

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2006年5月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、日本を除く世界主要国の公社債へ投資することにより、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ます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質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	ベビード ファンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザー ファンド	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	ベビード ファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザー ファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC海外債券インデックス ファンド

第14期（決算日：2020年5月12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「三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド」は、去る5月12日に第14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。

○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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配	みり騰落率	(除く日本、円換算ベース)	期騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
10期(2016年5月12日)	14,414	0	△6.4	109,931.94	△6.2	98.9	—	12,665
11期(2017年5月12日)	14,540	0	0.9	111,054.04	1.0	98.8	—	13,942
12期(2018年5月14日)	14,712	0	1.2	112,563.85	1.4	98.9	—	16,236
13期(2019年5月13日)	14,847	0	0.9	113,996.81	1.3	98.7	—	18,394
14期(2020年5月12日)	15,473	0	4.2	119,287.72	4.6	98.6	—	21,753

(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合わせますので、「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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス (除 く 日 本 、 円 換 算 ベ ー ス)	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2019年 5月13日	14,847	% —	113,996.81	—	98.7	—
5月 末	14,877	0.2	114,188.44	0.2	98.6	—
6月 末	15,069	1.5	115,685.41	1.5	98.5	—
7月 末	15,111	1.8	115,950.32	1.7	97.5	—
8月 末	15,207	2.4	116,876.64	2.5	97.9	—
9月 末	15,277	2.9	117,408.61	3.0	98.3	—
10月 末	15,424	3.9	118,313.83	3.8	98.4	—
11月 末	15,429	3.9	118,546.99	4.0	98.7	—
12月 末	15,498	4.4	118,980.17	4.4	98.5	—
2020年 1月 末	15,618	5.2	120,069.31	5.3	98.4	—
2月 末	15,800	6.4	121,401.29	6.5	98.4	—
3月 末	15,820	6.6	121,796.59	6.8	98.5	—
4月 末	15,515	4.5	119,329.72	4.7	97.9	—
(期 末) 2020年 5月12日	15,473	4.2	119,287.72	4.6	98.6	—

(注) 騰落率は期首比。

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

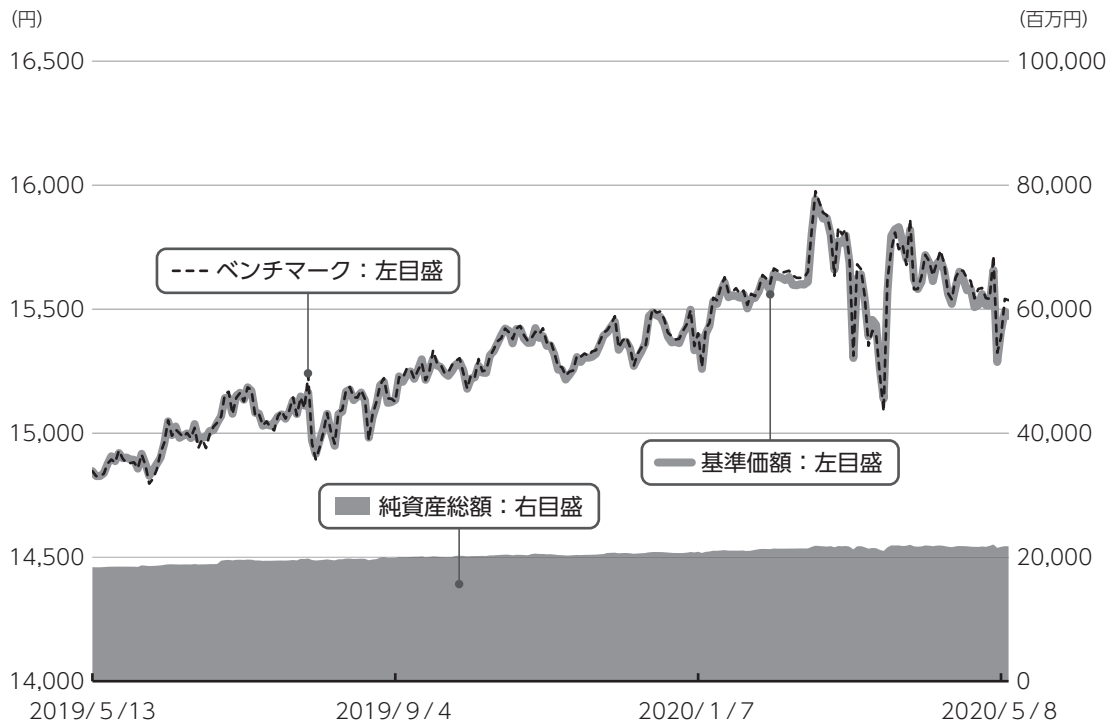
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第14期：2019年5月14日～2020年5月12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14期首	14,847円
第14期末	15,473円
既払分配金	0円
騰落率	4.2%

※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4.2%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（4.6%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

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

第14期：2019年5月14日～2020年5月12日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことや世界的な金融緩和スタンス等を背景に、期首との比較では上昇しました。

▶ 為替市況

期首に比べて米ドル、ユーロは対円で下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド

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

▶ 外国債券インデックスマザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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

▶ **三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド** ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.4\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.3\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

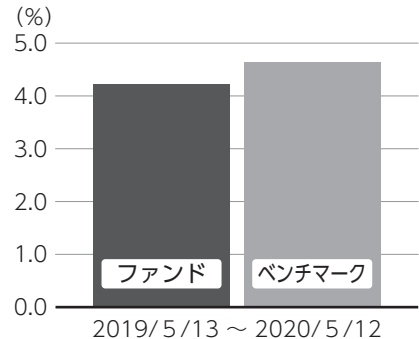
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因[※]によるものです。

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

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第14期 2019年5月14日～2020年5月12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	7,531

(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。）

▶ **三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **外国債券インデックスマザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2019年5月14日～2020年5月12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	37	0.240	(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）	(15)	(0.098)	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）	(15)	(0.098)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(7)	(0.044)	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	0.012	(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）	(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	39	0.252	

期中の平均基準価額は、15,320円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

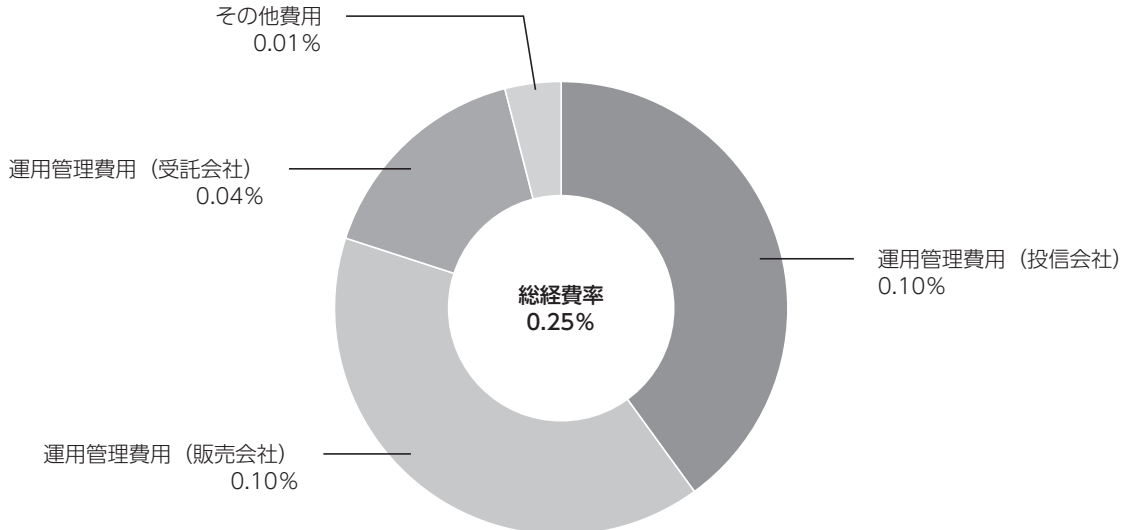
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.25%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 1,619,533	千円 3,417,050	千口 429,479	千円 910,325

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020年5月12日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド>
該当事項はございません。

<外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	$\frac{B}{A}$		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 13,961	% 37.8	百万円 30,920	百万円 8,422	% 27.2	

平均保有割合 14.1%

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

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

○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数		口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 9,010,333		千口 10,200,387	千円 21,751,307

○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 21,751,307	% 99.7
コール・ローン等、その他	71,836	0.3
投資信託財産総額	21,823,143	100.0

(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（149,217,319千円）の投資信託財産総額（149,885,773千円）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=107.52円	1 カナダドル=76.47円	1 メキシコペソ=4.47円	1 ユーロ=116.02円
1 イギリスポンド=132.25円	1 スウェーデンクローネ=10.86円	1 ノルウェークローネ=10.39円	1 デンマーククローネ=15.56円
1 ポーランドズロチ=25.42円	1 オーストラリアドル=69.21円	1 シンガポールドル=75.73円	1 マレーシアリングgit=24.71円
1 イスラエルシェケル=30.64円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,823,143,037
コール・ローン等	70,373,874
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	21,751,307,337
未収入金	1,461,826
(B) 負債	69,414,018
未払解約金	43,974,938
未払信託報酬	25,439,039
未払利息	41
(C) 純資産総額(A-B)	21,753,729,019
元本	14,059,349,674
次期繰越損益金	7,694,379,345
(D) 受益権総口数	14,059,349,674口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,473円

<注記事項>

- ①期首元本額 12,389,159,997円
 期中追加設定元本額 3,814,396,298円
 期中一部解約元本額 2,144,206,621円
 また、1口当たり純資産額は、期末15,473円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年5月14日～ 2020年5月12日
費用控除後の配当等収益額	433,304,888円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円
収益調整金額	7,997,894,931円
分配準備積立金額	2,157,762,476円
当ファンドの分配対象収益額	10,588,962,295円
1万口当たり収益分配対象額	7,531円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

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

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 17,255
受取利息	371
支払利息	△ 17,626
(B) 有価証券売買損益	745,965,359
売買益	864,504,100
売買損	△ 118,538,741
(C) 信託報酬等	△ 48,968,125
(D) 当期損益金(A+B+C)	696,979,979
(E) 前期繰越損益金	1,029,738,056
(F) 追加信託差損益金	5,967,661,310
(配当等相当額)	(7,991,387,562)
(売買損益相当額)	(△2,023,726,252)
(G) 計(D+E+F)	7,694,379,345
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	7,694,379,345
追加信託差損益金	5,967,661,310
(配当等相当額)	(7,997,894,931)
(売買損益相当額)	(△2,030,233,621)
分配準備積立金	2,591,067,364
繰越損益金	△ 864,349,329

- (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19期》決算日2020年5月12日

[計算期間：2019年5月14日～2020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19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19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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(除く日本、円換算ベース)	期 騰 落			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2016年5月12日)	19,674	△6.1	109,931.94	△6.2	98.9	—	156,155
16期(2017年5月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	—	132,430
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

(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 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年5月13日	円	%		%	%	%
	20,412	—	113,996.81	—	98.7	—
5月末	20,456	0.2	114,188.44	0.2	98.6	—
6月末	20,724	1.5	115,685.41	1.5	98.5	—
7月末	20,786	1.8	115,950.32	1.7	97.5	—
8月末	20,922	2.5	116,876.64	2.5	97.9	—
9月末	21,023	3.0	117,408.61	3.0	98.3	—
10月末	21,229	4.0	118,313.83	3.8	98.4	—
11月末	21,240	4.1	118,546.99	4.0	98.7	—
12月末	21,339	4.5	118,980.17	4.4	98.5	—
2020年1月末	21,509	5.4	120,069.31	5.3	98.4	—
2月末	21,764	6.6	121,401.29	6.5	98.5	—
3月末	21,796	6.8	121,796.59	6.8	98.5	—
4月末	21,381	4.7	119,329.72	4.7	98.0	—
(期 末) 2020年5月12日	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

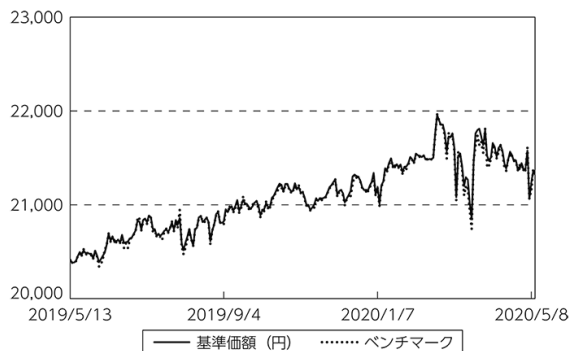
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(4.6%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

- ・ 先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことや世界的な金融緩和スタンス等を背景に、期首との比較では上昇しました。

◎ 為替市況

- ・ 期首に比べて米ドル、ユーロは対円で下落しました。

● 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4.6%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

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

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月14日～2020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、21,088円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020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 36,920	百万円 13,961	% 37.8	百万円 30,920	百万円 8,422	% 27.2

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

○組入資産の明細

(2020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 573,360	千アメリカドル 643,922	千円 69,234,594	% 46.4	% —	% 21.0	% 17.3	% 8.0
カナダ	千カナダドル 31,990	千カナダドル 37,068	2,834,629	1.9	—	0.9	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 225,130	千メキシコペソ 249,067	1,113,331	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	74,720	91,388	10,602,937	7.1	—	4.2	2.3	0.6
イタリア	100,910	111,552	12,942,300	8.7	—	5.1	2.4	1.2
フランス	102,840	125,138	14,518,558	9.7	—	6.7	2.4	0.6
オランダ	19,710	24,530	2,846,004	1.9	—	1.3	0.4	0.2
スペイン	60,760	72,274	8,385,249	5.6	—	3.8	1.2	0.6
ベルギー	24,460	30,403	3,527,379	2.4	—	1.8	0.4	0.1
オーストリア	15,180	18,816	2,183,038	1.5	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	6,200	6,921	803,060	0.5	—	0.4	0.1	0.0
アイルランド	8,270	9,319	1,081,302	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イギリス	千イギリスポンド 52,160	千イギリスポンド 74,698	9,878,880	6.6	—	5.4	1.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 32,570	千スウェーデンクローネ 36,997	401,792	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 30,660	千ノルウェークローネ 33,342	346,428	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 36,130	千デンマーククローネ 46,864	729,213	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 30,230	千ポーランドズロチ 33,068	840,605	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 36,920	千オーストラリアドル 42,500	2,941,472	2.0	—	1.3	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 7,880	千シンガポールドル 8,898	673,847	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,470	千マレーシアリンギット 28,964	715,704	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシケル 14,800	千イスラエルシケル 18,833	577,047	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	147,177,380	98.6	—	55.7	30.3	12.5

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
	国債証券					
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	7,100	7,181	772,159	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,200	2,227	239,491	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	3,400	3,444	370,308	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	2,030	218,349	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	2,000	2,063	221,860	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 230215	1.375	3,000	3,095	332,854	2023/2/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,350	4,501	484,008	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,850	2,953	317,564	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,100	2,177	234,153	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	7,600	7,963	856,285	2025/1/31
	1.5 T-NOTE 211031	1.5	6,000	6,115	657,543	2021/10/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,351	252,782	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	4,200	4,349	467,671	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	3,250	3,369	362,270	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	1,500	1,577	169,596	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	2,000	2,105	226,380	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,700	6,046	650,114	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	2,740	2,911	313,086	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	5,000	5,365	576,869	2030/2/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,753	188,517	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	7,640	7,886	847,957	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	5,200	5,383	578,825	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 221215	1.625	5,000	5,182	557,234	2022/12/15
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,800	2,916	313,592	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	3,100	3,243	348,779	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,120	5,458	586,844	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	4,900	5,229	562,245	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,550	3,795	408,116	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,638	391,186	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	5,300	5,739	617,136	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	3,700	3,789	407,458	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	3,400	3,494	375,735	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,100	2,161	232,442	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,700	3,813	410,038	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,443	155,214	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,700	1,754	188,595	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220630	1.75	4,900	5,062	544,299	2022/6/30
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,865	200,597	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,700	2,811	302,301	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,567	168,550	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 241231	1.75	2,850	3,033	326,182	2024/12/31
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	3,100	3,343	359,534	2026/12/31
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,359	253,739	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,550	2,623	282,058	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	5,100	5,254	565,016	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	2,450	2,528	271,882	2022/3/31

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	1.875 T-NOTE 220430	1.875	5,700	5,887	632,973	2022/4/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	6,760	6,992	751,820	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	4,500	4,666	501,757	2022/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,500	1,557	167,466	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	2,000	2,078	223,507	2022/9/30
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,700	2,810	302,188	2022/10/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,850	1,893	203,636	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,700	1,744	187,610	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,650	2,722	292,730	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2.0	5,850	6,020	647,370	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,270	244,130	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,900	3,015	324,255	2022/7/31
	2 T-NOTE 221031	2.0	2,000	2,087	224,498	2022/10/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	6,200	6,479	696,726	2022/11/30
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,000	2,133	229,370	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	3,850	4,111	442,055	2024/5/31
	2 T-NOTE 240630	2.0	2,200	2,351	252,880	2024/6/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,700	5,063	544,468	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,300	5,738	617,047	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,150	5,632	605,640	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,650	1,686	181,371	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	4,500	4,610	495,746	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,200	2,258	242,864	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	4,060	4,187	450,206	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,874	201,519	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	5,150	5,406	581,284	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	4,500	4,793	515,440	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	4,550	4,863	522,887	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	3,460	3,703	398,234	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,750	1,881	202,286	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,250	2,425	260,782	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	2,052	220,710	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,300	2,499	268,721	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,710	3,187	342,666	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	3,400	3,485	374,735	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 220415	2.25	2,700	2,806	301,746	2022/4/15
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,900	5,248	564,344	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	7,300	7,829	841,862	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	5,000	5,382	578,760	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,800	3,037	326,575	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,250	7,867	845,900	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,570	7,215	775,832	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,750	5,285	568,295	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,700	5,260	565,590	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	3,000	3,364	361,796	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 230131	2.375	5,000	5,292	569,016	2023/1/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,300	4,671	502,284	2024/8/15

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
国債証券	2.375 T-NOTE 270515	2.375	2,690	3,026	325,427	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	3,670	4,209	452,555	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,060	3,741	402,241	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,170	3,894	418,725	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,300	4,056	436,201	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,400	3,646	392,071	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,922	744,253	2024/1/31
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,350	4,727	508,344	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,200	2,421	260,309	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 210715	2.625	4,600	4,732	508,869	2021/7/15
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	3,000	3,201	344,181	2023/2/28
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,500	2,685	288,708	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	2,300	2,551	274,324	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	2,600	2,913	313,207	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	3,700	4,152	446,495	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	5,320	6,199	666,610	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,450	3,104	333,848	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	4,050	5,134	552,042	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	3,340	4,323	464,859	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	2,540	3,292	353,985	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 210815	2.75	11,660	12,040	1,294,574	2021/8/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	3,600	3,873	416,525	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,050	8,744	940,256	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	5,960	6,508	699,794	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	2,150	2,394	257,427	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	6,000	6,719	722,433	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,840	6,556	704,983	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,260	7,275	782,292	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,000	3,881	417,286	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	4,350	5,686	611,423	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,080	4,062	436,796	2046/11/15
	2.875 T-NOTE 211015	2.875	4,700	4,880	524,708	2021/10/15
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	2,500	2,807	301,896	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250531	2.875	2,400	2,699	290,263	2025/5/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	4,307	463,159	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	4,200	4,938	530,999	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	5,060	5,967	641,640	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,270	1,675	180,118	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	4,900	6,504	699,390	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,110	4,140	445,205	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	2,950	3,945	424,233	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,150	4,255	457,572	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,750	3,716	399,606	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,050	4,137	444,814	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	2,210	3,009	323,533	2048/8/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,050	2,748	295,546	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,881	202,272	2042/2/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.125 T-BOND 430215		3.125	4,000	5,373	577,718	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815		3.125	4,450	6,015	646,786	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515		3.125	2,610	3,622	389,457	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115		3.125	9,950	11,978	1,287,967	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515		3.375	4,240	5,947	639,485	2044/5/15
	3.625 T-BOND 430815		3.625	2,850	4,125	443,560	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215		3.625	4,550	6,608	710,548	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815		3.75	1,000	1,459	156,970	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115		3.75	4,450	6,569	706,332	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815		3.875	1,150	1,700	182,844	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515		4.25	1,030	1,584	170,401	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115		4.25	1,370	2,123	228,318	2040/11/15
	4.375 T-BOND 391115		4.375	1,350	2,112	227,128	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515		4.375	1,250	1,963	211,112	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515		4.375	1,300	2,050	220,496	2041/5/15
	4.5 T-BOND 390815		4.5	1,100	1,745	187,636	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215		4.625	1,900	3,063	329,430	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215		4.75	1,530	2,515	270,496	2041/2/15
	5.25 T-BOND 281115		5.25	550	760	81,778	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215		5.25	300	417	44,929	2029/2/15
	5.5 T-BOND 280815		5.5	600	835	89,873	2028/8/15
	6 T-BOND 260215		6.0	2,600	4,424	368,244	2026/2/15
	6.25 T-BOND 230815		6.25	2,130	2,546	273,837	2023/8/15
	8 T-BOND 211115		8.0	600	671	72,180	2021/11/15
小 計						69,234,594	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 220301		0.5	1,500	1,506	115,236	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901		0.75	3,120	3,140	240,175	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901		1.0	2,350	2,389	182,759	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601		1.0	1,200	1,244	95,195	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301		1.25	600	625	47,821	2025/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601		1.5	850	882	67,476	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 240901		1.5	2,000	2,099	160,542	2024/9/1
	1.5 CAN GOVT 260601		1.5	970	1,034	79,121	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 210501		1.75	1,100	1,116	85,365	2021/5/1
	1.75 CAN GOVT 230301		1.75	800	833	63,765	2023/3/1
	2 CAN GOVT 230901		2.0	2,400	2,535	193,926	2023/9/1
	2 CAN GOVT 280601		2.0	900	1,007	77,028	2028/6/1
	2 CAN GOVT 511201		2.0	1,160	1,417	108,432	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 240301		2.25	800	858	65,665	2024/3/1
	2.25 CAN GOVT 250601		2.25	1,300	1,422	108,788	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601		2.25	890	1,026	78,522	2029/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601		2.5	1,500	1,631	124,791	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601		2.75	850	893	68,329	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201		2.75	860	1,187	90,838	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201		2.75	310	479	36,686	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601		3.25	800	825	63,139	2021/6/1

銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額		千円		
				外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ	国債証券	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,270	1,918	146,685	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,699	129,996	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	850	1,390	106,350	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	900	1,318	100,794	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,370	2,212	169,209	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	240	365	27,984	2027/6/1	
		小 計					2,834,629	
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	19,300	23,096	103,242	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	6,600	8,825	39,450	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	11,700	11,940	53,372	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	26,740	27,129	121,267	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	19,400	20,015	89,469	2022/6/9	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	10,500	10,988	49,117	2023/3/9	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	6,500	6,729	30,081	2021/12/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	24,150	26,795	119,775	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,150	10,309	46,085	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	9,500	10,749	48,052	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	13,240	14,468	64,674	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	23,450	25,763	115,162	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	10,800	12,087	54,031	2047/11/7	
8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	22,000	25,914	115,837	2029/5/31			
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	12,100	14,253	63,711	2038/11/18			
小 計					1,113,331			
ユーロ	ドイツ	国債証券	0 BUND 500815	—	470	478	55,539	2050/8/15
			0 OBL 220408	—	1,700	1,724	200,127	2022/4/8
			0 OBL 221007	—	2,000	2,037	236,336	2022/10/7
			0 OBL 230414	—	1,400	1,432	166,178	2023/4/14
			0 OBL 231013	—	2,150	2,208	256,213	2023/10/13
			0 SCHATZ 220311	—	3,900	3,954	458,842	2022/3/11
			0.25 BUND 270215	0.25	2,600	2,768	321,221	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	1,990	2,135	247,787	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	5,700	6,130	711,261	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	4,000	4,244	492,494	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	2,600	2,788	323,470	2026/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	2,300	2,498	289,887	2027/8/15
			0.5 BUND 280215	0.5	1,900	2,072	240,427	2028/2/15
			1 BUND 240815	1.0	1,750	1,884	218,680	2024/8/15
			1 BUND 250815	1.0	2,800	3,062	355,299	2025/8/15
			1.25 BUND 480815	1.25	2,850	3,935	456,583	2048/8/15
			1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,369	158,877	2022/9/4
			1.5 BUND 230215	1.5	2,500	2,660	308,650	2023/2/15
			1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,604	186,140	2023/5/15
			1.5 BUND 240515	1.5	1,550	1,694	196,556	2024/5/15
1.75 BUND 220704	1.75	2,300	2,425	281,371	2022/7/4			
1.75 BUND 240215	1.75	4,450	4,881	566,327	2024/2/15			

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	2 BUND 220104	2.0	1,500	1,568	182,000	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,450	1,583	183,718	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	1,880	3,104	360,189	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	2,030	3,441	399,306	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	1,030	1,828	212,104	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	1,690	2,934	340,482	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,650	3,106	360,421	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	930	1,344	155,940	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,040	3,567	413,849	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,190	2,415	280,193	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,290	2,136	247,874	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,250	1,860	215,912	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,130	1,422	165,093	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,254	145,514	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,200	1,827	212,058	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	1,350	1,346	156,222	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,500	1,435	166,542	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,300	1,301	151,024	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,700	2,673	310,156	2023/10/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	3,200	3,212	372,675	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,980	1,985	230,335	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	1,400	1,413	163,962	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,550	1,521	176,536	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,164	135,092	2022/4/15
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,300	2,191	254,227	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,400	1,422	165,039	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,600	1,614	187,272	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,600	1,607	186,475	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	750	671	77,857	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,550	1,559	180,959	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,000	2,010	233,235	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,850	1,779	206,479	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	850	873	101,303	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,730	1,781	206,697	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,800	1,840	213,509	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,300	1,333	154,749	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,350	1,393	161,689	2026/7/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,400	1,450	168,342	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,260	1,252	145,351	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,400	1,445	167,717	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,080	1,023	118,799	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,800	1,896	220,046	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,410	1,488	172,647	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,200	1,212	140,644	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,550	1,673	194,120	2028/12/1
2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	630	624	72,459	2067/3/1		
2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,250	1,341	155,593	2038/9/1		

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	
			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	3 ITALY GOVT 290801	3.0	550	602	69,933	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	590	642	74,502	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,150	1,270	147,439	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,190	1,359	157,743	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,700	1,937	224,800	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,800	1,860	215,825	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	3,000	3,120	362,044	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,500	1,656	192,130	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	920	1,123	130,331	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,050	2,496	289,609	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,300	2,542	294,975	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,120	2,385	276,722	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,450	1,691	196,274	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,166	367,426	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,700	1,904	220,958	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,458	285,232	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,220	1,662	192,928	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,617	187,618	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,920	2,247	260,710	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,310	3,076	356,897	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,620	2,231	258,924	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,050	2,829	328,241	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,709	314,334	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,150	1,273	147,763	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,200	2,451	284,377	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,730	2,415	280,223	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,530	3,511	407,376	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,070	2,758	320,078	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,100	1,482	171,994	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,200	1,526	177,111	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 220525	—	2,700	2,730	316,794	2022/5/25
		0 O. A. T 230325	—	3,100	3,148	365,258	2023/3/25
		0 O. A. T 250325	—	2,000	2,040	236,737	2025/3/25
		0 O. A. T 291125	—	2,100	2,103	244,049	2029/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	1,500	1,550	179,889	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	2,750	2,878	333,977	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	3,250	3,411	395,763	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	2,200	2,312	268,337	2029/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	3,190	3,419	396,735	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	3,100	3,327	386,023	2028/11/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,920	2,066	239,710	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	2,900	3,148	365,340	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	2,070	2,348	272,418	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	2,730	3,104	360,232	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	3,390	3,926	455,504	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	1,180	1,424	165,274	2050/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	6,850	7,333	850,866	2023/5/25

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	1.75 O.A.T 241125	1.75	2,900	3,193	370,539	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	2,370	2,926	339,492	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,270	1,719	199,551	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	1,840	2,444	283,645	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	3,850	4,117	477,680	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,740	3,046	353,469	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,950	3,690	428,134	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,270	3,996	463,649	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	5,500	5,882	682,518	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	1,600	1,687	195,795	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,960	3,146	365,007	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,550	3,135	363,773	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,840	3,001	348,192	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,440	2,862	332,088	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,310	2,736	317,491	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,590	4,191	486,300	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,560	4,579	531,328	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,400	3,968	460,415	2035/4/25
5.5 O.A.T 290425	5.5	2,750	4,131	479,354	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,220	3,758	436,055	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	3,700	4,998	579,936	2025/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,300	1,648	191,222	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	800	808	93,849	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	1,250	1,280	148,508	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,408	163,451	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	400	420	48,834	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,350	1,436	166,606	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,180	1,282	148,813	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,330	1,454	168,764	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,077	125,026	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,055	122,502	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	900	958	111,162	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,730	2,323	269,573	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	980	1,680	194,934	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,600	1,671	193,933	2021/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	300	336	38,985	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,357	273,462	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	1,490	2,506	290,780	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,150	1,677	194,651	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	650	794	92,162	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.05 SPAIN GOVT 211031	0.05	1,000	1,003	116,474	2021/10/31
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	1,100	1,113	129,165	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,500	1,517	176,092	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,450	1,471	170,748	2022/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,100	2,069	240,158	2029/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	2,600	2,632	305,394	2021/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	600	509	59,085	2050/10/31

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,950	2,060	239,004	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	1,500	1,591	184,592	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,900	2,015	233,831	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,100	2,234	259,259	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,320	1,403	162,828	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,450	1,550	179,928	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,923	223,109	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	850	931	108,084	2035/7/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,900	2,078	241,156	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,220	2,463	285,862	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,000	2,202	255,558	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,740	2,022	234,673	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	970	1,215	140,985	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,050	2,288	265,516	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,310	1,688	195,916	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	820	1,250	145,054	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,300	2,638	306,144	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,470	2,136	247,925	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	2,350	2,709	314,368	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,050	2,517	292,134	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,550	2,489	288,862	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,300	1,529	177,510	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,300	2,111	244,995	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,350	1,846	214,265	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,160	2,021	234,581	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,750	2,012	233,481	2023/1/31
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,850	4,434	514,502	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,850	2,042	237,004	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,450	1,938	224,887	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,603	302,102	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	600	614	71,263	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	800	831	96,498	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,375	159,616	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,080	1,153	133,863	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,252	261,332	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	1,060	1,147	133,186	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,100	1,183	137,345	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	650	712	82,683	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	940	1,061	123,163	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	300	347	40,273	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	880	1,067	123,815	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	390	485	56,300	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	630	778	90,374	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	570	842	97,689	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	891	103,402	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	360	520	60,444	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,180	1,328	154,080	2024/6/22

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
ベルギー	国債証券	3 BEL GOVT 340622	3.0	610	836	96,998	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	970	1,655	192,064	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	750	814	94,518	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	620	898	104,191	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	950	1,012	117,479	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,227	142,381	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,218	257,427	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	680	872	101,203	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,520	2,538	294,543	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,200	1,734	201,236	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	—	400	406	47,106	2022/9/20
		0 AUSTRIA GOVT 230715	—	950	967	112,225	2023/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	600	605	70,234	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,150	1,213	140,765	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	850	910	105,611	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,010	1,085	125,990	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	910	990	114,959	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	450	583	67,679	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	200	289	33,549	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	700	767	89,084	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,200	1,297	150,528	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	420	795	92,243	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	590	778	90,321	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	755	87,660	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	650	716	83,177	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,050	1,108	128,589	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	650	75,459	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	480	1,083	125,714	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,000	1,665	193,243	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	720	83,555	2026/3/15
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	970	1,425	165,338	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	250	253	29,362	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	350	356	41,387	2023/9/15
		0 FINNISH GOVT 240915	—	250	255	29,622	2024/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	200	198	23,083	2036/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	421	48,888	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,000	1,055	122,493	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	250	264	30,669	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	200	211	24,543	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	381	44,212	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	535	62,091	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	320	37,147	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	240	306	35,603	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	265	30,806	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	315	36,656	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	220	25,541	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	531	61,610	2042/7/4

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	
フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	530	658	76,419	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	300	369	42,921	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	250	252	29,276	2022/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	320	313	36,415	2035/5/15
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	511	59,310	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,200	1,279	148,481	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	970	1,033	119,945	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	700	759	88,166	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	300	333	38,736	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	230	256	29,733	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	310	357	41,434	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	400	470	54,586	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	590	753	87,436	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	800	973	112,906	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	685	79,524	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	448	52,072	2023/3/20
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	700	890	103,276	2025/3/13		
小 計						56,889,831	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	1,100	1,112	147,117	2022/7/22	
	0.625 GILT 250607	0.625	1,500	1,541	203,820	2025/6/7	
	0.75 GILT 230722	0.75	2,450	2,506	331,480	2023/7/22	
	0.875 GILT 291022	0.875	570	604	79,986	2029/10/22	
	1 GILT 240422	1.0	1,700	1,763	233,242	2024/4/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	1,770	1,913	253,098	2027/7/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,660	1,808	239,176	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	1,940	2,386	315,671	2047/7/22	
	1.625 GILT 281022	1.625	2,150	2,415	319,392	2028/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	280	442	58,502	2071/10/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	3,000	3,121	412,810	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	1,700	2,039	269,661	2037/9/7	
	1.75 GILT 490122	1.75	930	1,215	160,763	2049/1/22	
	1.75 GILT 570722	1.75	1,250	1,782	235,698	2057/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	780	862	114,053	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,825	241,443	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	1,440	2,637	348,792	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	510	569	75,295	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,830	2,897	383,166	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,750	2,912	385,127	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,850	4,300	568,745	2068/7/22	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,210	2,358	311,938	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,050	1,126	148,979	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,110	2,527	334,274	2060/1/22	
4.25 GILT 271207	4.25	980	1,280	169,401	2027/12/7		
4.25 GILT 320607	4.25	1,220	1,777	235,023	2032/6/7		
4.25 GILT 360307	4.25	1,290	2,028	268,231	2036/3/7		
4.25 GILT 390907	4.25	1,150	1,930	255,251	2039/9/7		

銘柄	当 期 末						
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券	4.25 GILT 401207	4.25	1,170	2,005	265,286	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,410	2,674	353,699	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	930	1,855	245,439	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,320	2,921	386,429	2055/12/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	1,260	1,968	260,399	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	1,210	2,211	292,513	2042/12/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,570	207,691	2030/12/7	
	4.75 GILT 381207	4.75	1,410	2,464	325,915	2038/12/7	
	5 GILT 250307	5.0	1,130	1,397	184,777	2025/3/7	
	6 GILT 281207	6.0	1,080	1,614	213,531	2028/12/7	
	8 GILT 210607	8.0	300	325	43,045	2021/6/7	
小 計					9,878,880		
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	2,550	2,734	29,694	2028/5/12	
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,400	4,740	51,484	2029/11/12	
	1 SWD GOVT 261112	1.0	5,660	6,118	66,447	2026/11/12	
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,100	5,428	58,950	2023/11/13	
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,630	5,283	57,382	2025/5/12	
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,900	7,445	80,863	2022/6/1	
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,330	5,245	56,970	2039/3/30	
小 計					401,792		
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,800	1,973	20,500	2030/8/19	
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,160	4,488	46,634	2026/2/19	
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,300	2,490	25,880	2025/3/13	
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	3,050	3,368	34,998	2027/2/17	
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	2,200	2,480	25,768	2029/9/6	
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,150	5,470	56,841	2023/5/24	
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,850	3,230	33,564	2028/4/26	
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,400	4,904	50,960	2024/3/14	
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,750	4,935	51,278	2021/5/25	
小 計					346,428		
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	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	7,350	7,864	122,378	2027/11/15	
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,400	4,742	73,798	2029/11/15	
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,650	3,920	60,995	2023/11/15	
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	4,850	5,466	85,062	2025/11/15	
	3 DMK GOVT 211115	3.0	6,020	6,345	98,732	2021/11/15	
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,860	18,524	288,245	2039/11/15	
小 計					729,213		
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	1,900	1,929	49,040	2021/7/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	1,250	1,292	32,849	2022/4/25	
	2.25 POLAND 241025	2.25	1,000	1,060	26,955	2024/10/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	2,500	2,624	66,724	2023/1/25	
	2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,774	70,523	2024/4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	5,500	5,927	150,684	2026/7/25	

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
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	2.5 POLAND 270725	2.5	2,050	2,208	56,152	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	2,660	2,917	74,163	2028/4/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,950	2,166	55,073	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	2,700	3,003	76,358	2023/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,700	1,829	46,506	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,550	1,737	44,156	2022/9/23	
	5.75 POLAND 290425	5.75	2,070	2,806	71,346	2029/4/25	
	POLAND 220725	—	800	789	20,068	2022/7/25	
小計					840,605		
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	2,800	2,787	192,899	2024/11/21	
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	760	774	53,606	2032/5/21	
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	1,000	1,049	72,603	2031/6/21	
	2 AUST GOVT 211221	2.0	1,150	1,182	81,862	2021/12/21	
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	1,000	1,051	72,741	2022/11/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,300	2,561	177,306	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	2,300	2,637	182,514	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,700	1,863	128,985	2024/4/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,950	2,238	154,931	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,950	2,255	156,090	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,830	2,133	147,681	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	596	41,279	2035/6/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,350	1,703	117,893	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,800	2,051	142,013	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,090	2,513	173,993	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	820	1,044	72,259	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	1,071	74,185	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,490	3,034	210,023	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,270	1,785	123,602	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,950	2,493	172,593	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,019	139,804	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,760	1,857	128,571	2021/5/15	
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,600	1,792	124,027	2022/7/15	
小計					2,941,472		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	1.25 SINGAPORGGOVT 211001	1.25	550	556	42,170	2021/10/1	
	1.75 SINGAPORGGOVT 220401	1.75	350	358	27,175	2022/4/1	
	1.75 SINGAPORGGOVT 230201	1.75	250	258	19,597	2023/2/1	
	1.875 SINGAPORGGOV 500301	1.875	250	292	22,126	2050/3/1	
	2 SINGAPORGGOVT 240201	2.0	100	105	7,987	2024/2/1	
	2.125 SINGAPORGGOV 260601	2.125	630	685	51,884	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGGOVT 210601	2.25	420	428	32,451	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGGOVT 360801	2.25	260	300	22,771	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGGOV 250601	2.375	300	326	24,734	2025/6/1	
	2.375 SINGAPORGGOV 390701	2.375	200	239	18,145	2039/7/1	
	2.625 SINGAPORGGOV 280501	2.625	300	342	25,963	2028/5/1	
	2.75 SINGAPORGGOVT 230701	2.75	450	481	36,474	2023/7/1	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	290	374	28,330	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	520	687	52,099	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	250	293	22,232	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	356	27,001	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	600	662	50,197	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	800	849	64,340	2022/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	410	526	39,868	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	650	769	58,296	2027/3/1
小計					673,847	
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	922	22,796	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,239	30,625	2023/3/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	315	7,806	2027/5/31
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	1,100	1,172	28,963	2028/6/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	517	12,791	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	209	5,165	2023/8/17
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	500	542	13,400	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	645	15,944	2033/4/15
	3.882 MALAYSIAGOV 220310	3.882	500	514	12,719	2022/3/10
	3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,062	26,247	2025/3/14
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	536	13,268	2027/3/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,185	29,285	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,000	1,074	26,553	2026/11/30
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,700	1,821	45,015	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	800	858	21,212	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	922	22,805	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,060	1,172	28,974	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	2,250	2,302	56,896	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,068	26,395	2024/7/15
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	850	949	23,466	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	986	24,386	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,100	1,241	30,676	2030/4/15
	4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,391	34,374	2033/11/7
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,050	1,239	30,631	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	1,600	1,885	46,579	2037/4/7
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	600	729	18,019	2048/7/6
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	1,200	1,443	35,680	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	860	1,012	25,018	2028/9/15
小計					715,704	
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	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	1,900	2,163	66,302	2028/9/28
	3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	2,000	2,272	69,635	2024/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,200	1,723	52,820	2047/3/31
	4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	1,000	1,119	34,315	2023/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	3,800	4,211	129,047	2022/1/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,400	2,455	75,235	2042/1/31

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	
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	千円	
国債証券 6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,885	149,690	2026/10/30
小 計				577,047	
合 計				147,177,380	

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 147,177,380	% 98.2
コール・ローン等、その他	2,708,393	1.8
投資信託財産総額	149,885,773	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (149,217,319千円) の投資信託財産総額 (149,885,773千円) 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=107.52円	1 カナダドル=76.47円	1 メキシコペソ=4.47円	1 ユーロ=116.02円
1 イギリスポンド=132.25円	1 スウェーデンクローネ=10.86円	1 ノルウェークローネ=10.39円	1 デンマーククローネ=15.56円
1 ポーランドズロチ=25.42円	1 オーストラリアドル=69.21円	1 シンガポールドル=75.73円	1 マレーシアリンギット=24.71円
1 イスラエルシェケル=30.64円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	150,196,638,522
コール・ローン等	1,606,933,871
公社債(評価額)	147,177,380,764
未収入金	310,865,338
未収利息	978,667,015
前払費用	122,791,534
(B) 負債	886,399,564
未払金	874,057,047
未払解約金	12,342,455
未払利息	62
(C) 純資産総額(A-B)	149,310,238,958
元本	70,021,031,430
次期繰越損益金	79,289,207,528
(D) 受益権総口数	70,021,031,430口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,324円

<注記事項>

- ①期首元本額 67,295,786,020円
 期中追加設定元本額 16,311,803,664円
 期中一部解約元本額 13,586,558,254円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,1324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)	26,414,882,933円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	10,200,387,984円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,122,242,114円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	4,324,032,523円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,779,451,871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)	2,640,109,093円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,239,490,397円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,047,844,821円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,961,147,101円
海外債券セレクション(ラップ向け)	1,612,485,673円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,607,967,471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)	1,547,760,325円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,474,962,155円
つみたて8資産均等バランス ファンド・マネジャー(海外債券)	1,122,245,178円 932,502,192円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	634,889,113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)	527,920,565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)	389,643,524円
つみたて4資産均等バランス	320,391,297円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	254,438,953円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	246,002,409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)	212,749,942円
eMAXIS バランス(波乗り型)	204,923,110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)	139,293,594円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	136,358,854円

○損益の状況 (2019年5月14日~2020年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,210,854,000
受取利息	3,211,621,552
その他収益金	10,773
支払利息	△ 778,325
(B) 有価証券売買損益	3,077,906,571
売買益	10,426,914,791
売買損	△ 7,349,008,220
(C) 保管費用等	△ 16,592,181
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,272,168,390
(E) 前期繰越損益金	70,065,888,298
(F) 追加信託差損益金	18,186,103,890
(G) 解約差損益金	△15,234,953,050
(H) 計(D+E+F+G)	79,289,207,528
次期繰越損益金(H)	79,289,207,528

- (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。

e MAX I S 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	120,739,411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)	110,224,076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)	104,661,150円
e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)	103,150,429円
アドバンスト・バランス I (FOFs 用) (適格機関投資家限定)	100,614,309円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	48,020,053円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	42,361,257円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	42,179,647円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	39,539,015円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	31,615,729円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	31,018,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	23,572,599円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	22,213,126円
e MAX I S 最適化バランス (マイフoward)	18,294,746円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	17,141,039円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	16,600,604円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	9,597,890円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	7,735,425円
e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)	7,730,040円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	6,341,987円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	4,392,572円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	4,053,511円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	2,528,547円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	2,528,431円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,322,536円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	2,195,263円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,638,542円
コアバランス	1,570,604円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,312,036円
e MAX I S マイマネージャー 1970s	679,371円
e MAX I S マイマネージャー 1980s	295,303円
e MAX I S マイマネージャー 1990s	40,197円
合計	70,021,031,430円