

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、期首から「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スマザーファンド」、「グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）」に投資を行いました。

（ご参考）

■投資信託証券別組入比率表

投資信託証券	期首	期末
外国債券インデックススマザーファンド	61.1	61.0
新興国債券インデックススマザーファンド	3.7	3.8
グローバル社債ファンドＴ（適格機関投資家専用）（※）	33.2	32.8

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する各投資信託証券の評価額の割合です。

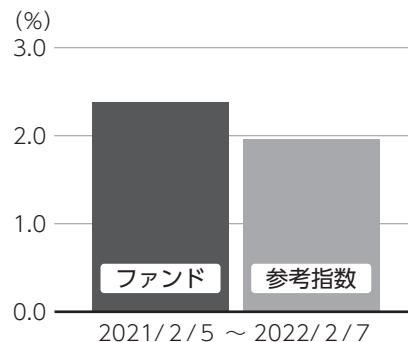
（※）グローバル社債マザーファンドへの投資を行います。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

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ＦＴＳＥ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

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

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第5期 2021年2月6日～2022年2月7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	1,855

（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。）

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。

2021年2月6日～2022年2月7日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	50	0.420	(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）	(39)	(0.332)	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）	(5)	(0.044)	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）	(5)	(0.044)	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	0.014	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.009)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	52	0.434	

期中の平均基準価額は、11,908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。

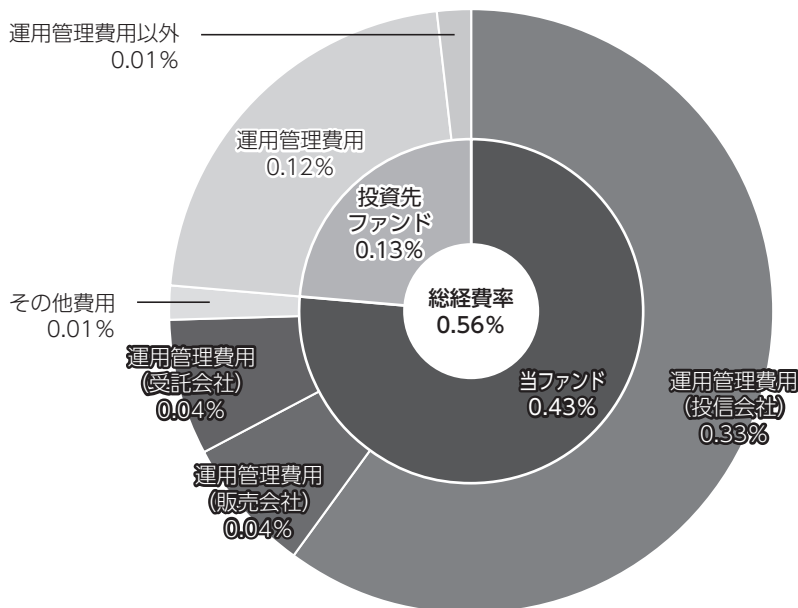
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.56%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	0.56
①当ファンドの費用の比率	(%)	0.43
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	0.12
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.01

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

○売買及び取引の状況

(2021年2月6日～2022年2月7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 1,347,171	千円 1,710,830	千口 —	千円 —

(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
	新興国債券インデックスマザーファンド	千口 154,353	千円 218,530	千口 2,005	千円 2,850
	外国債券インデックスマザーファンド	1,483,230	3,398,930	—	—

○利害関係人との取引状況等

(2021年2月6日～2022年2月7日)

利害関係人との取引状況

<海外債券セクション（ラップ向け）>

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	B/A	%	うち利害関係人との取引状況 D	D/C	%
投資信託証券	百万円 1,710	百万円 1,710	100.0	百万円 —	百万円 —	—

<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			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	%	うち利害関係人との取引状況 D	D/C	%
為替先物取引	百万円 —	百万円 —	—	百万円 184	百万円 46	25.0
為替直物取引	23,069	8,542	37.0	9,631	3,185	33.1

平均保有割合 0.9%

※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。

<外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	15,100	8,839	58.5	10,927	4,091	37.4
為替直物取引	130,997	75,420	57.6	24,741	23,263	94.0

平均保有割合 3.1%

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

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

○組入資産の明細

(2022年2月7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	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
グローバル社債ファンドT（適格機関投資家専用）	2,252,715	3,599,887	4,586,976	32.8
合 計	2,252,715	3,599,887	4,586,976	32.8

(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	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
新興国債券インデックスマザーファンド	217,954	370,303	529,755
外国債券インデックスマザーファンド	2,259,516	3,742,747	8,534,961

○投資信託財産の構成

（2022年2月7日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 4,586,976	% 32.6
新興国債券インデックスマザーファンド	529,755	3.8
外国債券インデックスマザーファンド	8,534,961	60.7
コール・ローン等、その他	403,025	2.9
投資信託財産総額	14,054,717	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（53,007,618千円）の投資信託財産総額（53,281,355千円）に対する比率は99.5%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（287,921,558千円）の投資信託財産総額（293,267,565千円）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=115.26円	1 カナダドル=90.40円	1 アルゼンチンペソ=1.0931円	1 メキシコペソ=5.5765円
1 ブラジルリアル=21.635円	100チリペソ=13.9236円	100コロンビアペソ=2.9122円	1 ベルギーフラン=29.9672円
1 ウルグアイペソ=2.6345円	1 ドミニカペソ=2.0001円	1 ユーロ=131.98円	1 イギリスポンド=155.99円
1 スウェーデンクローネ=12.61円	1 ノルウェークローネ=13.09円	1 セルビアディナール=1.122132円	1 デンマーククローネ=17.73円
1 トルコリラ=8.5077円	1 チェココルナ=5.4221円	100ハンガリーフォリント=37.2713円	1 ポーランドズロチ=28.9165円
1 ロシアルーブル=1.51円	1 ルーマニアレイ=26.6913円	1 オーストラリアドル=81.50円	1 シンガポールドル=85.68円
1 マレーシアリンギット=27.539円	1 タイバーツ=3.50円	1 フィリピンペソ=2.2542円	100インドネシアアルピア=0.80円
1 中国元=18.1252円	1 イスラエルシケル=35.9667円	1 エジプトポンド=7.3234円	1 南アフリカランド=7.45円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年2月7日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,054,717,085
コール・ローン等	403,023,702
投資信託受益証券(評価額)	4,586,976,147
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	529,755,890
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	8,534,961,346
(B) 負債	53,193,422
未払解約金	24,714,655
未払信託報酬	28,211,386
未払利息	180
その他未払費用	267,201
(C) 純資産総額(A－B)	14,001,523,663
元本	11,810,435,273
次期繰越損益金	2,191,088,390
(D) 受益権総口数	11,810,435,273口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,855円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,138,466,679円
 期中追加設定元本額 6,169,114,566円
 期中一部解約元本額 1,497,145,972円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1855円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年2月6日～ 2022年2月7日
費用控除後の配当等収益額	119,729,217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	18,936,792円
収益調整金額	1,619,356,451円
分配準備積立金額	433,065,930円
当ファンドの分配対象収益額	2,191,088,390円
1万口当たり収益分配対象額	1,855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】

「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

○損益の状況（2021年2月6日～2022年2月7日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 58,517
受取利息	930
支払利息	△ 59,447
(B) 有価証券売買損益	187,876,365
売買益	225,870,560
売買損	△ 37,994,195
(C) 信託報酬等	△ 49,151,839
(D) 当期損益金(A+B+C)	138,666,009
(E) 前期繰越損益金	433,065,930
(F) 追加信託差損益金	1,619,356,451
(配当等相当額)	(1,096,905,920)
(売買損益相当額)	(522,450,531)
(G) 計(D+E+F)	2,191,088,390
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	2,191,088,390
追加信託差損益金	1,619,356,451
(配当等相当額)	(1,101,711,310)
(売買損益相当額)	(517,645,141)
分配準備積立金	571,731,939

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

外国債券インデックスマザーファンド

《第20期》決算日2021年5月12日

[計算期間：2020年5月13日～2021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20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20期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	FTSE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FTSE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	FTSE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		FTSE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	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2017年5月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	—	132,430
17期(2018年5月14日)	20,178	1.4	112,563.85	1.4	98.9	—	120,314
18期(2019年5月13日)	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	—	137,361
19期(2020年5月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	—	149,310
20期(2021年5月12日)	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	—	197,147

(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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年5月12日	円	%		%	%	%
	21,324	—	119,287.72	—	98.6	—
5月末	21,689	1.7	120,973.12	1.4	98.5	—
6月末	22,034	3.3	123,063.01	3.2	98.6	—
7月末	22,254	4.4	123,870.50	3.8	98.6	—
8月末	22,232	4.3	124,064.52	4.0	97.7	—
9月末	22,338	4.8	124,690.18	4.5	97.6	—
10月末	22,007	3.2	122,727.67	2.9	97.6	—
11月末	22,233	4.3	124,001.42	4.0	98.1	—
12月末	22,419	5.1	125,045.38	4.8	98.0	—
2021年1月末	22,388	5.0	125,100.34	4.9	97.5	—
2月末	22,188	4.1	124,359.44	4.3	97.5	—
3月末	22,675	6.3	126,595.03	6.1	96.9	—
4月末	22,666	6.3	126,569.17	6.1	97.3	—
(期 末) 2021年5月12日	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	—

(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6.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.1%)を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

- ・ 先進国の債券市況は、米国での新型コロナウイルスのワクチン普及や経済正常化期待を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 期首に比べて米ドル、ユーロ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

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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6.1%の上昇になったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月13日～2021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	%	(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)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、22,261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。

○売買及び取引の状況

(2020年5月13日～2021年5月12日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 431,248	千アメリカドル 241,937
	カナダ	千カナダドル 21,874	千カナダドル 12,073
	メキシコ	千メキシコペソ 90,438	千メキシコペソ 48,301
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 46,054	28,476
	イタリア	国債証券 50,920	24,332
	フランス	国債証券 63,243	38,211
	オランダ	国債証券 9,541	6,157
	スペイン	国債証券 58,303	32,472
	ベルギー	国債証券 11,039	6,714
	オーストリア	国債証券 7,338	5,512
	フィンランド	国債証券 2,627	564
	アイルランド	国債証券 4,227	1,584
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 31,602	千イギリスポンド 14,381
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 16,299	千スウェーデンクローネ -
国	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 10,063	千ノルウェークローネ 5,968
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 15,168	千デンマーククローネ 6,223
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 15,136	千ポーランドズロチ 5,001
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 26,760	千オーストラリアドル 14,961
	シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 3,205	千シンガポールドル 1,699
	マレーシア	国債証券 千マレーシアリングギット 13,837	千マレーシアリングギット 5,921
	イスラエル	国債証券 千イスラエルシェケル 11,261	千イスラエルシェケル 4,045

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月13日～2021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 53,450	百万円 22,889	% 42.8	百万円 15,522	百万円 11,605	% 74.8

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

○組入資産の明細

(2021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
アメリカ	千アメリカドル 745,900	千アメリカドル 791,527	千円 86,118,145	% 43.7	% —	% 19.9	% 18.4	% 5.3
カナダ	千カナダドル 41,220	千カナダドル 44,059	3,958,295	2.0	—	0.9	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 258,890	千メキシコペソ 277,114	1,508,276	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	84,150	104,102	13,747,828	7.0	—	4.7	2.3	—
イタリア	121,670	143,401	18,937,589	9.6	—	6.0	2.6	1.0
フランス	121,490	145,132	19,166,233	9.7	—	6.7	2.9	0.1
オランダ	22,080	26,797	3,538,940	1.8	—	1.4	0.4	—
スペイン	81,600	97,583	12,886,874	6.5	—	4.3	1.9	0.3
ベルギー	27,480	33,751	4,457,265	2.3	—	1.8	0.4	—
オーストリア	16,180	19,648	2,594,742	1.3	—	1.0	0.3	—
フィンランド	8,140	8,758	1,156,609	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	10,400	11,767	1,553,984	0.8	—	0.7	0.1	—
イギリス	千イギリスポンド 66,320	千イギリスポンド 82,520	12,680,141	6.4	—	4.9	1.2	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 48,070	千スウェーデンクローネ 51,639	674,934	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 34,610	千ノルウェークローネ 35,620	468,050	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 44,060	千デンマーククローネ 53,168	944,270	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 38,930	千ポーランドズロチ 42,465	1,234,965	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 47,250	千オーストラリアドル 51,186	4,355,450	2.2	—	1.5	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 9,100	千シンガポールドル 9,838	806,560	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 33,660	千マレーシアリンギット 35,465	936,001	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシケル 20,930	千イスラエルシケル 24,476	809,198	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	192,534,359	97.7	—	56.5	33.1	8.0

(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	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	0.125	T-NOTE 230515	0.125	6,700	6,694	728,362	2023/5/15
		0.125	T-NOTE 230715	0.125	2,600	2,596	282,515	2023/7/15
		0.125	T-NOTE 230815	0.125	4,500	4,492	488,815	2023/8/15
		0.125	T-NOTE 230915	0.125	6,350	6,338	689,638	2023/9/15
		0.125	T-NOTE 231015	0.125	4,200	4,191	455,996	2023/10/15
		0.125	T-NOTE 231215	0.125	8,500	8,476	922,235	2023/12/15
		0.125	T-NOTE 240115	0.125	9,100	9,068	986,637	2024/1/15
		0.125	T-NOTE 240215	0.125	6,800	6,775	737,181	2024/2/15
		0.25	T-NOTE 231115	0.25	4,700	4,703	511,719	2023/11/15
		0.25	T-NOTE 250630	0.25	3,350	3,301	359,183	2025/6/30
		0.25	T-NOTE 250731	0.25	4,600	4,528	492,660	2025/7/31
		0.375	T-NOTE 240415	0.375	3,300	3,306	359,755	2024/4/15
		0.375	T-NOTE 251130	0.375	5,950	5,860	637,599	2025/11/30
		0.375	T-NOTE 260131	0.375	5,400	5,304	577,169	2026/1/31
		0.375	T-NOTE 270930	0.375	6,100	5,804	631,507	2027/9/30
		0.5	T-NOTE 270430	0.5	4,130	3,995	434,757	2027/4/30
		0.5	T-NOTE 270531	0.5	4,280	4,134	449,802	2027/5/31
		0.5	T-NOTE 270630	0.5	4,600	4,436	482,669	2027/6/30
		0.5	T-NOTE 270831	0.5	6,800	6,533	710,882	2027/8/31
		0.625	T-NOTE 271231	0.625	5,800	5,580	607,154	2027/12/31
		0.625	T-NOTE 300515	0.625	6,970	6,424	698,942	2030/5/15
		0.625	T-NOTE 300815	0.625	8,110	7,441	809,676	2030/8/15
		0.75	T-NOTE 260331	0.75	7,800	7,786	847,214	2026/3/31
		0.75	T-NOTE 280131	0.75	10,200	9,880	1,075,036	2028/1/31
		0.875	T-NOTE 301115	0.875	5,570	5,214	567,335	2030/11/15
		1.125	T-NOTE 270228	1.125	2,950	2,969	323,078	2027/2/28
		1.125	T-NOTE 310215	1.125	6,000	5,730	623,526	2031/2/15
		1.25	T-BOND 500515	1.25	5,250	4,022	437,637	2050/5/15
		1.25	T-NOTE 230731	1.25	2,550	2,609	283,953	2023/7/31
		1.375	T-BOND 500815	1.375	3,730	2,953	321,361	2050/8/15
		1.375	T-NOTE 230215	1.375	3,000	3,065	333,489	2023/2/15
		1.375	T-NOTE 230630	1.375	2,900	2,973	323,555	2023/6/30
		1.375	T-NOTE 230831	1.375	4,550	4,672	508,382	2023/8/31
		1.375	T-NOTE 230930	1.375	3,800	3,905	424,922	2023/9/30
		1.375	T-NOTE 250131	1.375	4,050	4,180	454,874	2025/1/31
		1.5	T-NOTE 230228	1.5	4,200	4,302	468,116	2023/2/28
		1.5	T-NOTE 230331	1.5	3,250	3,332	362,605	2023/3/31
		1.5	T-NOTE 240930	1.5	6,000	6,220	676,821	2024/9/30
		1.5	T-NOTE 241031	1.5	2,900	3,005	327,043	2024/10/31
		1.5	T-NOTE 241130	1.5	2,580	2,674	291,022	2024/11/30
		1.5	T-NOTE 260815	1.5	6,050	6,245	679,478	2026/8/15
		1.5	T-NOTE 270131	1.5	2,740	2,818	306,636	2027/1/31
		1.5	T-NOTE 300215	1.5	5,010	5,002	544,321	2030/2/15
		1.625	T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,732	188,536	2022/8/15
		1.625	T-NOTE 220831	1.625	7,640	7,791	847,694	2022/8/31
		1.625	T-NOTE 221115	1.625	5,200	5,318	578,622	2022/11/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.625 T-NOTE 221215	1.625	3,000	3,071	334,190	2022/12/15
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,800	2,883	313,707	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	3,100	3,207	348,939	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,720	5,951	647,521	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	6,280	6,530	710,567	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,550	3,683	400,739	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,523	383,372	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	4,810	4,878	530,789	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	4,900	4,982	542,137	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,700	3,765	409,659	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220630	1.75	4,900	4,992	543,209	2022/6/30
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,840	200,284	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,700	2,774	301,884	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,800	4,952	538,825	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 241231	1.75	2,850	2,980	324,312	2024/12/31
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	3,100	3,233	351,785	2026/12/31
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	760	774	84,254	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	4,500	4,597	500,233	2022/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	5,000	5,115	556,537	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	3,500	3,585	390,096	2022/9/30
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,700	2,769	301,344	2022/10/31
	2 T-BOND 500215	2.0	4,450	4,123	448,623	2050/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,900	2,967	322,865	2022/7/31
	2 T-NOTE 221031	2.0	2,850	2,928	318,631	2022/10/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	6,200	6,380	694,164	2022/11/30
	2 T-NOTE 240430	2.0	3,600	3,780	411,279	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	3,850	4,045	440,151	2024/5/31
	2 T-NOTE 240630	2.0	2,200	2,313	251,748	2024/6/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	5,300	5,597	608,985	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	6,610	6,993	760,913	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,150	5,443	592,231	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	3,300	3,376	367,363	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	5,150	5,317	578,552	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	4,550	4,785	520,681	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	6,460	6,800	739,912	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	3,450	3,645	396,576	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,250	2,381	259,057	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	2,012	218,953	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,300	5,632	612,792	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	3,400	3,342	363,706	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	4,160	4,076	443,502	2049/8/15
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	3,300	3,478	378,450	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	5,000	5,287	575,237	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,800	2,975	323,763	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,250	7,708	838,685	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,490	6,946	755,760	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	5,350	5,724	622,848	2027/2/15

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					
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	7,300	7,801	848,812	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	5,700	6,084	662,020	2027/11/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	3,700	3,725	405,296	2049/11/15
	2.375 T-NOTE 230131	2.375	5,000	5,191	564,867	2023/1/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	7,300	7,775	845,989	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	6,140	6,613	719,517	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	4,650	4,987	542,638	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	4,240	4,383	476,917	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,720	3,839	417,747	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,300	3,404	370,414	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,900	4,102	446,381	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,789	738,670	2024/1/31
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,700	6,075	661,027	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,450	2,632	286,395	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	3,000	3,133	340,947	2023/2/28
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,600	2,735	297,653	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,800	4,105	446,709	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	4,900	5,327	579,580	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	4,800	5,219	567,854	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	5,470	5,969	649,511	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,450	2,662	289,717	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,930	3,180	346,054	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	3,060	3,307	359,900	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	2,920	3,158	343,670	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 230430	2.75	3,600	3,782	411,570	2023/4/30
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	6,400	6,740	733,393	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,050	8,559	931,264	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	5,960	6,368	692,927	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	4,050	4,391	477,767	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	3,800	4,136	450,100	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,840	6,364	692,403	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	7,660	8,420	916,097	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,100	4,537	493,719	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	2,350	2,595	282,416	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,080	3,404	370,381	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	3,580	3,976	432,653	2049/5/15
	2.875 T-NOTE 230930	2.875	6,400	6,806	740,574	2023/9/30
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	5,200	5,539	602,711	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	3,800	4,149	451,489	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250531	2.875	4,230	4,621	502,812	2025/5/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	4,173	454,057	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	6,050	6,704	729,412	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	7,610	8,437	917,977	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,810	2,047	222,774	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	2,400	2,705	294,371	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	2,020	2,278	247,926	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,500	1,694	184,352	2045/11/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-BOND 470215	3.0	3,150	3,564	387,768	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,750	3,111	338,493	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,470	3,932	427,883	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	3,980	4,518	491,600	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	4,090	4,650	505,969	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	4,900	5,399	587,494	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	4,800	5,291	575,749	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,050	2,363	257,105	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	2,180	2,515	273,725	2042/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,950	3,395	369,392	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,630	4,209	457,980	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	8,450	9,523	1,036,183	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,840	4,599	500,420	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,770	4,577	498,075	2048/11/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,420	3,005	327,021	2043/8/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,650	2,076	225,956	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,650	3,352	364,747	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,220	1,555	169,207	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	3,400	4,513	491,068	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,850	2,473	269,164	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	2,920	3,902	424,570	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,750	3,714	404,107	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	4,200	5,689	619,037	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,660	2,261	246,036	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	2,410	3,218	350,191	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	2,930	3,973	432,300	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	2,830	3,873	421,419	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,700	3,762	409,336	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,080	2,958	321,917	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	3,040	4,309	468,918	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	780	1,000	108,818	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	1,030	1,326	144,317	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	2,770	3,729	405,798	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	3,550	4,591	499,516	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	3,700	4,612	501,847	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	2,300	3,022	328,870	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	3,630	4,126	449,017	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,150	1,614	175,695	2030/5/15
小	計				86,118,145	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 220801	0.25	1,200	1,200	107,863	2022/8/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	2,200	1,997	179,466	2030/12/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	2,350	2,374	213,300	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,200	1,194	107,335	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	2,100	2,147	192,953	2025/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,650	1,690	151,897	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	2,062	185,314	2024/9/1

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		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,440	1,481	133,116	2026/6/1	
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	2,900	2,977	267,491	2023/3/1	
		2 CAN GOVT 230901	2.0	3,000	3,113	279,743	2023/9/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	2,300	2,423	217,720	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	3,050	2,954	265,459	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	1,800	1,891	169,929	2024/3/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	2,000	2,124	190,892	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	1,820	1,949	175,117	2029/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,700	2,865	257,408	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	872	78,430	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	860	975	87,654	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	410	475	42,730	2064/12/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,130	1,440	129,409	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	810	1,082	97,209	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	600	862	77,460	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,930	2,579	231,771	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	920	1,320	118,617	2033/6/1	
小	計					3,958,295		
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	37,300	42,571	231,710	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	10,600	13,223	71,970	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	27,700	27,434	149,319	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	19,400	19,757	107,536	2022/6/9	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	13,500	13,932	75,833	2023/3/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	33,150	35,257	191,899	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	11,650	12,428	67,647	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	9,500	9,987	54,358	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	15,240	15,238	82,939	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	23,450	25,063	136,413	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	15,800	16,083	87,539	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	27,000	30,254	164,669	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	14,600	15,880	86,436	2038/11/18	
小	計					1,508,276		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 350515	—	1,120	1,107	146,266	2035/5/15
			0 BUND 500815	—	1,450	1,286	169,850	2050/8/15
			0.25 BUND 270215	0.25	3,450	3,601	475,650	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	4,350	4,552	601,207	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	4,700	4,917	649,456	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	3,900	4,070	537,530	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	4,600	4,839	639,106	2026/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	2,620	2,780	367,232	2027/8/15
			0.5 BUND 280215	0.5	2,220	2,360	311,724	2028/2/15
			1 BUND 240815	1.0	2,770	2,922	385,996	2024/8/15
			1 BUND 250815	1.0	4,200	4,492	593,329	2025/8/15
			1.25 BUND 480815	1.25	2,550	3,129	413,333	2048/8/15
			1.5 BUND 230515	1.5	3,600	3,760	496,595	2023/5/15

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	
ドイツ	国債証券	1.5 BUND 240515	1.5	3,300	3,519	464,730	2024/5/15
		1.75 BUND 240215	1.75	5,950	6,355	839,269	2024/2/15
		2 BUND 230815	2.0	1,450	1,539	203,281	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	2,550	3,834	506,438	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	2,520	3,858	509,579	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	1,930	3,146	415,578	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,570	4,144	547,339	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,650	2,871	379,258	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,680	3,687	486,976	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,720	4,449	587,565	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,870	3,497	461,815	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	3,280	5,123	676,639	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	2,880	4,065	536,928	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	2,530	3,001	396,356	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	2,640	4,164	549,996	2030/1/4
6.5 BUND 270704	6.5	2,100	3,019	398,792	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,900	1,923	253,974	2025/2/1
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	1,850	1,876	247,755	2026/2/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,720	2,777	366,746	2023/10/15
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	2,660	2,732	360,911	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	3,200	3,249	429,110	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,680	2,741	361,999	2023/3/15
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	680	631	83,420	2037/3/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,050	2,154	284,460	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,180	2,277	300,715	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,400	1,433	189,348	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,600	1,682	222,185	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,600	1,687	222,895	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,280	1,291	170,581	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,850	1,956	258,373	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,090	2,231	294,650	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	1,900	2,028	267,908	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	2,220	2,358	311,411	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	550	514	67,974	2051/9/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,230	1,252	165,371	2041/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,270	1,344	177,618	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,760	1,906	251,821	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	2,200	2,412	318,595	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,950	2,140	282,734	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,650	1,804	238,335	2026/7/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,900	2,103	277,733	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,350	1,506	198,961	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,810	2,070	273,365	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,460	1,616	213,534	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,300	2,504	330,755	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,710	1,890	249,639	2025/11/15
2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,490	1,737	229,419	2047/3/1		

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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,750	2,027	267,712	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,440	1,648	217,740	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,250	1,517	200,417	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	1,850	2,183	288,311	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,090	1,349	178,256	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,540	1,968	259,944	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,020	1,280	169,077	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,450	1,918	253,370	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,610	3,205	423,291	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,200	2,476	327,053	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,220	1,727	228,166	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,420	3,279	433,146	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	3,200	3,502	462,521	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,520	2,847	376,027	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,100	2,531	334,359	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,700	4,112	543,066	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,200	4,140	546,742	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,710	2,672	352,930	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,920	3,471	458,471	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,460	3,575	472,213	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,200	3,396	448,592	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,860	2,893	382,098	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	3,740	5,119	676,096	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,650	1,775	234,513	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,200	2,388	315,386	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,080	3,135	414,016	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,780	4,119	544,043	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,420	3,344	441,721	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,050	2,821	372,650	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	2,550	3,129	413,338	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	2,000	2,031	268,328	2024/2/25
		0 O. A. T 240325	—	2,000	2,033	268,528	2024/3/25
		0 O. A. T 250325	—	2,750	2,801	370,008	2025/3/25
		0 O. A. T 260225	—	2,500	2,545	336,169	2026/2/25
		0 O. A. T 291125	—	3,800	3,791	500,719	2029/11/25
		0 O. A. T 301125	—	1,600	1,580	208,747	2030/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	2,550	2,630	347,330	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	3,450	3,588	473,843	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	3,500	3,655	482,718	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	3,500	3,649	481,990	2029/5/25
		0.5 O. A. T 400525	0.5	1,150	1,107	146,319	2040/5/25
		0.5 O. A. T 720525	0.5	1,010	754	99,660	2072/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	3,570	3,798	501,657	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	3,900	4,150	548,104	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	630	586	77,446	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	3,420	3,643	481,220	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	3,230	3,479	459,462	2027/5/25

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	1.25 O.A.T 340525	1.25	3,750	4,159	549,305	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	3,040	3,367	444,657	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	3,990	4,525	597,613	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	2,870	3,263	431,015	2050/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,900	3,041	401,641	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	3,550	3,839	507,039	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	2,610	3,122	412,332	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,340	1,644	217,227	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	2,800	3,534	466,711	2048/5/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	3,340	3,628	479,191	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	4,830	5,897	778,764	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	4,790	5,721	755,633	2027/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	2,220	3,401	449,254	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	4,450	5,317	702,259	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,290	3,595	474,882	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,810	3,363	444,213	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,680	3,255	429,889	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	6,500	7,282	961,722	2023/10/25
4.5 O.A.T 410425	4.5	3,510	6,021	795,150	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,570	4,092	540,423	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	5,250	7,589	1,002,315	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,840	4,617	609,789	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	2,700	3,486	460,409	2025/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,300	1,533	202,532	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 240115	—	1,250	1,272	168,065	2024/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	400	403	53,297	2030/7/15
		0 NETH GOVT 520115	—	670	575	76,056	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,395	184,322	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,550	1,604	211,933	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,830	1,921	253,782	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	500	517	68,296	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,740	1,860	245,639	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,530	1,642	216,959	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,500	1,580	208,732	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,550	1,681	222,054	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,790	2,303	304,138	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,330	2,094	276,663	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,500	2,532	334,428	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	2,090	3,320	438,483	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,500	2,090	276,084	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	1,900	1,923	253,960	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	4,630	4,686	618,874	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	2,300	2,320	306,488	2026/1/31
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	1,720	1,752	231,483	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,600	1,614	213,269	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,450	1,471	194,332	2022/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	1,600	1,636	216,159	2029/10/31

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	
スペイン	国債証券	0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	3,650	3,827	505,423	2027/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,400	1,236	163,246	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	550	549	72,626	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	4,230	4,540	599,671	2030/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	1,750	1,905	251,692	2028/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	3,250	3,545	468,245	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,070	3,358	443,470	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	290	249	32,949	2071/10/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,050	2,206	291,429	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	2,150	2,430	320,927	2035/7/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,900	2,101	277,587	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,620	1,845	243,782	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	4,660	5,164	681,991	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,920	2,287	302,105	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,230	1,584	209,257	2048/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,540	2,045	270,101	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,320	1,990	262,845	2066/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,090	3,087	407,752	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	2,350	2,636	348,223	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,150	2,600	343,477	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,810	2,955	390,316	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,140	2,449	323,458	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,340	3,875	511,808	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,910	3,985	526,374	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,310	2,334	308,232	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,750	1,929	254,815	2023/1/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,330	3,634	480,036	2032/7/30
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	5,190	6,835	902,677	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,450	4,980	657,775	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.1 BEL GOVT 300622	0.1	800	804	106,228	2030/6/22
		0.2 BEL GOVT 231022	0.2	350	357	47,165	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	800	829	109,554	2024/10/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	420	335	44,312	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,600	1,686	222,749	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,080	1,152	152,175	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,600	1,712	226,174	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	1,380	1,488	196,520	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,600	1,715	226,555	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,305	172,452	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,030	1,149	151,831	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	490	557	73,572	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	970	1,122	148,173	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	590	698	92,206	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,100	1,332	175,908	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	570	773	102,185	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	870	114,969	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	530	721	95,313	2057/6/22

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	2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,580	1,738	229,574	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	810	1,084	143,167	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	900	1,469	194,082	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	720	1,016	134,284	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,630	2,700	356,681	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,218	160,964	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,850	3,000	396,227	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,080	2,909	384,233	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	250	253	33,468	2023/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,000	1,001	132,312	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	400	397	52,428	2031/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,150	1,208	159,623	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	700	734	96,973	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	850	903	119,318	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,200	1,282	169,317	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	460	462	61,087	2051/3/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,110	1,194	157,690	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	570	683	90,298	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	270	339	44,835	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,160	1,250	165,078	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,700	1,799	237,614	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	600	945	124,871	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	740	944	124,758	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	610	955	126,232	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	520	1,055	139,394	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,370	2,173	287,081	2037/3/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	693	91,590	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	970	1,368	180,767	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	350	355	46,928	2023/9/15
		0 FINNISH GOVT 240915	—	850	866	114,467	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	450	449	59,342	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	630	606	80,145	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	250	211	27,901	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	130	123	16,305	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	418	55,314	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,000	1,051	138,843	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	250	262	34,702	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	400	419	55,420	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	373	49,386	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	530	70,030	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	380	421	55,703	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	360	427	56,514	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	260	34,401	2023/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	215	28,464	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	400	570	75,326	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	530	644	85,111	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	460	547	72,296	2025/7/4

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	
アイルランド	国債証券	0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	700	692	91,499	2035/5/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	850	911	120,375	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,570	1,676	221,436	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,150	1,250	165,196	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	600	667	88,165	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	540	602	79,610	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	460	521	68,906	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	900	1,057	139,615	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	750	942	124,510	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,180	1,425	188,307	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	667	88,180	2024/3/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,349	178,177	2025/3/13		
小 計						78,040,068	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
イギリス	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	1,200	1,199	184,253	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	2,000	1,978	304,056	2026/1/30
		0.375 GILT 301022	0.375	2,080	1,987	305,409	2030/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	1,380	1,401	215,411	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	880	812	124,914	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,840	1,502	230,934	2050/10/22
		0.75 GILT 230722	0.75	2,450	2,487	382,245	2023/7/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,060	1,070	164,430	2029/10/22
		1 GILT 240422	1.0	1,700	1,743	267,930	2024/4/22
		1.25 GILT 270722	1.25	2,240	2,341	359,750	2027/7/22
		1.5 GILT 260722	1.5	1,910	2,019	310,287	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,840	1,885	289,717	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	880	943	145,041	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	750	874	134,309	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	3,900	3,988	612,836	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	1,930	2,072	318,452	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,070	1,160	178,268	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	1,850	2,074	318,723	2057/7/22
		2 GILT 250907	2.0	1,080	1,161	178,504	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	2,170	2,280	350,376	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,410	1,994	306,498	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,160	1,259	193,605	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,020	2,762	424,555	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,910	2,733	420,023	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,380	2,488	382,367	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	1,780	2,855	438,850	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	1,180	2,150	330,444	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	1,530	1,897	291,531	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,090	2,809	431,631	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,550	2,198	337,772	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,130	1,682	258,481	2039/9/7
4.25 GILT 401207	4.25	1,390	2,098	322,451	2040/12/7		
4.25 GILT 461207	4.25	1,590	2,571	395,079	2046/12/7		

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 491207	4.25 1,280	2,150	330,389	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25 1,670	3,015	463,395	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5 1,990	2,828	434,561	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5 1,980	3,152	484,489	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75 1,920	2,610	401,124	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75 1,290	2,006	308,375	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0 1,530	1,809	277,992	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0 330	459	70,665	2028/12/7
小	計				12,680,141	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125 6,450	6,254	81,745	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75 5,850	6,080	79,467	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75 4,900	5,080	66,398	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0 5,660	5,962	77,932	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5 8,300	8,672	113,350	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5 6,230	6,895	90,130	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5 6,900	7,178	93,825	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5 3,780	5,515	72,084	2039/3/30
小	計				674,934	
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	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25 3,000	2,935	38,576	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375 4,200	4,183	54,967	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5 4,160	4,261	56,002	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75 4,000	4,135	54,343	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75 3,050	3,158	41,496	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75 3,200	3,298	43,347	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0 4,150	4,278	56,219	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0 4,450	4,677	61,462	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0 4,400	4,690	61,635	2024/3/14
小	計				468,050	
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 221115	0.25 3,000	3,036	53,919	2022/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25 3,300	2,995	53,194	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5 7,350	7,701	136,779	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5 9,050	9,474	168,271	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5 6,050	6,361	112,983	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75 4,850	5,327	94,612	2025/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5 10,460	18,271	324,508	2039/11/15
小	計				944,270	
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	2.25 POLAND 241025	2.25 4,000	4,229	123,013	2024/10/25
		2.5 POLAND 230125	2.5 2,500	2,601	75,662	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5 2,600	2,759	80,257	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5 5,500	5,875	170,872	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5 3,850	4,111	119,561	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75 6,710	7,287	211,941	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75 900	974	28,343	2029/10/25

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	
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	3.25 POLAND 250725	4,950	5,430	157,937	2025/7/25
		4 POLAND 231025	2,700	2,951	85,831	2023/10/25
		5.75 POLAND 220923	1,550	1,671	48,597	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	2,870	3,771	109,693	2029/4/25
		POLAND 220725	800	799	23,253	2022/7/25
小	計				1,234,965	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	2,650	2,611	222,191	2025/11/21
		1 AUST GOVT 311121	2,510	2,336	198,821	2031/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1,650	1,565	133,237	2032/5/21
		1.5 AUST GOVT 310621	2,240	2,206	187,721	2031/6/21
		1.75 AUST GOVT 321121	800	795	67,731	2032/11/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1,320	1,070	91,126	2051/6/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2,300	2,471	210,292	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2,950	3,197	272,034	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2,400	2,588	220,215	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2,250	2,492	212,095	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	1,930	2,139	182,040	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2,580	2,854	242,893	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	820	893	76,025	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	2,070	2,226	189,484	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	2,000	2,220	188,936	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3,950	4,524	385,020	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	820	932	79,304	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	1,130	1,371	116,710	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	3,210	3,770	320,823	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	1,270	1,641	139,670	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	2,250	2,750	234,045	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	2,550	2,818	239,793	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 220715	1,600	1,706	145,233	2022/7/15
小	計				4,355,450	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.75 SINGAPORGOVT 230201	550	562	46,125	2023/2/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700	699	57,354	2050/3/1
		2 SINGAPORGOVT 240201	100	103	8,515	2024/2/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	460	486	39,860	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	610	640	52,497	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	600	639	52,434	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	200	214	17,546	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800	870	71,355	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	450	471	38,665	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	410	466	38,283	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	520	601	49,322	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	590	655	53,712	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	650	725	59,492	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	600	646	52,970	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	800	828	67,918	2022/9/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	560	659	54,103	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	500	566	46,400	2027/3/1
小	計					806,560	
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	917	24,204	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,230	32,483	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	900	932	24,620	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	1,100	1,154	30,475	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	512	13,531	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	1,200	1,243	32,807	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	2,300	2,295	60,593	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,400	1,408	37,172	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,051	27,756	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,000	2,104	55,544	2029/8/15
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	530	14,007	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,163	30,712	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,000	1,065	28,122	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,700	1,797	47,434	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	800	845	22,311	2025/9/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	4,100	4,329	114,272	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	850	883	23,310	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	971	25,631	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,700	1,862	49,167	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,299	34,295	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,650	1,740	45,944	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,340	3,600	95,012	2037/4/7
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	1,120	1,213	32,038	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	1,200	1,309	34,548	2043/9/30
小	計					936,001	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	2,800	2,805	92,749	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	700	682	22,578	2030/3/31
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	1,250	1,175	38,868	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	2,880	3,162	104,558	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	4,300	4,749	157,035	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,600	2,002	66,197	2047/3/31
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	1,800	1,947	64,373	2023/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	2,100	3,287	108,694	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,662	154,144	2026/10/30
小	計					809,198	
合	計					192,534,359	

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

○投資信託財産の構成

(2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 192,534,359	% 96.8
コール・ローン等、その他	6,283,184	3.2
投資信託財産総額	198,817,543	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (198,059,384千円) の投資信託財産総額 (198,817,543千円) に対する比率は99.6%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=108.80円	1 カナダドル=89.84円	1 メキシコペソ=5.4428円	1 ユーロ=132.06円
1 イギリスポンド=153.66円	1 スウェーデンクローネ=13.07円	1 ノルウェークローネ=13.14円	1 デンマーククローネ=17.76円
1 ポーランドズロチ=29.0819円	1 オーストラリアドル=85.09円	1 シンガポールドル=81.98円	1 マレーシアリングギット=26.392円
1 イスラエルシェケル=33.0602円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	199,845,425,451
コール・ローン等	3,681,628,034
公社債(評価額)	192,534,359,448
未収入金	2,171,028,221
未収利息	1,309,658,157
前払費用	148,751,591
(B) 負債	2,698,255,110
未払金	1,402,319,690
未払解約金	1,295,935,299
未払利息	121
(C) 純資産総額(A-B)	197,147,170,341
元本	87,094,050,705
次期繰越損益金	110,053,119,636
(D) 受益権総口数	87,094,050,705口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,636円

<注記事項>

- ①期首元本額 70,021,031,430円
 期中追加設定元本額 24,738,230,739円
 期中一部解約元本額 7,665,211,464円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,2636円です。

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

MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	29,803,072,262円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	11,404,539,028円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	10,057,402,905円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,016,217,221円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	5,069,032,183円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	2,603,395,815円
海外債券セレクション(ラップ向け)	2,528,084,995円
つみたて8資産均等バランス	2,348,179,805円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,241,938,399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)	1,981,395,788円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,935,497,618円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,913,410,294円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,890,205,455円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,490,578,017円
ファンド・マネジャー(海外債券)	780,618,642円
つみたて4資産均等バランス	670,714,190円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	648,037,989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)	599,217,462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)	467,808,317円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	401,078,845円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	329,596,923円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	265,721,496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)	228,722,487円
eMAXIS バランス(波乗り型)	225,207,248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)	175,334,952円

○損益の状況 (2020年5月13日~2021年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,714,184,847
受取利息	3,722,576,271
支払利息	△ 8,391,424
(B) 有価証券売買損益	6,022,987,801
売買益	15,085,636,756
売買損	△ 9,062,648,955
(C) 保管費用等	△ 18,999,923
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,718,172,725
(E) 前期繰越損益金	79,289,207,528
(F) 追加信託差損益金	30,390,584,207
(G) 解約差損益金	△ 9,344,844,824
(H) 計(D+E+F+G)	110,053,119,636
次期繰越損益金(H)	110,053,119,636

- (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。

eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	129,085,044円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	111,119,836円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	100,996,372円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	82,812,826円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	70,411,380円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	66,959,620円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	51,658,210円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	49,867,397円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	36,559,597円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	34,417,736円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	33,234,146円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	30,135,434円
eMAXIS 最適化バランス (マイフワード)	28,555,224円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	28,363,872円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	26,634,308円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	23,312,362円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	22,743,263円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	20,246,172円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	18,410,281円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	11,806,374円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	11,504,199円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	9,655,419円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	6,186,974円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	4,457,516円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,210,966円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,708,160円
コアバランス	1,524,285円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,430,832円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	970,542円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	887,872円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	453,867円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	442,839円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	217,254円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	62,190円
合計	87,094,050,705円

新興国債券インデックスマザーファンド

《第12期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022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12期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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て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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
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		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)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4%	34,033.56	15.6%	96.7%	—	百万円 16,676
9期(2019年1月28日)	13,254	△ 8.4	31,268.09	△ 8.1	96.7%	—	20,421
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4%	—	30,520
11期(2021年1月26日)	13,819	△ 4.2	32,923.96	△ 3.7	97.6%	—	37,779
12期(2022年1月26日)	14,025	1.5	33,419.11	1.5	97.5%	—	51,888

(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) 2021年 1 月 26 日	円	%		%	%	%
	13,819	—	32,923.96	—	97.6	—
1 月 末	13,922	0.7	33,168.88	0.7	97.3	—
2 月 末	13,909	0.7	33,279.87	1.1	97.7	—
3 月 末	13,862	0.3	33,051.70	0.4	96.3	—
4 月 末	14,137	2.3	33,694.42	2.3	97.2	—
5 月 末	14,467	4.7	34,537.40	4.9	97.1	—
6 月 末	14,461	4.6	34,491.41	4.8	96.6	—
7 月 末	14,256	3.2	34,039.21	3.4	97.2	—
8 月 末	14,311	3.6	34,154.94	3.7	96.9	—
9 月 末	14,142	2.3	33,770.38	2.6	96.6	—
10 月 末	14,226	2.9	34,001.56	3.3	96.3	—
11 月 末	13,749	△0.5	32,777.10	△0.4	96.3	—
12 月 末	14,133	2.3	33,749.85	2.5	96.4	—
(期 末) 2022年 1 月 26 日	14,025	1.5	33,419.11	1.5	97.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

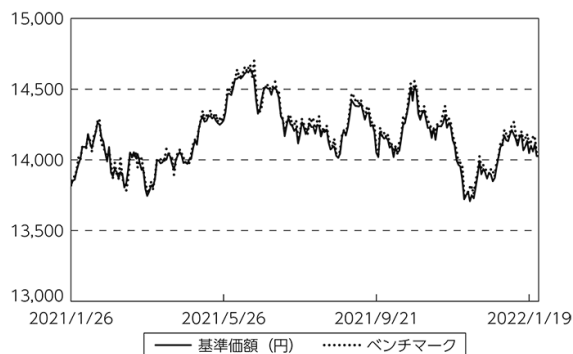
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.5%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は下落しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、新型コロナウイルスの感染再拡大によるリスク回避的な動きが高まったことに加え、インフレ懸念や利上げによる金利上昇などを受け期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

期首に比べてトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が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

- ・ 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。
- ・ 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1.5%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月27日～2022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 13	% 0.092	(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 ）	(11)	(0.075)	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)	(0.017)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.092	
期中の平均基準価額は、14,157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

(2021年1月27日～2022年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	メキシコ	千メキシコペソ 405,278	千メキシコペソ 133,881
	ブラジル	千ブラジルリアル 102,055	千ブラジルリアル 32,440
	チリ	千チリペソ 1,731,693	千チリペソ -
	コロンビア	千コロンビアペソ 23,751,859	千コロンビアペソ 7,714,863
	ペルー	千ペルーヌエボソル 8,745	千ペルーヌエボソル -
	ウルグアイ	千ウルグアイペソ 17,171	千ウルグアイペソ 8,444
	セルビア	千セルビアディナール 135,233	千セルビアディナール -
	トルコ	千トルコリラ 30,988	千トルコリラ 4,239
	チェコ	千チェココルナ 432,900	千チェココルナ 228,209
	ハンガリー	千ハンガリーフォリント 2,520,897	千ハンガリーフォリント 1,059,068
	ポーランド	千ポーランドズロチ 55,033	千ポーランドズロチ 18,010
	ロシア	千ロシアルーブル 799,095	千ロシアルーブル 120,939
	ルーマニア	千ルーマニアレイ 31,282	千ルーマニアレイ 11,981
	マレーシア	千マレーシアリングgit 79,313	千マレーシアリングgit 12,275
	タイ	千タイバーツ 571,343	千タイバーツ 78,029
	インドネシア	千インドネシアルピア 227,547,010	千インドネシアルピア 61,724,730
	中国	千中国元 100,124	千中国元 58,151
	南アフリカ	千南アフリカランド 240,444	千南アフリカランド 34,314

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022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 22,403	百万円 8,639	% 38.6	百万円 8,800	百万円 3,004	% 34.1

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

○組入資産の明細

(2022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
メキシコ	千メキシコペソ 859,200	千メキシコペソ 867,717	千円 4,791,620	% 9.2	% —	% 5.2	% 3.0	% 1.1
ブラジル	千ブラジルレアル 240,320	千ブラジルレアル 210,620	4,405,645	8.5	8.5	0.9	2.9	4.7
チリ	千チリペソ 7,820,000	千チリペソ 7,508,057	1,068,223	2.1	—	1.2	0.7	0.1
コロンビア	千コロンビアペソ 78,470,000	千コロンビアペソ 70,920,718	2,034,573	3.9	—	2.7	1.2	0.1
ペルー	千ペルーヌエボソル 37,100	千ペルーヌエボソル 37,605	1,112,641	2.1	—	1.8	0.4	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 24,000	千ウルグアイペソ 23,500	60,176	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 24,000	千ドミニカペソ 25,863	50,883	0.1	0.1	—	0.1	0.0
セルビア	千セルビアディナール 128,000	千セルビアディナール 136,883	149,775	0.3	0.3	0.2	0.1	—
トルコ	千トルコリラ 85,100	千トルコリラ 65,452	552,645	1.1	1.1	0.3	0.5	0.3
チェコ	千チェココルナ 530,700	千チェココルナ 453,194	2,382,306	4.6	—	3.4	0.5	0.7
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 5,366,000	千ハンガリーフォリント 4,924,331	1,765,697	3.4	—	1.5	1.7	0.3
ポーランド	千ポーランドズロチ 136,850	千ポーランドズロチ 129,226	3,629,560	7.0	—	2.3	3.4	1.2
ロシア	千ロシアルーブル 2,527,900	千ロシアルーブル 2,242,692	3,251,904	6.3	—	3.5	2.2	0.5
ルーマニア	千ルーマニアレイ 58,660	千ルーマニアレイ 57,798	1,503,724	2.9	—	0.9	1.5	0.4
マレーシア	千マレーシアリンギット 159,090	千マレーシアリンギット 161,021	4,373,834	8.4	—	4.8	2.9	0.7
タイ	千タイバーツ 1,313,100	千タイバーツ 1,362,724	4,701,398	9.1	—	5.1	2.8	1.1
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 22,270	49,456	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 590,780,000	千インドネシアルピア 634,235,069	5,073,880	9.8	—	6.8	2.6	0.3

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
中国	千中国元 280,200	千中国元 287,235	千円 5,168,196	% 10.0	% —	% 5.0	% 4.1	% 0.9
南アフリカ	千南アフリカランド 668,300	千南アフリカランド 599,232	4,476,263	8.6	8.6	6.9	1.6	0.1
合 計	—	—	50,602,408	97.5	18.6	52.7	32.1	12.7

(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	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券					
	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	68,700	73,308	404,814	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	17,700	21,129	116,678	2036/11/20
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	5,700	5,221	28,831	2027/3/4
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	119,200	112,102	619,042	2026/3/5
	6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	37,000	36,963	204,117	2023/3/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	97,200	97,315	537,386	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	83,300	83,971	463,698	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	24,900	24,968	137,877	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	50,900	49,351	272,521	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	63,300	64,082	353,868	2023/12/7
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	92,000	93,379	515,648	2024/9/5
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	63,400	62,974	347,750	2047/11/7
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	74,000	78,142	431,508	2029/5/31
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	61,900	64,808	357,876	2038/11/18
小計					4,791,620	
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	28,270	27,303	571,124	2027/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	24,950	24,417	510,747	2025/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 310101	10.0	8,300	7,724	161,566	2031/1/1
	10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	16,000	15,099	315,836	2029/1/1
	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	15,400	15,241	318,807	2023/1/1
	BRAZIL-LTN 230701	—	53,900	45,966	961,504	2023/7/1
	BRAZIL-LTN 240101	—	68,300	55,409	1,159,025	2024/1/1
	BRAZIL-LTN 240701	—	25,200	19,458	407,032	2024/7/1
小計					4,405,645	
チリ			千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券					
	2.3 BONOS TESORER 281001	2.3	280,000	229,866	32,704	2028/10/1
	2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,640,000	1,506,750	214,375	2025/3/1
	4 BONOS TESORERIA 230301	4.0	490,000	488,456	69,496	2023/3/1
	4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,200,000	1,171,260	166,643	2026/3/1
	4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,280,000	1,225,664	174,383	2030/9/1
	5 BONOS TESORERIA 281001	5.0	660,000	645,353	91,818	2028/10/1
	5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,290,000	1,235,276	175,751	2035/3/1
	6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	980,000	1,005,431	143,049	2043/1/1
小計					1,068,223	
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	7,700,000	8,159,329	234,074	2024/7/24
	4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,666,224	47,800	2023/3/21
	5.75 TITULOS DE T 271103	5.75	4,900,000	4,296,398	123,255	2027/11/3
	6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	10,580,000	9,248,121	265,310	2028/4/28
	6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	5,690,000	5,372,736	154,133	2025/11/26
	6.25 TITULOS DE T 360709	6.25	4,100,000	3,125,293	89,658	2036/7/9
	7 TITULOS DE TESO 310326	7.0	4,600,000	4,057,154	116,391	2031/3/26
	7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	8,800,000	7,609,368	218,297	2032/6/30

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		
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	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	8,200,000	7,022,096	201,449	2034/10/18
		7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	5,800,000	4,526,874	129,866	2050/10/26
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	7,544,092	216,424	2026/8/26
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	7,360,000	6,870,429	197,098	2030/9/18
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,422,599	40,811	2027/6/28
小	計					2,034,573	
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	5.35 PERU 400812	5.35	2,600	2,187	64,732	2040/8/12
		5.4 PERU 340812	5.4	3,600	3,253	96,269	2034/8/12
		5.7 PERU 240812	5.7	1,300	1,341	39,680	2024/8/12
		5.94 PERU 290212	5.94	4,700	4,774	141,250	2029/2/12
		6.15 PERU 320812	6.15	5,500	5,468	161,790	2032/8/12
		6.35 PERU 280812	6.35	4,900	5,119	151,464	2028/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	4,700	4,733	140,043	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	5,300	5,631	166,632	2031/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	4,500	5,096	150,776	2026/8/12
小	計					1,112,641	
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	8.25 URUGUAY 310521	8.25	17,000	16,547	42,372	2031/5/21
		8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,953	17,804	2028/3/15
小	計					60,176	
ドミニカ				千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8.9	8,000	8,247	16,226	2023/2/15
		9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	17,616	34,657	2026/6/5
小	計					50,883	
セルビア				千セルビアディナール	千セルビアディナール		
	国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	4.5	46,000	48,350	52,904	2026/1/11
		4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	47,000	49,292	53,935	2032/8/20
		5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	35,000	39,239	42,935	2028/2/8
小	計					149,775	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	2,400	1,960	16,556	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	5,200	3,369	28,451	2027/8/11
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	6,979	58,928	2026/2/11
		10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	6,900	6,672	56,337	2022/8/17
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	3,032	25,605	2027/2/24
		11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	11,800	7,351	62,071	2030/11/13
		12.2 TURKEY GOVT 230118	12.2	5,600	5,294	44,706	2023/1/18
		12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	4,100	2,837	23,955	2028/3/8
		12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	8,600	6,794	57,365	2025/10/1
		16.2 TURKEY GOVT 230614	16.2	1,300	1,229	10,378	2023/6/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	3,400	2,988	25,234	2023/3/8
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	7,300	5,212	44,009	2025/3/12
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	3,400	3,216	27,157	2022/9/14

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		
トルコ		%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券 9 TURKEY GOVT 240724	9.0	11,000	8,514	71,887	2024/7/24	
小	計				552,645		
チェコ			千チェココルナ	千チェココルナ			
	国債証券 0.05 CZECH REPUB 291129	0.05	151,000	118,654	623,731	2029/11/29	
	0.25 CZECH REPUB 270210	0.25	147,500	127,061	667,922	2027/2/10	
	0.45 CZECH REPUB 231025	0.45	76,500	72,051	378,753	2023/10/25	
	1.5 CZECH REPUB 400424	1.5	15,500	11,721	61,614	2040/4/24	
	1.75 CZECH REPUB 320623	1.75	89,200	77,657	408,224	2032/6/23	
	CZECH REPUBLIC 241212	—	51,000	46,047	242,059	2024/12/12	
小	計				2,382,306		
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 1.5 HUNGARY 230823	1.5	50,000	48,345	17,334	2023/8/23	
	1.5 HUNGARY 260422	1.5	810,000	716,904	257,057	2026/4/22	
	1.5 HUNGARY 260826	1.5	160,000	140,221	50,278	2026/8/26	
	2.25 HUNGARY 330420	2.25	330,000	259,909	93,194	2033/4/20	
	2.5 HUNGARY 241024	2.5	390,000	373,049	133,763	2024/10/24	
	2.75 HUNGARY 261222	2.75	373,000	344,399	123,489	2026/12/22	
	3 HUNGARY 240626	3.0	359,000	349,648	125,371	2024/6/26	
	3 HUNGARY 271027	3.0	421,000	387,719	139,023	2027/10/27	
	3 HUNGARY 300821	3.0	498,000	438,990	157,406	2030/8/21	
	3 HUNGARY 381027	3.0	250,000	197,387	70,776	2038/10/27	
	3 HUNGARY 410425	3.0	130,000	98,202	35,211	2041/4/25	
	3.25 HUNGARY 311022	3.25	618,000	544,631	195,286	2031/10/22	
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	492,000	508,088	182,183	2025/6/24	
	6 HUNGARY 231124	6.0	303,000	313,514	112,415	2023/11/24	
	6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	203,321	72,904	2028/10/22	
小	計				1,765,697		
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券 0.25 POLAND 261025	0.25	10,600	8,975	252,079	2026/10/25	
	0.75 POLAND 250425	0.75	8,500	7,805	219,244	2025/4/25	
	1.25 POLAND 301025	1.25	8,500	6,895	193,680	2030/10/25	
	2.25 POLAND 241025	2.25	11,000	10,712	300,891	2024/10/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	9,100	9,058	254,438	2023/1/25	
	2.5 POLAND 240425	2.5	10,100	9,955	279,620	2024/4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	14,500	13,792	387,384	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	10,158	285,312	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	11,250	10,592	297,507	2028/4/25	
	2.75 POLAND 291025	2.75	16,700	15,474	434,621	2029/10/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	12,500	12,382	347,784	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	10,000	10,146	284,982	2023/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	3,200	3,276	92,012	2022/9/23	
小	計				3,629,560		
ロシア			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
	国債証券 4.5 RUSSIA OFZ 250716	4.5	135,800	115,463	167,422	2025/7/16	
	5.7 RUSSIA OFZ 280517	5.7	167,000	136,146	197,412	2028/5/17	

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日		
			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	6 RUSSIA OFZ 271006	6.0	126,900	106,465	154,374	2027/10/6	
	6.1 RUSSIA OFZ 350718	6.1	132,000	99,133	143,743	2035/7/18	
	6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	120,000	112,837	163,614	2024/2/28	
	6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	118,200	101,415	147,052	2029/5/23	
	6.9 RUSSIA OFZ 310723	6.9	130,000	108,680	157,586	2031/7/23	
	7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	44,500	43,328	62,826	2023/1/25	
	7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	59,583	86,395	2023/8/16	
	7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	125,700	110,617	160,395	2028/1/19	
	7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	121,400	114,145	165,510	2024/10/16	
	7.15 RUSSIA OFZ 251112	7.15	142,500	131,292	190,373	2025/11/12	
	7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	123,300	103,147	149,564	2034/5/10	
	7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	86,700	85,038	123,306	2022/12/7	
	7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	118,000	112,247	162,758	2024/7/17	
	7.65 RUSSIA OFZ 300410	7.65	144,000	128,319	186,063	2030/4/10	
	7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	103,700	90,976	131,915	2033/3/23	
	7.7 RUSSIA OFZ 390316	7.7	100,800	86,081	124,817	2039/3/16	
	7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	125,600	116,818	169,386	2026/9/16	
	7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	101,100	94,580	137,141	2026/10/7	
	8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	104,241	151,149	2027/2/3	
	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	87,700	82,132	119,092	2031/9/17	
小計					3,251,904		
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	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,280	111,358	2024/4/29	
	3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	2,996	77,956	2026/6/24	
	3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	3,300	2,877	74,873	2031/9/24	
	3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	2,600	2,536	65,981	2024/11/25	
	4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	3,000	2,767	72,011	2030/10/24	
	4.25 ROMANIA GOVE 230628	4.25	4,200	4,194	109,128	2023/6/28	
	4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	9,200	9,169	238,554	2024/6/17	
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,899	179,501	2025/2/24	
	4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	1,700	1,596	41,527	2034/10/11	
	4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,884	127,074	2026/4/22	
	5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	3,960	3,948	102,722	2029/2/12	
	5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	6,800	7,063	183,762	2027/7/26	
	5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	4,500	4,584	119,272	2023/4/26	
小計					1,503,724		
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	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	9,800	9,001	244,511	2031/4/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	4,100	4,124	112,023	2027/5/31	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	7,350	7,447	202,283	2028/6/15	
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	6,400	5,985	162,581	2040/5/22	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	13,100	13,388	363,674	2023/8/17	
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	9,370	9,186	249,521	2034/7/5	
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	16,050	16,328	443,533	2029/8/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,500	11,799	320,506	2027/11/16	

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			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	13,720	14,085	382,597	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	20,500	21,160	574,792	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	8,900	9,158	248,773	2024/9/30
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	7,100	6,794	184,545	2050/6/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	10,450	10,776	292,720	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	6,050	6,166	167,503	2035/5/31
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	8,600	9,029	245,281	2028/10/31
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	6,100	6,589	178,983	2037/4/7
小	計					4,373,834	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	0.75 THAILAND 240617	0.75	100,800	100,752	347,596	2024/6/17
		0.95 THAILAND 250617	0.95	56,100	56,004	193,216	2025/6/17
		1 THAILAND 270617	1.0	38,900	37,866	130,639	2027/6/17
		1.45 THAILAND 241217	1.45	87,600	89,021	307,124	2024/12/17
		1.585 THAILAND 351217	1.585	48,600	43,262	149,256	2035/12/17
		1.6 THAILAND 291217	1.6	69,500	67,727	233,661	2029/12/17
		1.6 THAILAND 350617	1.6	30,500	27,588	95,179	2035/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	54,300	55,028	189,848	2022/12/17
		2 THAILAND 311217	2.0	36,000	35,670	123,062	2031/12/17
		2 THAILAND 420617	2.0	34,500	29,842	102,957	2042/6/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	84,300	87,098	300,490	2026/12/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	61,600	63,622	219,497	2023/12/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	67,400	71,943	248,205	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	57,200	55,534	191,594	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	80,100	85,921	296,427	2038/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	65,000	70,863	244,477	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	47,900	49,895	172,139	2023/6/16
		3.65 THAILAND 310620	3.65	70,100	79,459	274,133	2031/6/20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	73,700	84,599	291,869	2032/6/25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	81,700	90,019	310,568	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	67,300	80,999	279,449	2029/6/22
小	計					4,701,398	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	20,000	22,270	49,456	2036/1/14
小	計					49,456	
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	7,050,000	8,844,225	70,753	2030/8/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	5,250,000	6,308,820	50,470	2025/9/15
		5.125 INDONESIA 270415	5.125	7,700,000	7,671,741	61,373	2027/4/15
		5.5 INDONESIA 260415	5.5	9,200,000	9,287,400	74,299	2026/4/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	21,700,000	22,285,900	178,287	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	29,000,000	29,232,000	233,856	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 360615	6.25	2,000,000	1,977,000	15,816	2036/6/15
		6.5 INDONESIA 250615	6.5	52,400,000	54,967,600	439,740	2025/6/15
		6.5 INDONESIA 310215	6.5	35,900,000	35,846,150	286,769	2031/2/15

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	
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	千円	
	国債証券	6.625	29,400,000	29,400,000	235,200	2033/5/15
		7.0	23,450,000	24,892,175	199,137	2027/5/15
		7.0	29,700,000	30,516,750	244,134	2030/9/15
		7.125	10,800,000	10,987,434	87,899	2042/6/15
		7.5	10,900,000	11,510,400	92,083	2032/8/15
		7.5	15,300,000	16,057,350	128,458	2035/6/15
		7.5	28,200,000	29,454,900	235,639	2038/5/15
		7.5	1,500,000	1,566,750	12,534	2040/4/15
		8.125	24,600,000	26,611,050	212,888	2024/5/15
		8.25	24,500,000	27,164,375	217,315	2029/5/15
		8.25	19,000,000	21,127,074	169,016	2032/6/15
		8.25	29,200,000	32,368,200	258,945	2036/5/15
		8.375	37,100,000	40,123,650	320,989	2024/3/15
		8.375	29,930,000	33,581,460	268,651	2026/9/15
		8.375	32,700,000	36,673,050	293,384	2034/3/15
		8.375	23,200,000	26,158,000	209,264	2039/4/15
		8.75	15,400,000	17,663,800	141,310	2031/5/15
		9.0	15,500,000	17,801,750	142,414	2029/3/15
		9.5	20,200,000	24,156,064	193,248	2031/7/15
小	計				5,073,880	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99	24,000	23,737	427,109	2025/4/9
		2.36	5,000	5,015	90,249	2023/7/2
		2.68	18,000	17,867	321,493	2030/5/21
		2.69	10,000	10,126	182,203	2026/8/12
		2.84	2,000	2,028	36,501	2024/4/8
		2.85	16,000	16,271	292,765	2027/6/4
		2.88	16,000	16,212	291,711	2023/11/5
		2.94	16,000	16,276	292,865	2024/10/17
		3.01	12,000	12,275	220,874	2028/5/13
		3.02	3,000	3,068	55,209	2031/5/27
		3.03	5,000	5,126	92,236	2026/3/11
		3.12	5,000	5,151	92,687	2026/12/5
		3.13	19,000	19,528	351,375	2029/11/21
		3.19	17,000	17,362	312,394	2024/4/11
		3.22	22,000	22,671	407,924	2025/12/6
		3.25	15,200	15,733	283,085	2026/6/6
		3.25	10,000	10,364	186,495	2028/11/22
		3.27	8,000	8,340	150,077	2030/11/19
		3.28	15,000	15,608	280,850	2027/12/3
		3.29	4,000	4,079	73,408	2023/10/18
		3.29	17,000	17,674	318,018	2029/5/23
		3.53	1,000	1,048	18,868	2051/10/18
		3.72	5,000	5,378	96,767	2051/4/12

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		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	15,000	16,285	293,022	2050/9/14
小 計					5,168,196	
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	99,200	109,906	821,004	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	31,400	22,132	165,326	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	27,400	18,427	137,656	2041/2/28
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	39,500	33,363	249,226	2031/2/28
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	9,600	9,849	73,572	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	87,200	80,649	602,451	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	63,900	57,728	431,232	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	61,500	52,514	392,280	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	52,800	44,704	333,940	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	93,700	78,941	589,690	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	58,700	52,910	395,243	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	43,400	38,104	284,638	2040/1/31
小 計					4,476,263	
合 計					50,602,408	

(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

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 50,602,408	% 97.2
コール・ローン等、その他	1,474,347	2.8
投資信託財産総額	52,076,755	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(51,911,783千円)の投資信託財産総額(52,076,755千円)に対する比率は99.7%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=113.84円	1 アルゼンチンペソ=1.0879円	1 メキシコペソ=5.5221円	1 ブラジルリアル=20.9175円
100 チリペソ=14.2277円	100 コロンビアペソ=2.8688円	1 ペルーヌエボソル=29.5872円	1 ウルグアイペソ=2.5606円
1 ドミニカペソ=1.9674円	1 セルビアディナール=1.094185円	1 トルコリラ=8.4435円	1 チェココロナ=5.2567円
100 ハンガリーフォリント=35.8566円	1 ポーランドズロチ=28.0868円	1 ロシアルーブル=1.45円	1 ルーマニアレイ=26.0166円
1 マレーシアリンギット=27.163円	1 タイバーツ=3.45円	1 フィリピンペソ=2.2207円	100 インドネシアルピア=0.80円
1 中国元=17.9929円	1 南アフリカランド=7.47円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	52,150,164,009 円
コール・ローン等	669,785,144
公社債(評価額)	50,602,408,982
未収入金	128,475,746
未収利息	672,001,052
前払費用	77,493,085
(B) 負債	261,574,810
前受収益	34,792
未払金	73,552,868
未払解約金	187,987,077
未払利息	73
(C) 純資産総額(A-B)	51,888,589,199
元本	36,997,686,845
次期繰越損益金	14,890,902,354
(D) 受益権総口数	36,997,686,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,025円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,338,600,598円
 期中追加設定元本額 12,240,836,359円
 期中一部解約元本額 2,581,750,112円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,025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 Slim バランス(8資産均等型)	11,575,703,212円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	9,428,740,516円
つみたて8資産均等バランス	5,168,677,961円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,422,421,214円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,149,104,721円
ラップ向けインデックスI 新興国債券	1,575,296,015円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	987,110,945円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	399,608,667円
eMAXIS バランス(波乗り型)	384,385,580円
海外債券セレクション(ラップ向け)	370,303,293円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	305,375,057円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	96,512,145円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	76,820,515円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	32,146,831円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10,364,781円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	7,863,232円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,458,599円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,876,555円
コアバランス	1,292,481円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	1,055,823円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	568,702円
合計	36,997,686,845円

○損益の状況 (2021年1月27日~2022年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	2,344,343,562 円
受取利息	2,344,385,751
その他収益金	97,159
支払利息	△ 139,348
(B) 有価証券売買損益	△ 1,884,886,634
売買益	2,577,922,730
売買損	△ 4,462,809,364
(C) 保管費用等	△ 42,076,889
(D) 当期損益金(A+B+C)	417,380,039
(E) 前期繰越損益金	10,441,035,754
(F) 追加信託差損益金	5,113,599,274
(G) 解約差損益金	△ 1,081,112,713
(H) 計(D+E+F+G)	14,890,902,354
次期繰越損益金(H)	14,890,902,354

- (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】

対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年9月30日)

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5期(2020年9月8日～2021年9月6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4期	第5期
	自 2019年9月6日 至 2020年9月7日	自 2020年9月8日 至 2021年9月6日
	金額(円)	金額(円)
I 営業収益		
有価証券売買等損益	2,439,539,318	2,356,772,720
営業収益合計	2,439,539,318	2,356,772,720
II 営業費用		
受託者報酬	12,999,991	13,813,432
委託者報酬	91,951,140	97,128,956
その他費用	1,006,756	992,086
営業費用合計	105,957,887	111,934,474
営業利益金額または損失金額(△)	2,333,581,431	2,244,838,246
経常利益金額または損失金額(△)	2,333,581,431	2,244,838,246
当期純利益金額または純損失金額(△)	2,333,581,431	2,244,838,246
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	36,476,286	64,691,123
IV 期首剰余金または欠損金(△)	2,823,681,797	4,996,291,234
V 剰余金増加額 (当期追加信託に伴う剰余金増加額)	291,453,594 (291,453,594)	625,979,393 (625,979,393)
VI 剰余金減少額 (当期一部解約に伴う剰余金減少額)	415,949,302 (415,949,302)	389,415,014 (389,415,014)
VII 期末剰余金または欠損金(△)	4,996,291,234	7,413,002,736

■ 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	25,858,711,510	33,696,486,968	
	合計	25,858,711,510	33,696,486,968	

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)

(2021年9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	米ドル	MDC-GMTN B.V.	500,000.00	586,734.50	
		SAUDI ARABIAN OIL CO	1,050,000.00	1,145,102.70	
		SAUDI ARABIAN OIL CO	650,000.00	646,744.15	
	計	銘柄数: 3	2,200,000.00	2,378,581.35	
				(261,239,589)	
			組入時価比率: 0.8%	0.8%	
	ユーロ	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	750,000.00	807,060.00	
		PETROLEOS MEXICANOS	1,200,000.00	1,211,424.00	
		計	銘柄数: 2	1,950,000.00	2,018,484.00
				(263,270,868)	
		組入時価比率: 0.8%	0.8%		
小計			524,510,457		
			(524,510,457)		
社債券	米ドル	7-ELEVEN INC	975,000.00	943,222.98	
		ABBVIE INC	925,000.00	1,113,551.02	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	287,000.00	292,549.24	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	600,000.00	633,228.09	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	650,000.00	658,960.75	
		AIR LEASE CORP	150,000.00	157,570.49	
		AIR LEASE CORP	450,000.00	451,515.83	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS	750,000.00	769,785.57	
		ALIBABA GROUP HOLDING	1,375,000.00	1,424,080.30	
		ALIBABA GROUP HOLDING	900,000.00	882,222.61	
		ALLSTATE CORP	750,000.00	723,864.49	
		ALTRIA GROUP INC	775,000.00	757,066.10	
		AMAZON.COM INC	400,000.00	382,319.20	
		AMAZON.COM INC	625,000.00	605,801.16	
		AMEREN ILLINOIS CO	875,000.00	847,915.84	
		AMERICAN AIRLINES/AADVAN	440,000.00	474,100.00	
		AMERICAN AXLE & MFG INC	625,000.00	658,593.75	
		AMERICAN INTL GROUP	700,000.00	809,366.21	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	425,000.00	506,713.48	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	250,000.00	299,676.94	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	1,550,000.00	1,906,884.10	
		ANTHEM INC	875,000.00	889,445.46	
		AON CORP	925,000.00	977,806.94	
		APPLE INC	275,000.00	270,277.45	
		APPLE INC	700,000.00	688,042.34	
		APPLE INC	700,000.00	693,770.65	
		AT&T INC	2,325,000.00	2,382,310.88	
		AUST & NZ BANKING GROUP	450,000.00	443,482.20	
		AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	675,000.00	695,921.03	
		BAIDU INC	675,000.00	684,137.92	
		BANCO DE CREDITO DEL PER	620,000.00	640,630.50	
		BANCO SANTANDER CHILE	875,000.00	915,258.75	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	BANCO SANTANDER SA	200,000.00	228,812.44	
		BANK OF AMERICA CORP	525,000.00	586,446.81	
		BANK OF AMERICA CORP	775,000.00	784,710.41	
		BANK OF AMERICA CORP	4,650,000.00	4,825,390.91	
		BANK OF AMERICA CORP	675,000.00	726,355.30	
		BARCLAYS PLC	700,000.00	741,297.04	
		BAT CAPITAL CORP	2,300,000.00	2,487,519.69	
		BAT CAPITAL CORP	200,000.00	199,545.69	
		BAT CAPITAL CORP	75,000.00	74,423.27	
		BELROSE FUNDING TRUST	350,000.00	349,170.82	
		BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	1,000,000.00	978,898.09	
		BERRY GLOBAL INC	600,000.00	605,706.00	
		BERRY GLOBAL INC	610,000.00	644,038.00	
		BMW US CAPITAL LLC	400,000.00	420,571.07	
		BNP PARIBAS	1,925,000.00	2,223,447.61	
		BOEING CO	550,000.00	565,875.68	
		BOEING CO	575,000.00	588,846.63	
		BOEING CO	200,000.00	208,943.39	
		BOSTON PROPERTIES LP	350,000.00	354,246.27	
		BOSTON SCIENTIFIC CORP	800,000.00	834,780.23	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	625,000.00	689,062.50	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	625,000.00	667,593.75	
		BPCE SA	2,225,000.00	2,468,444.01	
		BRASKEM NETHERLANDS	620,000.00	671,925.00	
		BROADCOM INC	350,000.00	393,760.73	
		BROADCOM INC	225,000.00	222,523.20	
		BROOKFIELD FIN I UK PLC	500,000.00	500,152.92	
		BROOKFIELD FINANCE LLC	75,000.00	78,654.11	
		BROWN & BROWN INC	1,350,000.00	1,364,981.70	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	200,000.00	256,208.45	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	275,000.00	289,669.82	
		BURLINGTN NORTH SANTA FE	450,000.00	493,332.46	
		CANADIAN IMPERIAL BANK	1,250,000.00	1,250,575.48	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO	1,475,000.00	1,588,629.22	
		CARREFOUR SA	400,000.00	404,743.06	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	400,000.00	389,633.44	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	375,000.00	379,240.17	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	275,000.00	353,672.65	
		CHARTER COMM OPT LLC/CAP	850,000.00	1,024,922.78	
		CHEMOURS CO	790,000.00	782,850.50	
		CHINA CINDA 2020 I MNGMN	900,000.00	889,611.38	
		CIGNA CORP	775,000.00	793,944.33	
		CITIGROUP INC	3,100,000.00	3,185,428.41	
		CLEVELAND ELECTRIC ILLUM	675,000.00	797,006.37	
		CNO FINANCIAL GROUP INC	490,000.00	582,573.00	
		CNOOC FINANCE 2012 LTD	1,400,000.00	1,427,972.00	
		COMCAST CORP	400,000.00	392,800.96	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	COMCAST CORP	1,400,000.00	1,386,085.27	
		COMMERZBANK AG	650,000.00	734,327.10	
		COUNTRY GARDEN HLDGS	660,000.00	659,458.80	
		CVS HEALTH CORP	2,024,000.00	1,981,801.50	
		CVS HEALTH CORP	25,000.00	32,862.24	
		DAIMLER FINANCE NA LLC	750,000.00	809,195.96	
		DEERE & COMPANY	150,000.00	183,260.38	
		DELL INTERNATIONAL LLC	1,175,000.00	1,404,426.24	
		DELTA AIR LINES INC	725,000.00	732,320.15	
		DEUTSCHE BANK NY	875,000.00	935,521.73	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	1,450,000.00	1,556,674.73	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	500,000.00	521,355.52	
		DIRECTV HOLDINGS/FING	85,000.00	89,250.00	
		DOLLAR GENERAL CORP	550,000.00	659,198.96	
		DP WORLD LTD	850,000.00	1,073,285.65	
		DT MIDSTREAM INC	305,000.00	313,768.75	
		DTE ELECTRIC CO	700,000.00	725,363.55	
		DUPONT DE NEMOURS INC	375,000.00	493,856.81	
		EDP FINANCE BV	1,425,000.00	1,527,040.51	
		EMBRAER NETHERLANDS FINA	1,050,000.00	1,130,377.50	
		ENBRIDGE INC	400,000.00	429,196.73	
		ENBRIDGE INC	1,175,000.00	1,187,470.76	
		ENEL FINANCE INTL NV	675,000.00	744,212.81	
		ENEL FINANCE INTL NV	650,000.00	786,310.77	
		ENEL SPA	1,675,000.00	1,926,668.75	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	400,000.00	467,286.47	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	325,000.00	361,535.96	
		EQUINIX INC	925,000.00	914,258.70	
		EQUITABLE FINANCIAL LIFE	1,000,000.00	997,256.42	
		EQUITABLE FINANCIAL LIFE	700,000.00	679,652.65	
		EXPEDIA GROUP INC	445,000.00	462,355.00	
		FIVE CORNERS FND TR II	550,000.00	584,193.90	
		FORD MOTOR CREDIT CO LLC	575,000.00	618,843.75	
		FOX CORP	525,000.00	681,391.44	
		GALAXY PIPELINE ASSETS	1,375,000.00	1,399,058.43	
		GE CAPITAL INTL FUNDING	1,175,000.00	1,426,591.99	
		GENERAL MOTORS CO	725,000.00	993,387.54	
		GENERAL MOTORS FINL CO	350,000.00	395,608.80	
		GENERAL MOTORS FINL CO	150,000.00	164,658.89	
		GEORGIA-PACIFIC LLC	1,250,000.00	1,295,923.18	
		GILEAD SCIENCES INC	400,000.00	388,282.49	
		GLENCORE FUNDING LLC	250,000.00	276,675.65	
		GLENCORE FUNDING LLC	600,000.00	662,464.80	
		GLENCORE FUNDING LLC	325,000.00	322,839.75	
		GLENCORE FUNDING LLC	600,000.00	591,032.13	
		GLOBAL ATLANTIC	680,000.00	701,761.67	
		GLOBAL PAYMENTS INC	725,000.00	762,377.19	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	GLP CAPITAL LP / FIN II	700,000.00	758,707.60	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,425,000.00	1,437,200.10	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	400,000.00	519,187.97	
		GRUPO AVAL LTD	250,000.00	248,437.50	
		HARBORWALK FUNDING	225,000.00	283,840.19	
		HCA INC	175,000.00	227,278.24	
		HCA INC	475,000.00	481,496.62	
		HOME DEPOT INC	575,000.00	537,936.74	
		HSBC HOLDINGS PLC	200,000.00	224,452.79	
		IBM CORP	325,000.00	328,923.34	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	760,000.00	764,750.00	
		INDIANA MICHIGAN POWER	475,000.00	591,823.26	
		INDOFOOD CBP SUKSES MARM	300,000.00	314,737.33	
		ING GROEP NV	1,200,000.00	1,369,657.89	
		INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,425,000.00	1,375,467.00	
		INTERSTATE POWER & LIGHT	375,000.00	417,093.69	
		INTESA SANPAOLO SPA	1,650,000.00	1,813,861.73	
		INVERSIONES CMPC SA	375,000.00	404,531.25	
		JETBLUE 2019-1 CLASS AA	1,009,463.39	1,028,692.65	
		JOHNSON CONTROLS/TYCO FI	600,000.00	589,106.55	
		JP MORGAN CHASE BANK NA	400,000.00	481,527.89	
		JPMORGAN CHASE & CO	4,550,000.00	4,463,316.03	
		KEURIG DR PEPPER INC	500,000.00	534,076.25	
		KEURIG DR PEPPER INC	250,000.00	284,555.02	
		KILROY REALTY LP	300,000.00	319,670.88	
		KILROY REALTY LP	375,000.00	377,679.73	
		LAS VEGAS SANDS CORP	1,400,000.00	1,460,617.91	
		LEASEPLAN CORPORATION NV	1,400,000.00	1,472,244.32	
		LEVEL 3 FINANCING INC	475,000.00	501,039.50	
		LEVEL 3 FINANCING INC	500,000.00	538,232.50	
		LLOYDS BANK PLC	600,000.00	659,159.86	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	700,000.00	804,414.19	
		LYB INT FINANCE III	275,000.00	322,065.50	
		MARRIOTT INTERNATIONAL	1,325,000.00	1,351,524.43	
		MASCO CORP	525,000.00	518,783.00	
		MET LIFE GLOB FUNDING I	575,000.00	621,880.35	
		MICROSOFT CORP	650,000.00	647,194.82	
		MLDWEST CONNECTOR CAPIT	525,000.00	532,538.73	
		NATIONWIDE BUILDING SOCI	1,425,000.00	1,617,350.00	
		NBN CO LTD	1,350,000.00	1,394,684.82	
		NEWCASTLE COAL INFRASTRU	1,475,000.00	1,539,713.50	
		NIKE INC	625,000.00	717,549.41	
		NISSAN MOTOR CO	975,000.00	1,014,615.99	
		NOVA CHEMICALS CORP	575,000.00	608,781.25	
		NRG ENERGY INC	320,000.00	324,800.00	
		NTT FINANCE CORP	1,700,000.00	1,700,063.10	
		NUTRITION & BIOSCIENCES	250,000.00	251,989.76	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	NUTRITION & BIOSCIENCES	750,000.00	759,311.13	
		NVIDIA CORP	275,000.00	314,851.70	
		NXP BV/NXP FDG/NXP USA	675,000.00	739,287.88	
		OCCIDENTAL PETROLEUM COR	525,000.00	547,790.25	
		ONEOK INC	575,000.00	604,130.44	
		OREDOO INTL FINANCE	780,000.00	805,599.60	
		ORACLE CORP	1,075,000.00	1,188,015.61	
		OVERSEA-CHINESE BANKING	620,000.00	623,044.20	
		PACIFIC GAS & ELECTRIC	425,000.00	397,228.79	
		PAYPAL HOLDINGS INC	826,000.00	890,889.02	
		PAYPAL HOLDINGS INC	536,000.00	558,161.37	
		PIEDMONT NATURAL GAS CO	500,000.00	511,997.25	
		PIONEER NATURAL RESOURCE	900,000.00	869,209.21	
		POSCO	475,000.00	503,857.41	
		POWER FINANCE CORP LTD	925,000.00	923,818.45	
		PROSUS NV	400,000.00	414,605.43	
		PSA TREASURY PTE LTD	500,000.00	519,331.75	
		PURE STORAGE INC	468,000.00	549,666.00	
		QNB FINANCE LTD	350,000.00	368,913.65	
		RAYTHEON TECH CORP	500,000.00	510,810.87	
		RESORTS WORLD/RWLV CAP	1,100,000.00	1,142,206.35	
		ROCKIES EXPRESS PIPELINE	375,000.00	385,413.75	
		ROCKIES EXPRESS PIPELINE	375,000.00	393,836.25	
		ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	575,000.00	611,738.40	
		ROYALTY PHARMA PLC	425,000.00	414,387.03	
		ROYALTY PHARMA PLC	300,000.00	300,449.10	
		SABINE PASS LIQUEFACTION	600,000.00	694,429.33	
		SANTOS FINANCE LTD	1,350,000.00	1,457,940.62	
		SGSP AUSTRALIA ASSETS	900,000.00	977,421.36	
		SHERWIN-WILLIAMS CO	725,000.00	742,701.78	
		SHOPIFY INC	494,000.00	658,008.00	
		SIGMA ALIMENTOS SA	650,000.00	713,245.00	
		SIRIUS XM RADIO INC	450,000.00	461,250.00	
		SOCIETE GENERALE	1,250,000.00	1,306,446.66	
		SOCIETE GENERALE	400,000.00	408,029.11	
		SPECTRA ENERGY PARTNERS	275,000.00	325,940.07	
		SPOTIFY USA INC	365,000.00	336,895.00	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	914,062.50	978,727.85	
		SPRINT SPECTRUM / SPEC I	450,000.00	520,116.75	
		SUNOCO LOGISTICS PARTNER	400,000.00	440,250.93	
		SUNOCO LOGISTICS PARTNER	450,000.00	499,816.77	
		SYNGENTA FINANCE NV	700,000.00	770,161.49	
		T-MOBILE USA INC	250,000.00	248,782.50	
		T-MOBILE USA INC	800,000.00	826,912.00	
		TENCENT HOLDINGS LTD	1,175,000.00	1,274,143.75	
		TRANSCONT GAS PIPE LINE	225,000.00	256,443.73	
		TRANSMANTARO	400,000.00	448,500.00	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	TRANSPRDRA DE GAS INTL	575,000.00	656,779.37	
		TRANSURBAN FINANCE CO	575,000.00	585,338.57	
		TSMC GLOBAL LTD	850,000.00	836,879.14	
		UBS AG	925,000.00	1,017,167.00	
		UNICREDIT SPA	1,600,000.00	1,633,143.68	
		UPJOHN INC	225,000.00	243,661.19	
		VERIZON COMMUNICATIONS	700,000.00	676,964.95	
		VERIZON COMMUNICATIONS	350,000.00	373,979.30	
		VERIZON COMMUNICATIONS	1,465,000.00	1,406,201.99	
		VIRGINIA ELEC & POWER CO	575,000.00	536,411.34	
		VISA INC	225,000.00	233,635.67	
		VONTIER CORP	1,075,000.00	1,085,056.62	
		WALMART INC	584,000.00	628,824.63	
		WALT DISNEY COMPANY	250,000.00	280,663.08	
		WALT DISNEY COMPANY	1,156,000.00	1,143,428.83	
		WELLS FARGO & COMPANY	1,850,000.00	1,963,893.47	
		WELLS FARGO & COMPANY	300,000.00	313,813.34	
		WESTERN DIGITAL CORP	578,000.00	591,005.00	
		WESTPAC BANKING CORP	350,000.00	347,028.83	
		WILLIAMS COMPANIES INC	325,000.00	398,554.64	
		XCEL ENERGY INC	600,000.00	628,726.23	
		ZURICH FINANCE IRELAND	1,050,000.00	1,062,416.25	
	計	銘柄数: 242	178,031,525.89	188,145,285.88	
				(20,663,996,747)	
		組入時価比率: 61.3%		64.1%	
	ユーロ	2I RETE GAS SPA	575,000.00	619,737.87	
		ABBOTT IRELAND FINANCING	1,150,000.00	1,182,707.50	
		ABERTIS INFRASTRUCTURAS	400,000.00	444,260.84	
		AEROPORTS DE PARIS	400,000.00	437,779.60	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	100,000.00	102,828.60	
		AKELIUS RESIDENTIAL PROP	400,000.00	412,602.00	
		ALLIANZ SE	1,400,000.00	1,527,395.80	
		ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	550,000.00	559,971.50	
		ASR NEDERLAND NV	2,000,000.00	2,276,180.00	
		ASSICURAZIONI GENERALI	1,325,000.00	1,646,727.66	
		AURIZON NETWORK PTY LTD	500,000.00	568,957.50	
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	1,200,000.00	1,238,682.00	
		AXA SA	1,000,000.00	1,092,823.00	
		AXA SA	600,000.00	697,053.00	
		AXA SA	525,000.00	584,456.25	
		BANCO SANTANDER SA (REGS)	1,800,000.00	2,052,455.40	
		BAYER AG	700,000.00	726,455.80	
		BEL SARL	600,000.00	618,783.00	
		BHP BILLITON FINANCE LTD	1,000,000.00	1,160,998.00	
		BLACKSTONE PP EUR HOLD	800,000.00	823,693.60	
		BNP PARIBAS	1,225,000.00	1,322,097.17	
		BOOKING HOLDINGS INC	350,000.00	352,142.44	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	CAIXABANK SA	1,800,000.00	1,895,527.80	
		CELLNEX TELECOM SA	800,000.00	822,003.20	
		CHUBB INA HOLDINGS INC	150,000.00	162,919.65	
		COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA	900,000.00	944,563.50	
		CREDIT AGRICOLE	525,000.00	585,788.70	
		CREDIT AGRICOLE ASSURANCES	1,500,000.00	1,726,069.20	
		CREDIT AGRICOLE SA	600,000.00	665,733.60	
		DH EUROPE FINANCE	250,000.00	269,813.75	
		EATON CAPITAL UNLIMITED	300,000.00	301,665.30	
		ELI LILLY & CO	600,000.00	688,444.20	
		EMIRATES TELECOM GROUP	200,000.00	202,424.80	
		ENERGIAS DE PORTUGAL SA	400,000.00	406,676.40	
		EQUINIX INC	200,000.00	201,113.00	
		EUROCLEAR INVESTMENTS SA	600,000.00	662,487.00	
		FIDELITY NATL INFO SERV	600,000.00	750,168.00	
		FOMENTO ECONOMICO MEX	800,000.00	805,504.00	
		GLENCORE FINANCE EUROPE	200,000.00	210,305.40	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	500,000.00	555,555.00	
		GRIFOLS SA	250,000.00	255,312.50	
		HEATHROW FUNDING LTD	500,000.00	524,082.50	
		IBERDROLA INTL BV	800,000.00	813,504.80	
		IBM CORP	1,050,000.00	1,120,182.00	
		IE2 HOLDCO	500,000.00	557,871.20	
		IMPERIAL BRANDS FIN PLC	1,750,000.00	1,882,454.00	
		INTERNATIONAL GAME TECH	450,000.00	462,738.15	
		INTESA SANPAOLO SPA	500,000.00	553,049.00	
		INTRUM AB	100,000.00	100,749.00	
		JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	705,372.50	
		JPMORGAN CHASE & CO	700,000.00	688,129.40	
		LLOYDS BANKING GROUP	550,000.00	609,696.45	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,000,000.00	2,069,762.00	
		LOGICOR FINANCING SARL	900,000.00	914,586.30	
		LOGICOR FINANCING SARL	400,000.00	422,004.80	
		MARSH & MCLENNAN COS INC	650,000.00	691,918.80	
		MOTABILITY OPERATIONS GR	250,000.00	250,580.25	
		NISSAN MOTOR CO	200,000.00	207,908.40	
		NOBEL BIDCO BV	380,000.00	379,439.50	
		NORTEGAS ENERGIA DISTRI	114,000.00	123,998.14	
		NORTEGAS ENERGIA DISTRI	400,000.00	400,459.20	
		NOVARTIS FINANCE SA	800,000.00	798,268.80	
		OPTUS FINANCE PTY LTD	500,000.00	522,879.00	
		PHILIP MORRIS INTL INC	500,000.00	500,464.98	
		PROLOGIS EURO FINANCE	800,000.00	893,408.80	
		PROSEGUR CIA DE SEGURIDA	600,000.00	608,417.40	
		Q-PARK HOLDING BV	450,000.00	433,056.60	
		RYANAIR DAC	1,125,000.00	1,146,314.25	
		RYANAIR DAC	300,000.00	329,328.27	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ユーロ	SCENTRE MGMT LTD	550,000.00	594,515.90	
		STANDARD INDUSTRIES INC	475,000.00	467,976.43	
		STATE GRID OVERSEAS INV	750,000.00	769,995.00	
		STRYKER CORP	300,000.00	335,331.00	
		TECHEM VERWALTUNGSGESELL	275,000.00	275,537.07	
		TELEFONICA EUROPE BV	600,000.00	654,525.60	
		TESCO CORP TREASURY SERV	350,000.00	347,509.28	
		THERMO FISHER SCIENTIFIC	1,200,000.00	1,303,137.60	
		TOTALENERGIES SE	900,000.00	923,760.90	
		TRANSURBAN FINANCE CO	1,075,000.00	1,157,189.12	
		UBS GROUP AG	500,000.00	512,192.50	
		VERIZON COMMUNICATIONS	650,000.00	677,011.40	
		VIENNA INSURANCE GRP AGW	1,000,000.00	1,117,868.00	
		VOLKSWAGEN INTL FIN NV	600,000.00	654,353.40	
		VOLKSWAGEN INTL FIN NV	1,500,000.00	1,707,367.50	
		VONOVIA SE	1,000,000.00	991,743.00	
		VONOVIA SE	800,000.00	810,162.56	
		WINTERSHALL DEA FIN 2BV	700,000.00	691,261.20	
		WINTERSHALL DEA FINANCE	1,300,000.00	1,358,656.00	
		計	銘柄数 :	88	62,269,000.00
				(8,686,844,272)	
		組入時価比率 :	25.8%	26.9%	
英ポンド		ANNINGTON FUNDING PLC	275,000.00	357,554.17	
		APT PIPELINES LTD	675,000.00	759,186.67	
		AT&T INC	1,150,000.00	1,245,461.50	
		BANQUE FED CRED MUTUEL	700,000.00	709,447.90	
		BNP PARIBAS	800,000.00	765,264.80	
		BP CAPITAL MARKETS PLC	1,150,000.00	1,222,507.50	
		DXC TECHNOLOGY CO	600,000.00	625,851.00	
		HSEC HOLDINGS PLC	2,300,000.00	2,384,683.88	
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,125,000.00	1,171,477.12	
		MCKESSON CORP	475,000.00	525,535.72	
		NATIONAL GRID GAS PLC	550,000.00	511,291.25	
		NGG FINANCE PLC	425,000.00	475,588.17	
		ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,000,000.00	1,063,144.06	
		SANTANDER UK GROUP HLDGS	1,100,000.00	1,165,935.10	
		SEGRO PLC	705,000.00	766,755.36	
		WELLS FARGO & COMPANY	700,000.00	721,093.10	
		WELLS FARGO BANK NA	200,000.00	216,390.00	
		WESTERN POWER DIST WEST	600,000.00	834,091.80	
計	銘柄数 :	18	14,530,000.00	15,521,259.10	
				(2,361,249,146)	
		組入時価比率 :	7.0%	7.3%	
小計				31,712,090,165	
				(31,712,090,165)	
合計				32,236,600,622	
				(32,236,600,622)	

(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) 種類毎の小計欄および合計金額欄の()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。

デリバティブ取引等関係

①ヘッジ会計が適用されていないもの

(1) 通貨関連

区分	種類	(2021年9月6日現在)			
		契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,590,541,335	—	1,579,431,240	11,110,095
	ユーロ	881,580,089	—	879,313,880	2,266,209
	英ポンド	709,623,453	—	719,502,531	△9,879,078
	買建				
	米ドル	1,845,683,412	—	1,843,135,027	△2,548,385
	カナダドル	985,933,942	—	976,198,635	△9,735,307
	スイスフラン	152,340,480	—	153,797,120	1,456,640
オーストラリアドル	131,041,625	—	132,665,000	1,623,375	
	合計	6,296,744,336	—	6,284,043,433	△5,706,451

(注) 1. 時価の算定方法

1) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日（以下、「当該日」とする。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該仲値で評価しております。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(2) 債券関連

区分	種類	(2021年9月6日現在)			
		契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	6,773,225,827	—	6,760,771,269	12,454,558
	買建	6,456,819,699	—	6,461,708,479	4,888,780
	合計	13,230,045,526	—	13,222,479,748	17,343,338

(注) 1. 時価の算定方法

1) 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表清算値または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2) 債券先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3) 契約額等および時価の邦貨換算は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

②ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。