

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、FTSE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130期（決算日：2018年2月19日）  
 第131期（決算日：2018年3月19日）  
 第132期（決算日：2018年4月17日）  
 第133期（決算日：2018年5月17日）  
 第134期（決算日：2018年6月18日）  
 第135期（決算日：2018年7月17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17日に第135期の決算を行いましたので、法令に基づいて第130期～第135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  
 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30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債組入比率	債券先物比	純資産総額
		税込配	み金	期騰落	期騰落	中率			
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円
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	
124期(2017年8月17日)	8,999	16	△0.4	450.4740	△0.2	98.7	—	1,160	
125期(2017年9月19日)	9,184	16	2.2	459.1367	1.9	98.7	—	1,182	
126期(2017年10月17日)	9,153	16	△0.2	456.4440	△0.6	98.6	—	1,160	
127期(2017年11月17日)	9,187	16	0.5	460.2502	0.8	98.7	—	1,153	
128期(2017年12月18日)	9,201	16	0.3	462.6856	0.5	98.7	—	1,152	
129期(2018年1月17日)	9,125	16	△0.7	460.2736	△0.5	98.6	—	1,144	
130期(2018年2月19日)	8,733	16	△4.1	440.8681	△4.2	97.5	—	1,094	
131期(2018年3月19日)	8,677	16	△0.5	440.6969	△0.0	98.7	—	1,096	
132期(2018年4月17日)	8,844	16	2.1	450.0113	2.1	98.6	—	1,120	
133期(2018年5月17日)	8,759	16	△0.8	445.7247	△1.0	98.6	—	1,109	
134期(2018年6月18日)	8,713	16	△0.3	445.4520	△0.1	98.6	—	1,093	
135期(2018年7月17日)	8,931	16	2.7	457.1589	2.6	98.8	—	1,122	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

(注) 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		FTSE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		
第130期	(期 首) 2018年1月17日	円 9,125	% —	460.2736	% —	% 98.6	% —
	1月末	8,993	△1.4	453.8055	△1.4	99.8	—
	(期 末) 2018年2月19日	8,749	△4.1	440.8681	△4.2	97.5	—
第131期	(期 首) 2018年2月19日	8,733	—	440.8681	—	97.5	—
	2月末	8,741	0.1	443.2113	0.5	98.9	—
	(期 末) 2018年3月19日	8,693	△0.5	440.6969	△0.0	98.7	—
第132期	(期 首) 2018年3月19日	8,677	—	440.6969	—	98.7	—
	3月末	8,778	1.2	445.8746	1.2	96.8	—
	(期 末) 2018年4月17日	8,860	2.1	450.0113	2.1	98.6	—
第133期	(期 首) 2018年4月17日	8,844	—	450.0113	—	98.6	—
	4月末	8,863	0.2	450.7869	0.2	98.8	—
	(期 末) 2018年5月17日	8,775	△0.8	445.7247	△1.0	98.6	—
第134期	(期 首) 2018年5月17日	8,759	—	445.7247	—	98.6	—
	5月末	8,612	△1.7	439.0315	△1.5	99.4	—
	(期 末) 2018年6月18日	8,729	△0.3	445.4520	△0.1	98.6	—
第135期	(期 首) 2018年6月18日	8,713	—	445.4520	—	98.6	—
	6月末	8,718	0.1	444.9739	△0.1	98.3	—
	(期 末) 2018年7月17日	8,947	2.7	457.1589	2.6	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入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について（第130期～第135期：2018/1/18～2018/7/17）

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ1.1%（分配金再投資ベース）の下落となりました。
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（-0.7%）を0.4%下回りました。



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

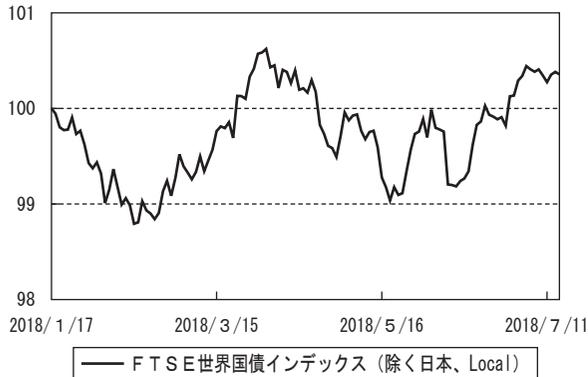
**!** 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>米国の堅調な景気認識や利上げなどから、米ドル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。</li> <li>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。</li> </ul>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>イタリアの政局不安の高まりなどから、ユーロ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。</li> </ul>

## 投資環境について

（第130期～第135期：2018/1/18～2018/7/17）

債券市況の推移  
（当作成期首を100として指数化）

## ◎債券市況

・イタリアの政局不安を受けて、同国の債券市況が下落した一方、米国の保護主義的な通商政策によるリスク回避姿勢の高まりを受けて、多くの国の債券市況は上昇しました。結果、当作成期首との比較では、先進国の債券市況は上昇しました。

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、米国の堅調な景気認識や利上げなどが上昇要因となり、当作成期首との比較では、上昇しました。

・円・ユーロ相場は、イタリアの政局不安の高まりなどが下落要因となり、当作成期首との比較では、下落しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

**i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

## ＜三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）＞

- ・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FTSE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0.7%の下落となりました。

- ・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FTSE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（2018年1月17日）

作成期末（2018年7月17日）

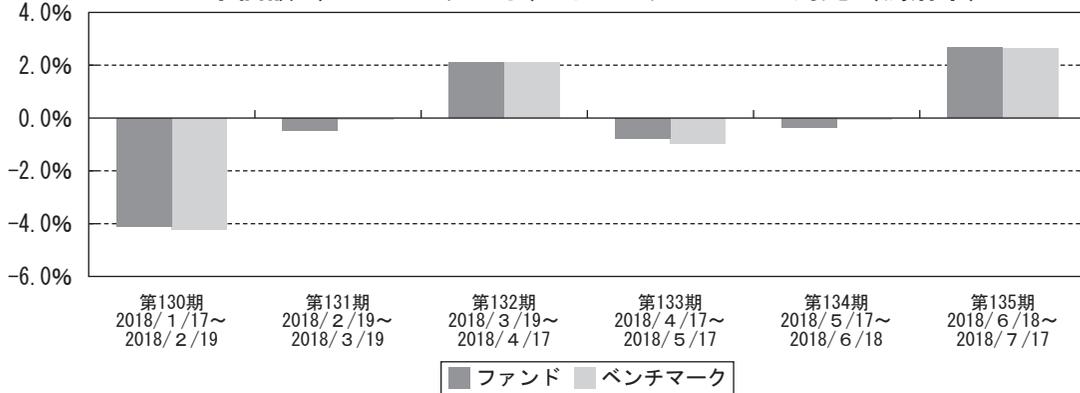
最終利回り	1.6%	➡	最終利回り	1.8%
直接利回り	2.5%		直接利回り	2.5%
デュレーション	7.1年		デュレーション	7.1年

- ・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130期～第135期：2018/1/18～2018/7/17）

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

### 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）>

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.4\%$ 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 $0.0\%$ 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 $0.7\%$ の下落となったため、カイ離は $0.0\%$ 程度となりました。  
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・評価時価差異要因※

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

（主なマイナス要因）

・取引コスト要因

## 分配金について

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

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、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130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
当期分配金	16	16	16	16	16	16
（対基準価額比率）	0.183%	0.184%	0.181%	0.182%	0.183%	0.179%
当期の収益	13	11	16	12	12	16
当期の収益以外	2	4	—	3	3	—
翌期繰越分配対象額	1,819	1,814	1,815	1,812	1,808	1,810

（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 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

(2018年1月18日～2018年7月17日)

項 目	第130期～第135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)	(0.215)	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)	(0.161)	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	1	0.016	(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 )	( 1 )	(0.014)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( 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	36	0.419	
作成期中の平均基準価額は、8,784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

(2018年1月18日～2018年7月17日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第130期～第135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 12,209	千円 31,931	千口 17,610	千円 46,245

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年1月18日～2018年7月17日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;三菱UFJ 外国債券マザーファンド&gt;

区 分	第130期～第135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 3,522	百万円 202	% 5.7	百万円 5,193	百万円 218	% 4.2

平均保有割合 2.3%

※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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2018年7月17日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	第129期末	第135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 423,075	千口 417,673	千円 1,122,122

## ○投資信託財産の構成

（2018年7月17日現在）

項 目	第135期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千円 1,122,122	% 99.7
コール・ローン等、その他	3,256	0.3
投資信託財産総額	1,125,378	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（49,596,369千円）の投資信託財産総額（49,639,046千円）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=112.44円	1 カナダドル=85.60円	1 メキシコペソ=5.97円	1 ユーロ=131.68円
1 イギリスポンド=148.81円	1 スイスフラン=112.78円	1 スウェーデンクローネ=12.76円	1 ノルウェークローネ=13.90円
1 デンマーククローネ=17.66円	1 ポーランドズロチ=30.59円	1 オーストラリアドル=83.35円	1 シンガポールドル=82.54円
1 マレーシアリングギット=27.80円	1 南アフリカランド=8.51円		

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第130期末	第131期末	第132期末	第133期末	第134期末	第135期末
	2018年2月19日現在	2018年3月19日現在	2018年4月17日現在	2018年5月17日現在	2018年6月18日現在	2018年7月17日現在
(A) 資産	円 1,097,074,994	円 1,099,278,520	円 1,123,474,176	円 1,112,890,252	円 1,096,020,848	円 1,125,378,907
コール・ローン等	1,883,592	919,350	1,102,046	1,633,195	1,105,826	1,679,793
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,093,836,802	1,096,081,170	1,120,150,330	1,109,452,657	1,092,782,922	1,122,122,014
未収入金	1,354,600	2,278,000	2,221,800	1,804,400	2,132,100	1,577,100
(B) 負債	2,844,835	2,801,449	2,974,555	3,092,363	2,845,910	2,825,895
未払収益分配金	2,004,819	2,021,900	2,027,115	2,027,185	2,007,498	2,010,973
未払解約金	8,755	91,746	228,323	316,591	50,268	101,687
未払信託報酬	826,641	683,982	715,121	744,425	783,766	709,270
未払利息	2	1	2	2	2	3
その他未払費用	4,618	3,820	3,994	4,160	4,376	3,962
(C) 純資産総額(A-B)	1,094,230,159	1,096,477,071	1,120,499,621	1,109,797,889	1,093,174,938	1,122,553,012
元本	1,253,012,277	1,263,688,117	1,266,947,248	1,266,991,208	1,254,686,433	1,256,858,508
次期繰越損益金	△ 158,782,118	△ 167,211,046	△ 146,447,627	△ 157,193,319	△ 161,511,495	△ 134,305,496
(D) 受益権総口数	1,253,012,277口	1,263,688,117口	1,266,947,248口	1,266,991,208口	1,254,686,433口	1,256,858,508口
1万円当たり基準価額(C/D)	8,733円	8,677円	8,844円	8,759円	8,713円	8,931円

## ○損益の状況

項 目	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 26	△ 33	△ 23	△ 30	△ 36	△ 29
支払利息	△ 26	△ 33	△ 23	△ 30	△ 36	△ 29
(B) 有価証券売買損益	△ 46,256,057	△ 4,366,484	23,885,191	△ 7,945,158	△ 3,012,151	30,182,250
売買益	103,778	19,208	23,977,885	24,018	51,276	30,290,146
売買損	△ 46,359,835	△ 4,385,692	△ 92,694	△ 7,969,176	△ 3,063,427	△ 107,896
(C) 信託報酬等	△ 831,259	△ 687,802	△ 719,115	△ 748,585	△ 788,142	△ 713,232
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 47,087,342	△ 5,054,319	23,166,053	△ 8,693,773	△ 3,800,329	29,468,989
(E) 前期繰越損益金	35,063,008	△ 13,934,564	△ 20,941,711	195,710	△ 10,348,724	△ 16,090,940
(F) 追加信託差損益金	△ 144,752,965	△ 146,200,263	△ 146,644,854	△ 146,668,071	△ 145,354,944	△ 145,672,572
(配当等相当額)	( 80,059,876)	( 83,008,023)	( 84,086,388)	( 85,224,075)	( 85,421,627)	( 86,396,602)
(売買損益相当額)	(△ 224,812,841)	(△ 229,208,286)	(△ 230,731,242)	(△ 231,892,146)	(△ 230,776,571)	(△ 232,069,174)
(G) 計 (D + E + F)	△ 156,777,299	△ 165,189,146	△ 144,420,512	△ 155,166,134	△ 159,503,997	△ 132,294,523
(H) 収益分配金	△ 2,004,819	△ 2,021,900	△ 2,027,115	△ 2,027,185	△ 2,007,498	△ 2,010,973
次期繰越損益金 (G + H)	△ 158,782,118	△ 167,211,046	△ 146,447,627	△ 157,193,319	△ 161,511,495	△ 134,305,496
追加信託差損益金	△ 144,752,965	△ 146,200,263	△ 146,644,854	△ 146,668,071	△ 145,354,944	△ 145,672,572
(配当等相当額)	( 80,068,357)	( 83,013,809)	( 84,092,663)	( 85,230,048)	( 85,428,873)	( 86,401,032)
(売買損益相当額)	(△ 224,821,322)	(△ 229,214,072)	(△ 230,737,517)	(△ 231,898,119)	(△ 230,783,817)	(△ 232,073,604)
分配準備積立金	147,909,714	146,333,922	145,963,055	144,367,230	141,541,141	141,106,373
繰越損益金	△ 161,938,867	△ 167,344,705	△ 145,765,828	△ 154,892,478	△ 157,697,692	△ 129,739,297

(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。

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首（前作成期末）元本額 1,254,132,617円  
 作成期中追加設定元本額 61,306,139円  
 作成期中一部解約元本額 58,580,248円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8931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134,305,496円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2018年1月18日～ 2018年2月19日	2018年2月20日～ 2018年3月19日	2018年3月20日～ 2018年4月17日	2018年4月18日～ 2018年5月17日	2018年5月18日～ 2018年6月18日	2018年6月19日～ 2018年7月17日
費用控除後の配当等収益額	1,683,080円	1,443,366円	2,137,318円	1,554,764円	1,602,668円	2,151,006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	80,068,357円	83,013,809円	84,092,663円	85,230,048円	85,428,873円	86,401,032円
分配準備積立金額	148,231,453円	146,912,456円	145,852,852円	144,839,651円	141,945,971円	140,966,340円
当ファンドの分配対象収益額	229,982,890円	231,369,631円	232,082,833円	231,624,463円	228,977,512円	229,518,378円
1万円当たり収益分配対象額	1,835円	1,830円	1,831円	1,828円	1,824円	1,826円
1万円当たり分配金額	16円	16円	16円	16円	16円	16円
収益分配金金額	2,004,819円	2,021,900円	2,027,115円	2,027,185円	2,007,498円	2,010,973円

## ○分配金のお知らせ

	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135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（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

## 【お知らせ】

①使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

（2018年4月17日）

②本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、FTSE債券インデックスの名称に変更しています。

③2014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18期》決算日2018年5月21日

[計算期間：2017年5月23日～2018年5月21日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月21日に第18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18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（FTSE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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
18期(2018年5月21日)	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—	48,418

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (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) 2017年5月22日	円	%		%	%	%
	25,920	—	441.3251	—	98.9	—
5月末	25,826	△0.4	439.8327	△0.3	98.7	—
6月末	26,313	1.5	450.1506	2.0	98.6	—
7月末	26,299	1.5	450.0978	2.0	98.8	—
8月末	26,673	2.9	453.5060	2.8	98.2	—
9月末	26,972	4.1	459.0498	4.0	99.0	—
10月末	26,974	4.1	459.2160	4.1	99.5	—
11月末	26,996	4.2	458.9704	4.0	99.9	—
12月末	27,333	5.5	464.6154	5.3	98.3	—
2018年1月末	26,659	2.9	453.8055	2.8	99.8	—
2月末	25,975	0.2	443.2113	0.4	98.9	—
3月末	26,149	0.9	445.8746	1.0	96.8	—
4月末	26,466	2.1	450.7869	2.1	98.8	—
(期 末) 2018年5月21日	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.2%)を0.3%上回りました。

## 基準価額等の推移



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

## ●投資環境について

## ◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、米国のインフレが加速するとの観測が高まったことなどを背景に下落しました。

## ◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、欧米長期金利の上昇を嫌気したリスク回避姿勢の高まりなどから米ドルが対円で売られる局面と、その後、北朝鮮を巡る地政学リスクの後退などを背景に米ドルが対円で買われる局面がありました。期首との比較では、米ドルは対円で0.4%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、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や欧州経済の回復期待などを背景にユーロが対円で買われました。期首との比較では、ユーロは対円で4.6%上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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1.2%の上昇となったため、乖離は0.3%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 との乖離	0.0%程度	△0.0%程度	0.3%程度	0.3%程度

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

## ◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

## ◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カ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0.3%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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.033	(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)	(0.033)	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	0.033	
期中の平均基準価額は、26,552円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



## ○利害関係人との取引状況等

(2017年5月23日～2018年5月21日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 1,870	% 32.6		百万円 5,744	% 45.9	

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2018年5月21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 191,080	千アメリカドル 186,756	千円 20,746,825	% 42.8	% —	% 17.6	% 17.6	% 7.6
カナダ	千カナダドル 11,380	千カナダドル 11,786	1,016,145	2.1	—	0.9	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 66,650	千メキシコペソ 66,705	372,214	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,360	25,823	3,369,736	7.0	—	4.0	2.1	0.9
イタリア	31,960	35,770	4,667,745	9.6	—	5.6	3.0	1.1
フランス	31,970	37,794	4,931,744	10.2	—	6.7	2.5	1.0
オランダ	6,870	7,970	1,040,115	2.1	—	1.3	0.6	0.2
スペイン	19,030	22,243	2,902,500	6.0	—	3.9	1.3	0.9
ベルギー	7,580	9,292	1,212,613	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	4,900	5,773	753,427	1.6	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	2,180	2,360	308,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	2,690	3,018	393,876	0.8	—	0.5	0.1	0.2
イギリス	千イギリスポンド 17,870	千イギリスポンド 22,265	3,328,396	6.9	—	5.1	1.4	0.4
スイス	千スイスフラン 620	千スイスフラン 727	80,878	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 12,890	千スウェーデンクローネ 14,581	184,888	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,200	千ノルウェークローネ 10,560	144,570	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 13,300	千デンマーククローネ 16,247	284,649	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 9,700	千ポーランドズロチ 9,991	303,047	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,660	千オーストラリアドル 12,194	1,017,894	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,340	千シンガポールドル 2,373	196,194	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリングギット 8,130	千マレーシアリングギット 8,002	223,580	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 37,200	千南アフリカランド 34,025	295,682	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	47,774,800	98.7	—	52.6	32.3	13.8

(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	0.75 T-NOTE 190715	0.75	700	687	76,329	2019/7/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	300	294	32,730	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	900	881	97,946	2019/9/15
	1 T-NOTE 190831	1.0	300	294	32,729	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	700	686	76,259	2019/9/30
	1 T-NOTE 191115	1.0	1,250	1,223	135,884	2019/11/15
	1 T-NOTE 191130	1.0	900	880	97,762	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	600	587	65,211	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	50	48	5,403	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	670	74,488	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	1,600	1,523	169,203	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,700	1,615	179,469	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,041	115,745	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	450	445	49,492	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	700	687	76,420	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,100	1,077	119,650	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	97	10,860	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	863	95,973	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	1,300	1,234	137,173	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	300	276	30,666	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 200115	1.375	800	785	87,250	2020/1/15
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,000	981	109,007	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	950	930	103,408	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	100	97	10,872	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,026	114,019	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,150	2,098	233,152	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	900	875	97,215	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,842	204,689	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,250	1,207	134,132	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,450	1,345	149,427	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	1,700	1,572	174,644	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	877	97,455	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	750	743	82,604	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,700	3,648	405,365	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	492	54,718	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,400	2,353	261,398	2020/4/15
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	1,000	979	108,794	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	550	538	59,796	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	3,000	2,931	325,654	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 200815	1.5	600	585	65,052	2020/8/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	190	21,204	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,400	1,312	145,769	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,600	1,418	157,595	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,092	121,406	2019/4/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,800	1,785	198,337	2019/6/30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	650	644	71,554	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	600	593	65,974	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,000	986	109,553	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 200315	1.625	2,100	2,065	229,507	2020/3/15
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	250	244	27,188	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201015	1.625	1,300	1,269	140,992	2020/10/15
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	850	828	92,014	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	350	332	36,986	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,500	3,318	368,614	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,050	988	109,846	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	981	109,026	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,650	1,488	165,355	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,950	1,753	194,742	2026/5/15
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	495	55,024	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,000	978	108,703	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	750	732	81,364	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,496	166,203	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	96	10,686	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	912	101,413	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	400	383	42,648	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	3,050	2,926	325,059	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,534	170,425	2022/5/31
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,550	1,479	164,387	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	808	89,771	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	900	852	94,685	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	726	80,759	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,641	182,331	2022/3/31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	96	10,704	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	1,500	1,442	160,256	2022/7/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	720	80,043	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,800	1,726	191,776	2022/10/31
		2 T-NOTE 200131	2.0	1,700	1,685	187,252	2020/1/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	250	246	27,410	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	3,450	3,399	377,661	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	450	442	49,170	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	700	686	76,304	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	600	587	65,227	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,073	119,268	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,071	119,058	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,461	162,325	2021/11/15
		2 T-NOTE 211231	2.0	450	437	48,619	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,165	129,496	2022/2/15	
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,800	2,691	298,950	2023/2/15	
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,650	1,561	173,503	2024/5/31	

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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2 T-NOTE 250215	2.0	2,500	2,346	260,649	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,750	3,499	388,793	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	900	828	92,021	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	98	10,944	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,128	125,418	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,700	1,666	185,134	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,076	119,640	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,900	1,855	206,173	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,016	112,890	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	900	862	95,864	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	700	669	74,348	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	550	525	58,364	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	2,050	1,951	216,739	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	500	471	52,420	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	864	96,003	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	197	21,938	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	887	98,645	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,279	142,171	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	800	771	85,705	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,350	1,300	144,488	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,950	2,820	313,301	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	843	93,693	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	1,000	933	103,712	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	2,200	2,050	227,805	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	200	198	22,046	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 210415	2.375	2,300	2,278	253,121	2021/4/15
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	1,450	1,399	155,518	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	2,350	2,221	246,825	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,600	2,271	252,323	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	827	91,890	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	550	478	53,127	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,650	1,617	179,646	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,461	162,364	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,200	1,200	133,328	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,350	1,348	149,819	2020/11/15
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,250	1,219	135,510	2025/3/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	450	416	46,319	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	700	647	71,894	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,200	1,095	121,716	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	450	410	45,616	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,883	209,224	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,300	1,286	142,938	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	600	583	64,826	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	1,200	1,133	125,892	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,150	1,081	120,128	2045/8/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.875	T-BOND 461115	2.875	950	890	98,939	2046/11/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	200	193	21,516	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	1,750	1,686	187,375	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	1,700	1,637	181,933	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	1,200	1,155	128,381	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	500	480	53,401	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	750	720	80,049	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	450	432	47,998	2048/2/15
		3.125	T-BOND 411115	3.125	350	346	38,489	2041/11/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	100	98	10,990	2042/2/15
		3.125	T-BOND 430215	3.125	550	543	60,340	2043/2/15
		3.125	T-BOND 440815	3.125	1,850	1,824	202,658	2044/8/15
		3.125	T-NOTE 190515	3.125	800	806	89,542	2019/5/15
		3.125	T-NOTE 210515	3.125	750	758	84,248	2021/5/15
		3.375	T-BOND 440515	3.375	780	803	89,283	2044/5/15
		3.375	T-NOTE 191115	3.375	300	303	33,739	2019/11/15
		3.5	T-BOND 390215	3.5	300	315	35,092	2039/2/15
		3.5	T-NOTE 200515	3.5	800	814	90,444	2020/5/15
		3.625	T-BOND 430815	3.625	950	1,019	113,244	2043/8/15
		3.625	T-BOND 440215	3.625	950	1,020	113,343	2044/2/15
		3.625	T-NOTE 190815	3.625	700	710	78,899	2019/8/15
		3.625	T-NOTE 200215	3.625	1,050	1,069	118,799	2020/2/15
		3.625	T-NOTE 210215	3.625	2,650	2,714	301,587	2021/2/15
		3.75	T-BOND 410815	3.75	450	491	54,606	2041/8/15
		3.75	T-BOND 431115	3.75	850	930	103,397	2043/11/15
		3.875	T-BOND 400815	3.875	500	556	61,776	2040/8/15
		4.25	T-BOND 390515	4.25	300	350	38,917	2039/5/15
		4.25	T-BOND 401115	4.25	500	585	65,083	2040/11/15
		4.375	T-BOND 380215	4.375	150	177	19,672	2038/2/15
		4.375	T-BOND 391115	4.375	150	178	19,807	2039/11/15
		4.375	T-BOND 400515	4.375	500	595	66,137	2040/5/15
		4.375	T-BOND 410515	4.375	450	537	59,707	2041/5/15
		4.5	T-BOND 360215	4.5	400	474	52,729	2036/2/15
		4.5	T-BOND 380515	4.5	200	240	26,684	2038/5/15
		4.5	T-BOND 390815	4.5	400	482	53,642	2039/8/15
		4.625	T-BOND 400215	4.625	600	737	81,927	2040/2/15
		4.75	T-BOND 410215	4.75	350	438	48,732	2041/2/15
		5.0	T-BOND 370515	5.0	150	189	21,100	2037/5/15
		5.25	T-BOND 281115	5.25	250	298	33,149	2028/11/15
		5.25	T-BOND 290215	5.25	50	59	6,652	2029/2/15
		5.375	T-BOND 310215	5.375	400	495	55,067	2031/2/15
		5.5	T-BOND 280815	5.5	150	181	20,190	2028/8/15
		6.0	T-BOND 260215	6.0	1,350	1,626	180,703	2026/2/15
		6.125	T-BOND 271115	6.125	1,100	1,376	152,891	2027/11/15
		6.25	T-BOND 230815	6.25	100	116	12,915	2023/8/15

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	6.25 T-BOND 300515	250	328	36,507	2030/5/15
		6.5 T-BOND 261115	200	251	27,937	2026/11/15
		8 T-BOND 211115	500	586	65,122	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	300	320	35,645	2019/8/15
		8.75 T-BOND 200815	800	906	100,647	2020/8/15
小計					20,746,825	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	300	281	24,242	2022/3/1
		0.75 CAN GOVT 190801	550	543	46,819	2019/8/1
		0.75 CAN GOVT 200901	1,000	970	83,700	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	650	625	53,958	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	650	620	53,500	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	500	474	40,889	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	300	264	22,792	2027/6/1
		1.5 CAN GOVT 200301	600	594	51,264	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	550	528	45,577	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	400	372	32,110	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190901	300	299	25,822	2019/9/1
		2 CAN GOVT 280601	300	287	24,767	2028/6/1
		2.25 CAN GOVT 250601	350	346	29,844	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	400	402	34,719	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	250	254	21,968	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	410	432	37,268	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	130	140	12,102	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	350	361	31,126	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	600	617	53,214	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	430	513	44,300	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	1,000	1,019	87,931	2019/6/1
		4 CAN GOVT 410601	380	477	41,176	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	350	480	41,461	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	150	196	16,968	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	330	463	39,938	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	150	216	18,678	2027/6/1
小計					1,016,145	
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	7,650	8,530	47,600	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	2,050	2,462	13,741	2036/11/20
		5 MEXICAN BONOS 191211	6,900	6,637	37,035	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	4,300	3,790	21,152	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	9,200	8,898	49,653	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	5,600	5,354	29,879	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	4,850	4,755	26,533	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	3,350	3,318	18,519	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	2,700	2,663	14,861	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	5,250	5,138	28,670	2042/11/13

銘柄	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		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,500	6,553	36,567	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	1,700	1,717	9,585	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,300	1,305	7,284	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,700	2,832	15,807	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	2,600	2,746	15,323	2038/11/18
小	計					372,214	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	500	484	63,178	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	600	606	79,171	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	450	455	59,475	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	400	404	52,826	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	600	606	79,095	2022/4/8
		0.25 BUND 270215	0.25	700	688	89,821	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	900	911	118,903	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	350	356	46,525	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	850	866	113,085	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	700	709	92,565	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	600	599	78,233	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	150	148	19,434	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	421	54,985	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	610	642	83,824	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	170	168	22,023	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	800	858	112,034	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	700	753	98,384	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	250	269	35,177	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	550	595	77,751	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	811	105,910	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	550	603	78,694	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	500	542	70,745	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	550	608	79,363	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	550	585	76,391	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	450	489	63,823	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	431	56,330	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	660	851	111,122	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	620	807	105,349	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	600	645	84,236	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	800	851	111,067	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	550	613	80,034	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	350	505	65,898	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	900	942	122,945	2019/7/4
		4 BUND 370104	4.0	590	889	116,096	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	330	528	68,919	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	200	282	36,876	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	520	818	106,855	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	450	773	100,932	2040/7/4

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	
ドイツ	国債証券	5.5 BUND 310104	5.5	510	803	104,798	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	450	666	86,941	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	150	202	26,400	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	250	406	53,081	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	400	616	80,421	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	1,200	1,200	156,647	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	99	12,984	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	501	65,422	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	291	38,090	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	405	52,856	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	150	19,632	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	348	45,522	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	406	53,101	2019/12/1
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	350	356	46,511	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	377	49,307	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	460	60,117	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	600	614	80,213	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	400	408	53,240	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	500	494	64,507	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	489	63,857	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	700	627	81,923	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	410	53,548	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	550	558	72,815	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	200	196	25,625	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	50	49	6,483	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	950	1,003	130,899	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	850	857	111,861	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	300	275	35,891	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	50	48	6,329	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	650	666	87,009	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	582	76,026	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	364	47,547	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	170	146	19,157	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	200	198	25,943	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	430	436	56,908	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	370	382	49,972	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	550	606	79,119	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	250	273	35,751	2021/3/1
3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	274	35,866	2021/5/1		
3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	800	884	115,358	2021/8/1		
3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	568	74,136	2024/9/1		
4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	652	85,159	2020/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	770	896	116,928	2037/2/1		
4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	450	475	62,025	2019/9/1		
4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	950	1,021	133,346	2020/3/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	700	753	98,358	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	850	990	129,205	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	550	646	84,312	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	550	656	85,647	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	750	854	111,453	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	900	1,064	138,949	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	734	95,804	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	572	74,718	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	755	98,560	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	600	730	95,361	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	870	1,123	146,625	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	580	757	98,900	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	600	782	102,122	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	740	949	123,913	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	896	117,018	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	570	684	89,294	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	410	561	73,322	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,100	143,607	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	891	116,365	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	776	101,340	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	423	55,214	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 200525	—	850	858	111,996	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	300	302	39,508	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	850	853	111,420	2022/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	500	508	66,327	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	400	387	50,585	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	700	711	92,805	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	950	956	124,856	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	398	51,993	2026/5/25
		1 O. A. T 190525	1.0	200	203	26,510	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	850	883	115,258	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	1,160	1,190	155,285	2027/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	500	491	64,181	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,050	1,102	143,899	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,150	1,247	162,755	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	950	1,037	135,395	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	250	263	34,391	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	150	144	18,822	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	150	160	20,889	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,100	1,212	158,219	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	850	952	124,291	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	1,000	1,071	139,811	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	850	994	129,836	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,000	1,185	154,642	2027/10/25
3 O. A. T 220425	3.0	1,400	1,574	205,412	2022/4/25		

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	3.25 O.A.T 211025	3.25	1,000	1,120	146,202	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	610	827	108,039	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	1,200	1,292	168,659	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,250	1,543	201,358	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	1,250	1,327	173,185	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,150	1,288	168,151	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	550	806	105,302	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	450	720	93,967	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	560	918	119,907	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	1,300	1,591	207,665	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,010	1,606	209,651	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	830	1,277	166,765	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,050	1,558	203,328	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	950	1,540	200,964	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	650	917	119,750	2025/10/25
8.5 O.A.T 191025	8.5	300	339	44,250	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	300	425	55,495	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	453	59,226	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	450	456	59,564	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	297	38,842	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	650	650	84,918	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	253	33,030	2027/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	200	217	28,410	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	650	721	94,133	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	440	57,458	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	450	544	70,990	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	340	461	60,179	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	390	50,927	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	500	543	70,964	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	450	530	69,207	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	390	598	78,072	2042/1/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	300	316	41,245	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	390	584	76,280	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	350	510	66,663	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	600	605	79,041	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	150	151	19,717	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	717	93,638	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	550	566	73,975	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	400	403	52,675	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	700	720	94,013	2020/1/31
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	500	504	65,835	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	509	66,454	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	350	366	47,889	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,000	1,064	138,859	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	513	67,042	2030/7/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	500	541	70,636	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	200	209	27,368	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	400	411	53,740	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	675	88,118	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	460	497	64,904	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	350	405	52,910	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	708	92,501	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	800	866	113,074	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	600	792	103,464	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	600	640	83,579	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	603	78,789	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	635	82,958	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	650	818	106,795	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	600	853	111,393	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	617	80,564	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	400	449	58,627	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	430	623	81,425	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	400	542	70,728	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	240	366	47,822	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	600	741	96,748	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	500	581	75,942	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	800	1,194	155,832	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	848	110,736	2022/1/31
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	350	480	62,708	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	700	1,011	131,982	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	400	409	53,452	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	400	402	52,489	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	50	49	6,485	2028/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	260	256	33,438	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	160	160	20,951	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	210	205	26,790	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	100	106	13,863	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	556	72,565	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	80	88	11,523	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	570	74,445	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	300	314	41,022	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	100	124	16,295	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	550	604	78,902	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	340	497	64,952	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	500	581	75,865	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	250	342	44,736	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	403	52,660	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	357	46,588	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	500	765	99,925	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	785	102,451	2026/3/28

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	5 BEL GOVT 350328	5.0	610	954	124,583	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	520	755	98,624	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	147	19,283	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	354	46,214	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	150	149	19,519	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	100	105	13,753	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	80	79	10,400	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	60	52	6,871	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	325	42,517	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	480	522	68,177	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	250	256	33,496	2019/6/18
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	90	96	12,618	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	170	200	26,168	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	220	303	39,560	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	462	60,351	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	450	58,782	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	287	37,480	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	167	21,803	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	400	437	57,124	2020/7/15		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	522	68,127	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	401	52,421	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	450	58,754	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	49	6,483	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	150	152	19,949	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	200	199	26,085	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	100	97	12,691	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	206	26,944	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	80	79	10,426	2034/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	128	16,776	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	322	42,049	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	165	21,624	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	154	20,154	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	150	179	23,416	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	150	161	21,029	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	166	21,766	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	110	137	17,999	2025/7/4		
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	150	158	20,670	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	50	49	6,509	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	150	155	20,238	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	100	98	12,913	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	150	153	19,996	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	100	98	12,801	2033/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	170	172	22,550	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	220	230	30,086	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	283	37,042	2030/5/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	294	38,463	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	177	23,165	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	150	157	20,608	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	300	328	42,883	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	50	56	7,380	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	596	77,895	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	150	163	21,341	2019/10/18
小 計						19,579,831	
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	800	782	116,937	2022/7/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	450	438	65,626	2027/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	400	406	60,805	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	350	352	52,663	2026/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	750	759	113,536	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	650	669	100,043	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	150	146	21,882	2037/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	750	769	114,982	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	820	859	128,422	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	700	739	110,486	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	440	65,907	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	500	545	81,543	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	700	887	132,608	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	450	597	89,302	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	890	1,432	214,076	2068/7/22	
	3.75 GILT 200907	3.75	550	587	87,766	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	550	600	89,800	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	530	788	117,800	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	250	278	41,611	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	90	150	22,504	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	350	435	65,080	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	400	523	78,275	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	850	1,158	173,217	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	250	353	52,792	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	490	700	104,779	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,663	248,746	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	570	892	133,369	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	310	519	77,592	2055/12/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	360	495	74,038	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	400	602	90,076	2042/12/7	
	4.75 GILT 200307	4.75	500	535	80,107	2020/3/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	410	551	82,378	2030/12/7	
	4.75 GILT 381207	4.75	280	416	62,332	2038/12/7	
5 GILT 250307	5.0	400	496	74,237	2025/3/7		
6 GILT 281207	6.0	270	385	57,673	2028/12/7		

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券 8 GILT 210607	8.0	250	303	45,389	2021/6/7
小	計				3,328,396	
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	100	107	11,981	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	130	138	15,378	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	114	12,678	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	120	145	16,164	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	160	222	24,675	2028/4/8
小	計				80,878	
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	1,150	1,153	14,625	2028/5/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,600	1,661	21,064	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,200	2,367	30,023	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,550	1,782	22,608	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	2,700	3,101	39,325	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,240	1,720	21,814	2039/3/30
	5 SWD GOVT 201201	5.0	2,450	2,793	35,427	2020/12/1
小	計				184,888	
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	1,000	980	13,417	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	953	13,053	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	990	13,554	2027/2/17
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,793	24,551	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,300	1,401	19,182	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,200	2,368	32,419	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	2,000	2,073	28,392	2019/5/22
小	計				144,570	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券 0.25 DMK GOVT 201115	0.25	550	559	9,808	2020/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,150	1,139	19,971	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,700	1,833	32,114	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,500	2,763	48,409	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	1,650	1,839	32,236	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	2,400	2,565	44,946	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,350	5,545	97,161	2039/11/15
小	計				284,649	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券 1.5 POLAND 200425	1.5	650	649	19,690	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	600	596	18,083	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	950	953	28,917	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	700	698	21,197	2022/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,200	1,139	34,567	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	750	705	21,389	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	450	459	13,950	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	700	707	21,449	2025/7/25

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		
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	4 POLAND 231025	4.0	750	799	24,234	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	750	813	24,660	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	600	634	19,251	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	700	784	23,805	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	600	682	20,692	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	300	367	11,159	2029/4/25
小計					303,047	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	700	693	57,849	2020/11/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	350	346	28,906	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	148	12,417	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	400	377	31,507	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	600	606	50,626	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	500	503	42,042	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	790	66,001	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	550	541	45,221	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	170	166	13,901	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	188	15,754	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	350	324	27,110	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	750	774	64,681	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	950	978	81,691	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	150	149	12,462	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	300	25,110	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	950	1,047	87,460	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	700	731	61,089	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	360	420	35,126	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	689	57,518	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	740	61,807	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	850	935	78,126	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	650	736	61,482	2022/7/15
小計					1,017,894	
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	150	149	12,370	2019/10/1
	2 SINGAPORGOV 200701	2.0	50	50	4,138	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	70	67	5,616	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOV 210601	2.25	220	221	18,278	2021/6/1
	2.25 SINGAPORGOV 360801	2.25	60	54	4,523	2036/8/1
	2.5 SINGAPORGOV 190601	2.5	220	221	18,329	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOV 230701	2.75	180	183	15,149	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOV 420401	2.75	170	163	13,547	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOV 460301	2.75	80	76	6,312	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	50	50	4,199	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	120	121	10,014	2030/9/1
	3 SINGAPORGOV 240901	3.0	230	237	19,613	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOV 220901	3.125	180	187	15,490	2022/9/1

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
国債証券	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	240	246	20,398	2020/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	120	127	10,511	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	214	17,699	2027/3/1	
小 計					196,194		
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	341	9,554	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	244	6,817	2023/3/15	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	300	298	8,344	2020/3/31	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	279	7,813	2027/5/31	
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	200	199	5,561	2021/11/30	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	96	2,686	2028/6/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	400	398	11,125	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	295	8,264	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	269	7,531	2033/4/15	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	435	12,155	2027/3/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	150	146	4,094	2027/11/16	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	491	13,718	2025/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	483	13,504	2021/9/30	
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	191	5,339	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	400	403	11,266	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	400	11,176	2024/7/15	
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	200	191	5,347	2031/6/30	
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	184	5,146	2035/5/31	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	900	909	25,422	2019/11/29	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	300	8,407	2026/4/15	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	491	13,725	2030/4/15	
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	300	290	8,112	2046/3/15	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	353	9,869	2043/9/30	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	307	8,594	2019/7/30	
小 計					223,580		
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	5,600	6,235	54,182	2026/12/21	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,000	2,941	25,565	2036/3/31	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,500	2,529	21,983	2041/2/28	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,500	1,466	12,744	2021/3/31	
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,550	2,993	26,009	2031/2/28	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	700	699	6,077	2020/1/15	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	1,950	1,932	16,790	2023/2/28	
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,502	21,744	2030/1/31	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	1,650	1,528	13,279	2032/3/31	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	2,700	2,486	21,607	2037/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,650	2,452	21,309	2044/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,850	4,487	38,998	2048/2/28	
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	768	6,681	2035/2/28	

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	
南アフリカ	%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
国債証券 9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,050	1,002	8,708	2040/1/31
小 計				295,682	
合 計				47,774,800	

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

## ○投資信託財産の構成

(2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 47,774,800	% 98.6
コール・ローン等、その他	697,997	1.4
投資信託財産総額	48,472,797	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（48,423,841千円）の投資信託財産総額（48,472,797千円）に対する比率は99.9%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=111.09円	1 カナダドル=86.21円	1 メキシコペソ=5.58円	1 ユーロ=130.49円
1 イギリスポンド=149.49円	1 スイスフラン=111.12円	1 スウェーデンクローネ=12.68円	1 ノルウェークローネ=13.69円
1 デンマーククローネ=17.52円	1 ポーランドズロチ=30.33円	1 オーストラリアドル=83.47円	1 シンガポールドル=82.67円
1 マレーシアリングgit=27.94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 (2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	48,539,249,915
コール・ローン等	269,705,594
公社債(評価額)	47,774,800,597
未収入金	123,129,999
未収利息	355,688,850
前払費用	15,924,875
(B) 負債	120,843,612
未払金	66,474,106
未払解約金	54,369,416
未払利息	90
(C) 純資産総額(A-B)	48,418,406,303
元本	18,401,465,597
次期繰越損益金	30,016,940,706
(D) 受益権総口数	18,401,465,597口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,312円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 21,000,747,916円  
 期中追加設定元本額 2,544,639,158円  
 期中一部解約元本額 5,143,921,477円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6312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)	160,490,922円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	312,916,234円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	196,287,155円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,398,383,372円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,372,486,798円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,426,533,849円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,144,457,628円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	560,375,259円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	78,883,018円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	224,245,430円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	579,377円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	613,732円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	614,253円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,070,608,619円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	423,809,384円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,312,449,405円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	4,028,931,853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)	7,327円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	26,440,678円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	662,351,304円
合計	18,401,465,597円

## ○損益の状況 (2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,265,502,305
受取利息	1,265,757,268
その他収益金	65,761
支払利息	△ 320,724
(B) 有価証券売買損益	△ 415,233,739
売買益	1,353,974,854
売買損	△ 1,769,208,593
(C) 保管費用等	△ 16,943,828
(D) 当期損益金(A+B+C)	833,324,738
(E) 前期繰越損益金	33,432,854,058
(F) 追加信託差損益金	4,230,961,638
(G) 解約差損益金	△ 8,480,199,728
(H) 計(D+E+F+G)	30,016,940,706
次期繰越損益金(H)	30,016,940,706

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

【お 知 ら せ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)  
(2018年1月1日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2018年2月8日)
- ③本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。