

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（2007年4月19日設定）	
運用方針	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動することをめざして運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	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は制限を設けません。
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、利子・配当収益を中心に基準価額水準、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。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド （毎月分配型）



第118期（決算日：2017年2月17日）
 第119期（決算日：2017年3月17日）
 第120期（決算日：2017年4月17日）
 第121期（決算日：2017年5月17日）
 第122期（決算日：2017年6月19日）
 第123期（決算日：2017年7月18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 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）」は、去る7月18日に第123期の決算を行いましたので、法令に基づいて第118期～第123期の運用状況をまとめて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
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
 (9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)
 お客さまのお取引内容につきましては、お取り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30期の運用実績

決算期	基準価額			シティ世界国債インデックス		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(除く日本、円ベース)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
94期(2015年2月17日)	10,052	16	△0.4	467.3016	0.2	98.6	—	1,337
95期(2015年3月17日)	10,003	16	△0.3	464.3767	△0.6	98.8	—	1,339
96期(2015年4月17日)	9,978	16	△0.1	463.7206	△0.1	98.7	—	1,329
97期(2015年5月18日)	10,078	16	1.2	468.9288	1.1	98.8	—	1,343
98期(2015年6月17日)	10,126	16	0.6	473.2170	0.9	98.8	—	1,330
99期(2015年7月17日)	10,055	16	△0.5	470.7362	△0.5	98.8	—	1,299
100期(2015年8月17日)	10,237	16	2.0	480.5958	2.1	98.8	—	1,326
101期(2015年9月17日)	9,894	16	△3.2	465.4917	△3.1	98.8	—	1,282
102期(2015年10月19日)	9,951	16	0.7	469.1848	0.8	98.7	—	1,291
103期(2015年11月17日)	9,895	16	△0.4	467.8405	△0.3	98.8	—	1,280
104期(2015年12月17日)	9,847	16	△0.3	465.4863	△0.5	98.2	—	1,270
105期(2016年1月18日)	9,450	16	△3.9	449.3966	△3.5	98.6	—	1,226
106期(2016年2月17日)	9,421	16	△0.1	447.1506	△0.5	98.8	—	1,212
107期(2016年3月17日)	9,329	16	△0.8	445.6667	△0.3	98.2	—	1,201
108期(2016年4月18日)	9,041	16	△2.9	435.6848	△2.2	98.4	—	1,178
109期(2016年5月17日)	9,094	16	0.8	435.8932	0.0	98.6	—	1,194
110期(2016年6月17日)	8,810	16	△2.9	417.9534	△4.1	98.6	—	1,163
111期(2016年7月19日)	8,869	16	0.9	427.2911	2.2	98.6	—	1,173
112期(2016年8月17日)	8,524	16	△3.7	410.7504	△3.9	98.8	—	1,129
113期(2016年9月20日)	8,482	16	△0.3	410.7343	△0.0	98.6	—	1,126
114期(2016年10月17日)	8,505	16	0.5	414.2841	0.9	98.6	—	1,129
115期(2016年11月17日)	8,549	16	0.7	419.0441	1.1	98.6	—	1,138
116期(2016年12月19日)	9,064	16	6.2	444.3646	6.0	98.6	—	1,198
117期(2017年1月17日)	8,871	16	△2.0	434.1533	△2.3	98.7	—	1,163
118期(2017年2月17日)	8,814	16	△0.5	432.2601	△0.4	98.5	—	1,145
119期(2017年3月17日)	8,794	16	△0.0	430.6436	△0.4	98.6	—	1,144
120期(2017年4月17日)	8,465	16	△3.6	421.5378	△2.1	98.6	—	1,099
121期(2017年5月17日)	8,926	16	5.6	442.9434	5.1	98.4	—	1,158
122期(2017年6月19日)	8,923	16	0.1	441.1518	△0.4	98.7	—	1,151
123期(2017年7月18日)	9,052	16	1.6	451.3775	2.3	98.8	—	1,165

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		シテイ世界国債 インデックス (除く日本、 円ベース)	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		円	騰 落 率				
第118期	(期 首) 2017年 1 月17日	8,871	—	434.1533	—	98.7	—
	1 月末	8,832	△0.4	432.5967	△0.4	99.1	—
	(期 末) 2017年 2 月17日	8,830	△0.5	432.2601	△0.4	98.5	—
第119期	(期 首) 2017年 2 月17日	8,814	—	432.2601	—	98.5	—
	2 月末	8,764	△0.6	429.5990	△0.6	99.2	—
	(期 末) 2017年 3 月17日	8,810	△0.0	430.6436	△0.4	98.6	—
第120期	(期 首) 2017年 3 月17日	8,794	—	430.6436	—	98.6	—
	3 月末	8,743	△0.6	428.1895	△0.6	98.9	—
	(期 末) 2017年 4 月17日	8,481	△3.6	421.5378	△2.1	98.6	—
第121期	(期 首) 2017年 4 月17日	8,465	—	421.5378	—	98.6	—
	4 月末	8,775	3.7	432.7440	2.7	98.7	—
	(期 末) 2017年 5 月17日	8,942	5.6	442.9434	5.1	98.4	—
第122期	(期 首) 2017年 5 月17日	8,926	—	442.9434	—	98.4	—
	5 月末	8,884	△0.5	439.8327	△0.7	98.7	—
	(期 末) 2017年 6 月19日	8,939	0.1	441.1518	△0.4	98.7	—
第123期	(期 首) 2017年 6 月19日	8,923	—	441.1518	—	98.7	—
	6 月末	9,029	1.2	450.1506	2.0	98.6	—
	(期 末) 2017年 7 月18日	9,068	1.6	451.3775	2.3	98.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について（第118期～第123期：2017/1/18～2017/7/18）

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ3.2%（分配金再投資ベース）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（4.0%）を0.8%下回りました。



- ・分配金再投資基準価額は、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、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・欧州中央銀行（ECB）が金融緩和政策を縮小することが意識されたことなどを背景に、ユーロが対円で買われたことが基準価額の上昇要因となりました。 ・先進国の債券市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・米トランプ政権の政権運営の不透明感などを背景に、米ドルが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第118期～第123期：2017/1/18～2017/7/18）

債券市況の推移
（当作成期首を100として指数化）



◎債券市況

- ・先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス（除く日本、Local）は、トランプ政権の政権運営の不透明感などを背景に上昇しました。

為替市況の推移
（当作成期首を100として指数化）



◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、米トランプ政権の政権運営の不透明感などを背景に、米ドルが対円で売られました。当作成期首との比較では、米ドルは対円で1.5%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ECBが金融緩和政策を縮小することが意識されたことなどを背景に、ユーロが対円で買われました。当作成期首との比較では、ユーロは対円で6.6%上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）＞

- ・当ファンドは、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

＜三菱UFJ 外国債券マザーファンド＞

基準価額は当作成期首に比べ3.6%の上昇となりました。

- ・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シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・作成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。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

作成期首（2017年1月17日）

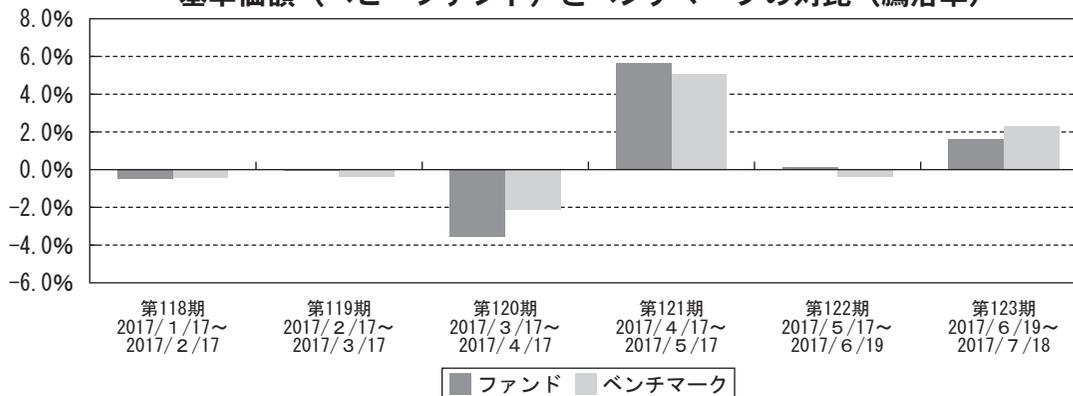
作成期末（2017年7月18日）

最終利回り	1.3%	➡	最終利回り	1.4%
直接利回り	2.5%		直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年		デュレーション	7.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について（第118期～第123期：2017/1/18～2017/7/18）

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

<三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）>

・基準価額（分配金再投資ベース）とベンチマークとの乖離は $\Delta 0.8\%$ 程度となりました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマークとの乖離	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.8\%$ 程度

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

◎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は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

ベンチマークは4.0%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.4\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.4\%$ 程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。
 - 為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
 - 債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

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118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日	2017年5月18日～ 2017年6月19日	2017年6月20日～ 2017年7月18日
当期分配金	16	16	16	16	16	16
（対基準価額比率）	0.181%	0.182%	0.189%	0.179%	0.179%	0.176%
当期の収益	12	11	12	16	13	16
当期の収益以外	3	4	3	—	2	—
翌期繰越分配対象額	1,834	1,830	1,826	1,829	1,826	1,828

（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

＜三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜三菱UFJ 外国債券マザーファンド＞

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

○1万口当たりの費用明細

(2017年1月18日～2017年7月18日)

項 目	第118期～第123期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率× (作成期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(19)	(0.216)	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)	(14)	(0.162)	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)	(2)	(0.027)	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	0.020	(b) その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.018)	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)	(0.002)	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
合 計	38	0.424	
作成期中の平均基準価額は、8,837円です。			

(注) 作成期間の費用（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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2017年1月18日～2017年7月18日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第118期～第123期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千口 8,764	千円 22,377	千口 23,798	千円 61,051

○利害関係人との取引状況等

(2017年1月18日～2017年7月18日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

区 分	第118期～第123期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 1,741	百万円 1,061	% 60.9	百万円 10,707	百万円 6,235	% 58.2

平均保有割合 2.1%

※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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年7月18日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第117期末	第123期末	
	口 数	口 数	評 価 額
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千口 455,746	千口 440,712	千円 1,165,067

○投資信託財産の構成

(2017年7月18日現在)

項 目	第123期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千円 1,165,067	% 99.7
コール・ローン等、その他	3,936	0.3
投資信託財産総額	1,169,003	100.0

(注) 三菱UFJ 外国債券マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（52,574,006千円）の投資信託財産総額（52,616,924千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=112.43円	1 カナダドル=88.66円	1 メキシコペソ=6.40円	1 ユーロ=129.09円
1 イギリスポンド=146.75円	1 スイスフラン=116.82円	1 スウェーデンクローネ=13.56円	1 ノルウェークローネ=13.77円
1 デンマーククローネ=17.36円	1 ポーランドズロチ=30.73円	1 オーストラリアドル=87.55円	1 シンガポールドル=82.09円
1 マレーシアリンギット=26.20円	1 南アフリカランド=8.69円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第118期末	第119期末	第120期末	第121期末	第122期末	第123期末
	2017年2月17日現在	2017年3月17日現在	2017年4月17日現在	2017年5月17日現在	2017年6月19日現在	2017年7月18日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,148,816,875	1,147,108,799	1,102,543,427	1,162,137,684	1,155,342,667	1,169,003,175
コール・ローン等	984,173	891,062	1,058,339	1,021,377	1,090,918	768,821
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,145,676,502	1,144,100,937	1,099,471,588	1,158,208,707	1,151,174,649	1,165,067,654
未収入金	2,156,200	2,116,800	2,013,500	2,907,600	3,077,100	3,166,700
(B) 負債	2,952,136	2,820,243	2,888,027	3,736,402	3,977,070	3,738,355
未払収益分配金	2,079,996	2,081,894	2,078,489	2,076,440	2,064,604	2,059,703
未払解約金	72,781	22,756	29,999	896,692	1,065,447	924,630
未払信託報酬	794,916	711,617	775,207	759,028	842,314	749,832
未払利息	1	-	1	1	2	1
その他未払費用	4,442	3,976	4,331	4,241	4,703	4,189
(C) 純資産総額(A-B)	1,145,864,739	1,144,288,556	1,099,655,400	1,158,401,282	1,151,365,597	1,165,264,820
元本	1,299,998,037	1,301,184,055	1,299,055,996	1,297,775,617	1,290,377,565	1,287,314,770
次期繰越損益金	△ 154,133,298	△ 156,895,499	△ 199,400,596	△ 139,374,335	△ 139,011,968	△ 122,049,950
(D) 受益権総口数	1,299,998,037口	1,301,184,055口	1,299,055,996口	1,297,775,617口	1,290,377,565口	1,287,314,770口
1万円当たり基準価額(C/D)	8.814円	8.794円	8.465円	8.926円	8.923円	9.052円

○損益の状況

項 目	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日	2017年5月18日～ 2017年6月19日	2017年6月20日～ 2017年7月18日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 10	△ 9	△ 16	△ 22	△ 27	△ 22
受取利息	1	1	—	—	—	—
支払利息	△ 11	△ 10	△ 16	△ 22	△ 27	△ 22
(B) 有価証券売買損益	△ 4,397,368	181,210	△ 39,821,311	62,462,109	2,504,119	19,370,973
売買益	103,149	234,826	104,891	62,780,892	2,787,755	19,543,307
売買損	△ 4,500,517	△ 53,616	△ 39,926,202	△ 318,783	△ 283,636	△ 172,334
(C) 信託報酬等	△ 799,358	△ 715,593	△ 779,538	△ 763,269	△ 847,017	△ 754,021
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 5,196,736	△ 534,392	△ 40,600,865	61,698,818	1,657,075	18,616,930
(E) 前期繰越損益金	5,036,035	△ 2,228,656	△ 4,809,076	△ 47,164,463	12,318,883	11,814,571
(F) 追加信託差損益金	△151,892,601	△152,050,557	△151,912,166	△151,832,250	△150,923,322	△150,421,748
(配当等相当額)	(70,815,831)	(71,943,374)	(72,787,500)	(73,682,965)	(74,161,405)	(74,920,647)
(売買損益相当額)	(△222,708,432)	(△223,993,931)	(△224,699,666)	(△225,515,215)	(△225,084,727)	(△225,342,395)
(G) 計 (D + E + F)	△152,053,302	△154,813,605	△197,322,107	△137,297,895	△136,947,364	△119,990,247
(H) 収益分配金	△ 2,079,996	△ 2,081,894	△ 2,078,489	△ 2,076,440	△ 2,064,604	△ 2,059,703
次期繰越損益金 (G + H)	△154,133,298	△156,895,499	△199,400,596	△139,374,335	△139,011,968	△122,049,950
追加信託差損益金	△151,892,601	△152,050,557	△151,912,166	△151,832,250	△150,923,322	△150,421,748
(配当等相当額)	(70,824,689)	(71,946,464)	(72,794,358)	(73,687,681)	(74,167,269)	(74,925,901)
(売買損益相当額)	(△222,717,290)	(△223,997,021)	(△224,706,524)	(△225,519,931)	(△225,090,591)	(△225,347,649)
分配準備積立金	167,706,183	166,235,603	164,541,994	163,703,998	161,582,748	160,454,314
繰越損益金	△169,946,880	△171,080,545	△212,030,424	△151,246,083	△149,671,394	△132,082,516

(注) (B) 有価証券売買損益は各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。

<注記事項>

①作成期首（前作成期末）元本額 1,311,530,100円

 作成期中追加設定元本額 47,483,554円

 作成期中一部解約元本額 71,698,884円

 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9052円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は122,049,950円です。

③分配金の計算過程

項 目	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日	2017年5月18日～ 2017年6月19日	2017年6月20日～ 2017年7月18日
費用控除後の配当等収益額	1,644,590円	1,512,401円	1,615,533円	2,360,956円	1,770,334円	2,244,213円
費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	70,824,689円	71,946,464円	72,794,358円	73,687,681円	74,167,269円	74,925,901円
分配準備積立金額	168,141,589円	166,805,096円	165,004,950円	163,419,482円	161,877,018円	160,269,804円
当ファンドの分配対象収益額	240,610,868円	240,263,961円	239,414,841円	239,468,119円	237,814,621円	237,439,918円
1万口当たり収益分配対象額	1,850円	1,846円	1,842円	1,845円	1,842円	1,844円
1万口当たり分配金額	16円	16円	16円	16円	16円	16円
収益分配金金額	2,079,996円	2,081,894円	2,078,489円	2,076,440円	2,064,604円	2,059,703円

○分配金のお知らせ

	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
1 万口当たり分配金（税込み）	16円	16円	16円	16円	16円	16円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*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（<http://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月22日に第17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17期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債組入比率	債先物比率	純資産額
	期騰	期中 落率	期騰	期中 落率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2013年5月20日)	23,300	35.7	396.6181	36.1	98.9	—	238,488
14期(2014年5月20日)	24,305	4.3	412.1913	3.9	98.7	—	174,867
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186
16期(2016年5月20日)	25,716	△ 6.5	436.8953	△ 6.3	98.7	—	73,559
17期(2017年5月22日)	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—	54,433

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		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) 2016年5月20日	円	%		%	%	%
	25,716	—	436.8953	—	98.7	—
5月末	25,916	0.8	441.6129	1.1	98.7	—
6月末	24,490	△4.8	415.4491	△4.9	99.1	—
7月末	24,887	△3.2	425.0763	△2.7	98.8	—
8月末	24,703	△3.9	419.0226	△4.1	98.9	—
9月末	24,240	△5.7	414.9990	△5.0	99.2	—
10月末	24,279	△5.6	414.5482	△5.1	99.0	—
11月末	25,255	△1.8	431.0003	△1.3	98.7	—
12月末	26,042	1.3	442.1486	1.2	98.3	—
2017年1月末	25,421	△1.1	432.5967	△1.0	99.1	—
2月末	25,287	△1.7	429.5990	△1.7	99.2	—
3月末	25,290	△1.7	428.1895	△2.0	98.9	—
4月末	25,444	△1.1	432.7440	△1.0	98.7	—
(期 末) 2017年5月22日	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—

(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

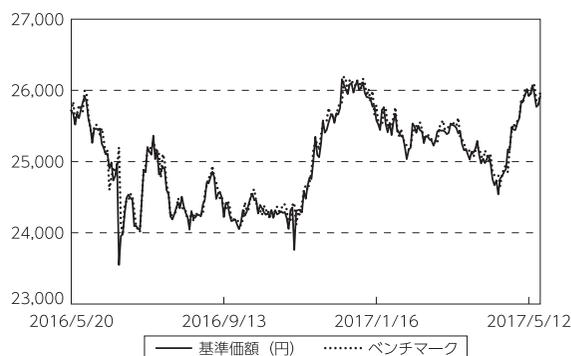
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.0%)を0.2%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国債券市況

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

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で1.3%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円で1.2%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シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.0%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・カस्टディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.035	(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)	(9)	(0.035)	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	9	0.035	
期中の平均基準価額は、25,104円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22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 4,020	百万円 2,560	% 63.7	百万円 23,107	百万円 12,940	% 56.0

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

○組入資産の明細

(2017年5月22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 207,950	千アメリカドル 212,060	千円 23,653,240	% 43.5	% —	% 17.8	% 17.1	% 8.5
カナダ	千カナダドル 12,270	千カナダドル 13,561	1,117,295	2.1	—	1.0	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 77,350	千メキシコペソ 80,105	476,625	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	26,330	31,020	3,871,050	7.1	—	4.2	2.0	1.0
イタリア	36,610	41,880	5,226,286	9.6	—	5.6	2.7	1.3
フランス	35,990	42,805	5,341,738	9.8	—	6.0	2.8	0.9
オランダ	8,060	9,556	1,192,503	2.2	—	1.4	0.6	0.2
スペイン	20,830	24,405	3,045,608	5.6	—	3.4	1.6	0.7
ベルギー	8,740	10,860	1,355,275	2.5	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	5,410	6,490	809,966	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	2,410	2,680	334,486	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	3,050	3,520	439,343	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 20,860	千イギリスポンド 27,094	3,922,132	7.2	—	5.2	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 710	千スイスフラン 862	98,788	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,400	千スウェーデンクローネ 18,902	241,390	0.4	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,750	千ノルウェークローネ 11,515	153,271	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 15,750	千デンマーククローネ 19,631	329,017	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 11,420	千ポーランドズロチ 11,768	350,241	0.6	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 12,510	千オーストラリアドル 13,592	1,128,604	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,440	千シンガポールドル 2,581	207,601	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリングギット 8,550	千マレーシアリングギット 8,561	221,582	0.4	—	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 37,600	千南アフリカランド 34,711	292,268	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	53,808,318	98.9	—	52.0	32.6	14.3

(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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	700	696	77,687	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	1,800	1,790	199,744	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	1,700	1,690	188,514	2018/9/30
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	694	77,422	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	700	691	77,153	2019/7/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	800	797	88,970	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	1,400	1,393	155,466	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	1,100	1,091	121,797	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	300	297	33,152	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	900	890	99,346	2019/9/15
	1 T-NOTE 180815	1.0	700	698	77,910	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,600	1,595	177,996	2018/9/15
	1 T-NOTE 181130	1.0	1,400	1,395	155,649	2018/11/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	300	297	33,221	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	700	694	77,474	2019/9/30
	1 T-NOTE 191115	1.0	1,250	1,239	138,221	2019/11/15
	1 T-NOTE 191130	1.0	900	892	99,519	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	600	599	66,895	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	800	794	88,667	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	350	346	38,688	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	687	76,650	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,955	218,147	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,000	1,953	217,921	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,300	1,267	141,376	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	300	33,480	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,500	1,500	167,394	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	500	500	55,785	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	145,052	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,200	1,200	133,848	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	450	449	50,167	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	700	698	77,907	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,100	1,096	122,262	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	99	11,106	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	886	98,935	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	1,300	1,273	142,011	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	300	287	32,055	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	2,100	2,104	234,773	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	1,000	1,002	111,792	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	400	400	44,710	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	800	801	89,427	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,403	156,503	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,703	189,988	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200115	1.375	800	799	89,214	2020/1/15
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,000	999	111,509	2020/1/31

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	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ						
	国債証券					
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,100	1,098	122,569	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	100	99	11,140	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,047	116,888	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	900	895	99,915	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,900	1,889	210,750	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,888	210,601	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,200	1,189	132,718	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,700	1,642	183,203	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	1,000	964	107,540	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	1,000	963	107,444	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	800	803	89,573	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	1,300	1,305	145,591	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	1,800	1,807	201,603	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	1,200	1,204	134,402	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	401	44,814	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	900	903	100,813	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,700	1,706	190,314	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	501	55,955	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,400	2,404	268,187	2020/4/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,200	1,201	133,963	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	197	22,039	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	900	878	97,993	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,650	1,549	172,811	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,200	1,208	134,747	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,107	123,527	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,800	1,812	202,120	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,400	1,409	157,229	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	1,600	1,610	179,663	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,207	134,695	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	2,100	2,112	235,579	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	250	250	27,987	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,300	1,302	145,262	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	550	543	60,671	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	1,400	1,381	154,082	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,300	1,276	142,396	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,200	1,173	130,867	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,750	1,668	186,151	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,300	2,188	244,095	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,100	1,108	123,599	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	504	56,310	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,350	1,358	151,567	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	250	251	28,037	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,551	173,008	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	99	11,139	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	948	105,780	2022/3/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	550	548	61,217	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,250	1,247	139,141	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,100	1,093	122,003	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	842	93,986	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,186	132,347	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	900	905	100,966	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,707	190,447	2022/3/31
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	100	11,197	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,000	1,001	111,705	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,200	1,200	133,879	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	600	609	67,954	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	800	812	90,584	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	600	608	67,896	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	700	709	79,188	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,100	1,114	124,309	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,113	124,165	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,112	124,083	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,517	169,303	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,213	135,348	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	1,500	1,512	168,682	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	1,200	1,207	134,642	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,310	257,764	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	1,900	1,881	209,856	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,000	2,960	330,201	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,150	1,126	125,615	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,600	1,630	181,865	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	101	11,360	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,400	1,424	158,900	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,700	1,730	193,010	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,118	124,764	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,100	2,133	238,003	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,000	1,011	112,855	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	900	906	101,146	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	850	854	95,349	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	750	753	84,079	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,200	2,195	244,870	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	600	520	58,072	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	809	90,343	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	204	22,820	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,050	1,073	119,788	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,329	148,241	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,000	1,014	113,134	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	700	706	78,828	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,200	3,214	358,545	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	899	100,378	2027/2/15

銘柄		当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	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 201231	2.375	1,300	1,336	149,046	2020/12/31	
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	1,030	1,050	117,156	2024/8/15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,670	297,891	2045/2/15	
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	872	97,303	2046/2/15	
	2.5 T-BOND 460515	2.5	600	550	61,423	2046/5/15	
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,650	1,700	189,691	2023/8/15	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,550	1,595	177,911	2024/5/15	
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	300	304	33,918	2018/4/30	
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,500	1,552	173,178	2020/8/15	
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,500	1,553	173,283	2020/11/15	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	450	439	49,008	2042/8/15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	950	926	103,396	2042/11/15	
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,000	1,025	114,415	2019/2/15	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,986	221,595	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,300	1,359	151,606	2024/2/15	
	2.875 T-BOND 430515	2.875	1,850	1,844	205,784	2043/5/15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,250	1,241	138,433	2045/8/15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	950	943	105,193	2046/11/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	200	204	22,823	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	1,500	1,529	170,577	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	1,700	1,730	193,040	2045/5/15	
	3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,220	136,179	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	240	244	27,258	2047/2/15	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	500	523	58,421	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	250	261	29,189	2042/2/15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,130	1,179	131,613	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,950	2,036	227,137	2044/8/15	
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	800	829	92,484	2019/5/15	
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,100	1,162	129,619	2021/5/15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,650	1,802	201,064	2044/5/15	
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	300	314	35,112	2019/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	350	392	43,824	2039/2/15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	848	94,603	2020/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,250	1,422	158,672	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,050	1,196	133,431	2044/2/15	
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	700	735	82,052	2019/8/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,050	1,112	124,102	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	1,500	1,609	179,505	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	500	579	64,686	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	800	930	103,746	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	1,800	1,866	208,230	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	550	649	72,451	2040/8/15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	600	615	68,688	2018/5/15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,344	149,946	2018/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	350	435	48,615	2039/5/15	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	4.25 T-BOND 401115	4.25	550	685	76,496	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	300	381	42,512	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	150	189	21,186	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	500	633	70,684	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	600	762	85,050	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	450	578	64,580	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	200	258	28,793	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	300	386	43,090	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	600	785	87,659	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	350	468	52,214	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	250	341	38,128	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	300	387	43,241	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	50	64	7,233	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	400	540	60,290	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	200	262	29,287	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,550	2,020	225,414	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	300	407	45,445	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	100	125	13,976	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	300	429	47,952	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	682	76,121	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	600	762	85,009	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	300	344	38,469	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	800	982	109,574	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	600	679	75,767	2019/2/15
小計					23,653,240	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	800	797	65,684	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	400	399	32,890	2018/11/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	200	195	16,132	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	600	598	49,348	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	400	398	32,827	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	750	745	61,423	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	100	99	8,230	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	150	143	11,816	2027/6/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	612	50,459	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	550	563	46,403	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	404	33,337	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	600	611	50,389	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	300	307	25,301	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	450	483	39,849	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	400	435	35,883	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	550	597	49,229	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	290	332	27,431	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	150	180	14,873	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	350	382	31,546	2021/6/1

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	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	300	324	26,733	2020/6/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	540	696	57,388	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,000	1,061	87,454	2019/6/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	510	689	56,841	2041/6/1	
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	700	725	59,804	2018/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	320	475	39,140	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	360	519	42,831	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	350	536	44,171	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	150	241	19,870	2027/6/1	
小 計					1,117,295		
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	9,250	10,788	64,192	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,200	2,776	16,520	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	2,800	2,746	16,343	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,900	6,578	39,142	2019/12/11	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	2,900	2,637	15,690	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,500	9,311	55,405	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	3,900	3,804	22,633	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	2,900	2,959	17,610	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,600	4,782	28,453	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,900	3,001	17,861	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,400	5,523	32,867	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	5,500	5,642	33,573	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	2,700	2,828	16,827	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	800	843	5,018	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	9,700	9,922	59,041	2018/12/13	
8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,200	2,422	14,411	2029/5/31		
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	3,200	3,534	21,032	2038/11/18		
小 計					476,625		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	700	681	85,095	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	750	763	95,337	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	700	713	89,087	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	100	101	12,723	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	350	356	44,443	2022/4/8
		0 SCHATS 180615	—	200	201	25,152	2018/6/15
		0.25 BUND 270215	0.25	50	49	6,172	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	500	510	63,763	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	300	308	38,488	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	650	672	83,899	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	750	769	96,087	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	700	715	89,344	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	900	966	120,647	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	950	1,018	127,133	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	700	716	89,471	2018/10/12

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 OBL 190222	1.0	900	926	115,679	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	550	602	75,210	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	900	989	123,511	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	550	606	75,644	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	550	610	76,144	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	830	103,595	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	550	618	77,231	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	600	667	83,335	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	511	63,773	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	600	656	81,912	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	550	614	76,734	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	800	889	110,975	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	620	811	101,243	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	630	831	103,717	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	850	946	118,140	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	600	662	82,634	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	600	693	86,561	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	490	720	89,919	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	700	762	95,132	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	700	750	93,712	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	700	1,087	135,672	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	800	844	105,435	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	400	658	82,225	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	100	146	18,283	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	590	962	120,165	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	500	884	110,392	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	550	900	112,342	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	600	925	115,524	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	200	284	35,486	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	300	508	63,451	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	350	564	70,408	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	100	100	12,527	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	100	100	12,552	2018/5/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	98	12,340	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	500	62,425	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	200	202	25,271	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	288	36,038	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	405	50,617	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	400	397	49,591	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	409	51,105	2019/12/1
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	300	305	38,090	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	300	281	35,179	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	461	57,596	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	200	205	25,613	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	600	619	77,334	2019/8/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	500	492	61,416	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	486	60,754	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	480	433	54,124	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	550	557	69,553	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	600	640	79,918	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	200	201	25,153	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	350	323	40,404	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	50	48	6,088	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	700	734	91,688	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	650	690	86,113	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	360	44,942	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	210	177	22,159	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	450	454	56,761	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	650	675	84,321	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,100	1,161	144,932	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	900	1,006	125,601	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,100	1,239	154,709	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	550	621	77,517	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	800	907	113,243	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	550	632	78,893	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	750	841	104,976	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	750	880	109,826	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,200	1,288	160,805	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	450	493	61,532	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	950	1,057	131,938	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	900	951	118,740	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	700	757	94,472	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	700	781	97,536	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	900	1,074	134,049	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	650	778	97,188	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	700	847	105,816	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,050	1,235	154,205	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	900	1,092	136,374	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	746	93,197	2028/9/1
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	571	71,312	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 220301	5.0	700	837	104,558	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	750	931	116,269	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,500	1,961	244,797	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	650	855	106,725	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	680	886	110,631	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,000	1,307	163,213	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	600	741	92,496	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	920	1,139	142,177	2022/11/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	820	1,156	144,262	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,125	140,388	2027/11/1		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	600	873	108,986	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	442	55,221	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 190225	—	200	201	25,197	2019/2/25
		0 O.A.T 200525	—	550	557	69,564	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	400	404	50,512	2021/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	600	613	76,562	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	620	592	73,957	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	700	717	89,552	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,450	1,456	181,804	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	400	395	49,301	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	200	203	25,354	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,100	1,125	140,477	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	700	721	90,037	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	650	674	84,230	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	250	254	31,781	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	400	384	47,919	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	850	886	110,600	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	1,200	1,323	165,169	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	970	1,072	133,814	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	250	257	32,130	2039/6/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	950	1,069	133,510	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	600	684	85,442	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	1,150	1,265	157,942	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,050	1,231	153,714	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	1,020	1,215	151,621	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	1,250	1,446	180,475	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	1,400	1,618	202,003	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	700	924	115,314	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	1,350	1,507	188,151	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,750	2,195	273,928	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	1,200	1,325	165,392	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,600	1,859	232,029	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	470	682	85,186	2038/10/25
4 O.A.T 550425	4.0	400	620	77,440	2055/4/25		
4 O.A.T 600425	4.0	560	884	110,393	2060/4/25		
4.25 O.A.T 181025	4.25	1,100	1,176	146,754	2018/10/25		
4.25 O.A.T 190425	4.25	1,200	1,311	163,666	2019/4/25		
4.25 O.A.T 231025	4.25	1,400	1,773	221,286	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	1,280	2,006	250,442	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	1,060	1,633	203,892	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	900	1,365	170,422	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	760	1,248	155,741	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	700	1,022	127,580	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	300	366	45,691	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	350	526	65,743	2023/4/25		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	250	253	31,623	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	500	511	63,813	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	399	49,881	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	460	463	57,875	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	150	152	19,052	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	412	51,505	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	389	48,595	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	500	568	70,934	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	451	56,395	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	400	496	61,910	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	380	520	64,930	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	500	576	71,997	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	600	677	84,519	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	550	672	83,947	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	470	733	91,562	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	300	316	39,457	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	600	660	82,362	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	450	693	86,536	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	400	605	75,600	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	250	251	31,378	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	100	100	12,593	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	100	100	12,530	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	720	89,866	2021/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	300	296	36,990	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	800	835	104,204	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	850	879	109,734	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,050	1,101	137,453	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	670	668	83,442	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	500	534	66,678	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	400	423	52,884	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	730	820	102,328	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	350	352	43,999	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	158	19,779	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,200	1,272	158,763	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	717	89,542	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,100	1,234	154,015	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	900	947	118,234	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	630	799	99,779	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	600	666	83,136	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	600	739	92,270	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	663	82,848	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	700	886	110,680	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	580	788	98,444	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	630	78,663	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	500	584	72,964	2020/10/31

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	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	500	695	86,778	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	677	84,521	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	170	245	30,665	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	800	1,019	127,265	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	800	973	121,532	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	650	957	119,541	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	800	1,010	126,076	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	250	346	43,289	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	900	1,303	162,725	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	800	825	102,979	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	200	200	25,076	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	50	51	6,475	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	320	314	39,229	2031/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	210	200	24,995	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	20	20	2,539	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	569	71,119	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	100	106	13,277	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	584	72,950	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	300	325	40,575	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	150	190	23,726	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	750	856	106,883	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	340	494	61,717	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	600	651	81,238	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	600	724	90,468	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	250	348	43,497	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	420	52,435	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	400	494	61,764	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	660	1,014	126,621	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	541	67,516	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	640	1,024	127,798	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	600	900	112,386	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	147	18,467	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	356	44,525	2026/10/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	200	213	26,687	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	50	49	6,158	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	350	387	48,299	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	333	41,616	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	400	420	52,533	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	150	180	22,550	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	230	317	39,597	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	358	44,728	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	450	524	65,487	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	400	476	59,436	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	150	249	31,122	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	450	512	63,932	2020/7/15

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	
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	380	576	71,955	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	600	653	81,596	2019/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	417	52,047	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	200	314	39,222	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	49	6,221	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	250	256	32,036	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	100	100	12,568	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	150	147	18,400	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	209	26,083	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	100	102	12,771	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	272	34,065	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	200	218	27,308	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	100	113	14,105	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	130	169	21,142	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	160	196	24,505	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	170	189	23,610	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	172	21,559	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	200	260	32,518	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	200	221	27,588	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	208	26,041	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	100	101	12,672	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	302	37,724	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	300	340	42,456	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	301	37,613	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	183	22,857	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	200	220	27,495	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	300	321	40,063	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	350	399	49,896	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	250	295	36,915	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	615	76,817	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	200	230	28,789	2019/10/18		
小 計						21,616,258	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1.25 GILT 180722	1.25	700	709	102,699	2018/7/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	50	50	7,299	2027/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	350	365	52,959	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	400	416	60,338	2026/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	900	932	134,933	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	750	799	115,790	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	100	100	14,561	2037/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	850	898	130,111	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	900	980	142,003	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	750	825	119,562	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	462	66,925	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	600	685	99,201	2024/9/7	

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	3.25 GILT 440122	3.25	780	1,026	148,576	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	420	580	84,076	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	940	1,588	230,020	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	450	487	70,622	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	750	838	121,425	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	550	631	91,418	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	520	814	117,897	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	600	704	101,921	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	240	422	61,129	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	300	394	57,083	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	600	825	119,479	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	790	1,124	162,818	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	370	543	78,636	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	700	1,041	150,731	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	750	1,187	171,830	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	810	1,332	192,824	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	310	547	79,189	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	700	755	109,361	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	410	591	85,591	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	430	675	97,836	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	500	564	81,768	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	420	597	86,517	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	490	761	110,202	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	450	593	85,934	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	380	578	83,813	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	500	656	95,037	2021/6/7
小	計					3,922,132	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	130	144	16,502	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	164	18,844	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	118	13,575	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	150	189	21,702	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	170	245	28,162	2028/4/8
小	計					98,788	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	2,000	2,090	26,698	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,450	2,669	34,095	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,950	2,287	29,207	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	3,050	3,609	46,099	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,300	1,787	22,824	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	2,750	2,998	38,287	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	2,900	3,459	44,179	2020/12/1
小	計					241,390	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	1,050	1,057	14,071	2026/2/19

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	
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1,350	1,391	18,515	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	500	510	6,798	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	1,850	1,944	25,885	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	1,400	1,562	20,797	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	2,500	2,785	37,068	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	2,100	2,264	30,134	2019/5/22
小	計				153,271	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	1,000	1,012	16,966	2018/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	500	492	8,257	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1,300	1,421	23,830	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	2,800	3,132	52,502	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	2,900	3,323	55,702	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	3,300	3,663	61,394	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	3,950	6,584	110,363	2039/11/15
小	計				329,017	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	700	686	20,417	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	600	580	17,273	2021/7/25
		2 POLAND 210425	1,000	980	29,173	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	500	488	14,545	2022/4/25
		2.5 POLAND 180725	900	909	27,067	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	1,100	1,035	30,816	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	350	325	9,675	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	800	821	24,436	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	1,000	1,009	30,038	2025/7/25
		4 POLAND 231025	850	902	26,845	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	900	984	29,288	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	600	648	19,290	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	700	790	23,523	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	750	858	25,538	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	370	457	13,609	2029/4/25
		POLAND 181025	300	292	8,701	2018/10/25
小	計				350,241	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	700	697	57,937	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	400	400	33,245	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 280521	150	145	12,052	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	750	768	63,840	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	800	824	68,460	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	500	509	42,287	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	250	253	21,035	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	200	191	15,890	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	260	238	19,763	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	800	850	70,652	2025/4/21

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		
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	千円		
国債証券	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	810	859	71,394	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	70	70	5,816	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	330	359	29,876	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,000	1,145	95,071	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	870	937	77,848	2020/4/15	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	370	445	36,994	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,198	99,482	2027/4/21	
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,000	1,064	88,401	2019/3/15	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	771	64,028	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	850	975	80,978	2021/5/15	
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	885	73,545	2022/7/15	
小 計					1,128,604		
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	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	50	50	4,055	2019/10/1	
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,300	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	70	70	5,688	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	290	297	23,955	2021/6/1	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	220	225	18,160	2019/6/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	180	190	15,284	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	170	181	14,585	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	30	32	2,576	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	80	85	6,895	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	160	171	13,776	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	250	268	21,590	2024/9/1	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	190	204	16,416	2022/9/1	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	170	180	14,487	2020/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	70	79	6,419	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	224	18,062	2027/3/1	
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	160	165	13,346	2018/9/1	
小 計					207,601		
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	350	345	8,933	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	400	393	10,185	2023/3/15	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	300	299	7,751	2020/3/31	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	281	7,281	2027/5/31	
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	200	199	5,174	2021/11/30	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	95	2,470	2028/6/15	
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	100	100	2,608	2019/3/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	400	401	10,380	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	299	7,744	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	187	4,863	2033/4/15	
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	450	454	11,765	2020/7/31	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	441	11,429	2027/3/15	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	498	12,897	2025/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	600	610	15,787	2021/9/30	

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			
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	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	195	5,049	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	400	408	10,562	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	500	507	13,135	2024/7/15	
	4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	200	197	5,098	2031/6/30	
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	194	5,026	2035/5/31	
	4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	900	919	23,793	2019/11/29	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	307	7,969	2026/4/15	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	506	13,099	2030/4/15	
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	100	99	2,578	2046/3/15	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	300	303	7,861	2043/9/30	
	5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	300	314	8,135	2019/7/30	
小計					221,582		
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	5,850	6,540	55,072	2026/12/21	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	2,650	1,915	16,132	2036/3/31	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	2,700	1,922	16,186	2041/2/28	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,700	1,652	13,915	2021/3/31	
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,300	2,748	23,141	2031/2/28	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,300	2,290	19,288	2020/1/15	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,100	2,070	17,435	2023/2/28	
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	300	302	2,547	2018/12/21	
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,474	20,835	2030/1/31	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	2,300	2,112	17,783	2032/3/31	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,400	3,086	25,986	2037/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,700	2,456	20,679	2044/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,100	3,720	31,325	2048/2/28	
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	760	6,404	2035/2/28	
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	700	657	5,534	2040/1/31	
小計					292,268		
合計					53,808,318		

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

○投資信託財産の構成

(2017年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 53,808,318	% 98.4
コール・ローン等、その他	872,615	1.6
投資信託財産総額	54,680,933	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(54,562,124千円)の投資信託財産総額(54,680,933千円)に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=111.54円	1 カナダドル=82.39円	1 メキシコペソ=5.95円	1 ユーロ=124.79円
1 イギリスポンド=144.76円	1 スイスフラン=114.49円	1 スウェーデンクローネ=12.77円	1 ノルウェークローネ=13.31円
1 デンマーククローネ=16.76円	1 ポーランドズロチ=29.76円	1 オーストラリアドル=83.03円	1 シンガポールドル=80.41円
1 マレーシアリングgit=25.88円	1 南アフリカランド=8.42円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	54,871,368,159
コール・ローン等	278,869,388
公社債(評価額)	53,808,318,253
未収入金	361,790,420
未収利息	408,456,394
前払費用	13,933,704
(B) 負債	437,766,185
未払金	191,192,100
未払解約金	246,573,888
未払利息	197
(C) 純資産総額(A-B)	54,433,601,974
元本	21,000,747,916
次期繰越損益金	33,432,854,058
(D) 受益権総口数	21,000,747,916口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,920円

<注記事項>

- ①期首元本額 28,604,779,095円
 期中追加設定元本額 2,130,531,386円
 期中一部解約元本額 9,734,562,565円
 また、1口当たり純資産額は、期末25,920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)

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	152,623,703円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	288,673,852円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	177,787,633円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,558,150,498円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,251,110,470円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,031,169,817円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,820,246,396円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	613,153,868円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	88,430,177円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	169,285,305円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,081,266,693円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	446,761,815円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,321,960,372円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	7,134,634,663円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	5,172円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	230,408円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	44,151,505円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	821,105,569円
合計	21,000,747,916円

【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2016年7月1日)

○損益の状況 (2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,593,695,114
受取利息	1,593,903,748
その他収益金	76,278
支払利息	△ 284,912
(B) 有価証券売買損益	△ 1,569,972,907
売買益	1,498,481,065
売買損	△ 3,068,453,972
(C) 保管費用等	△ 21,593,843
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,128,364
(E) 前期繰越損益金	44,954,999,186
(F) 追加信託差損益金	3,177,943,719
(G) 解約差損益金	△14,702,217,211
(H) 計(D+E+F+G)	33,432,854,058
次期繰越損益金(H)	33,432,854,058

- (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。