

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160期（決算日：2020年8月17日）
 第161期（決算日：2020年9月17日）
 第162期（決算日：2020年10月19日）
 第163期（決算日：2020年11月17日）
 第164期（決算日：2020年12月17日）
 第165期（決算日：2021年1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1月18日に第165期の決算を行いましたので、法令に基づいて第160期～第165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 (分配落)	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 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
136期(2018年8月17日)	8,625	16	△3.2	442.7020	△3.2	98.7	—	1,083	
137期(2018年9月18日)	8,755	16	1.7	451.5850	2.0	98.8	—	1,101	
138期(2018年10月17日)	8,678	16	△0.7	447.1730	△1.0	98.7	—	1,083	
139期(2018年11月19日)	8,650	16	△0.1	447.6635	0.1	98.7	—	1,075	
140期(2018年12月17日)	8,755	16	1.4	453.5550	1.3	98.5	—	1,090	
141期(2019年1月17日)	8,501	16	△2.7	441.5102	△2.7	98.6	—	1,059	
142期(2019年2月18日)	8,628	16	1.7	448.9342	1.7	105.8	—	1,078	
143期(2019年3月18日)	8,755	16	1.7	457.5395	1.9	100.3	—	1,090	
144期(2019年4月17日)	8,788	16	0.6	459.9040	0.5	98.7	—	1,090	
145期(2019年5月17日)	8,634	16	△1.6	453.5846	△1.4	98.6	—	1,075	
146期(2019年6月17日)	8,685	16	0.8	456.6167	0.7	96.7	—	1,081	
147期(2019年7月17日)	8,686	16	0.2	458.8078	0.5	97.5	—	1,085	
148期(2019年8月19日)	8,746	16	0.9	463.1509	0.9	98.0	—	1,091	
149期(2019年9月17日)	8,749	16	0.2	463.2907	0.0	98.3	—	1,088	
150期(2019年10月17日)	8,832	16	1.1	469.6158	1.4	98.5	—	1,099	
151期(2019年11月18日)	8,760	16	△0.6	466.7778	△0.6	101.8	—	1,084	
152期(2019年12月17日)	8,836	16	1.1	472.7104	1.3	98.5	—	1,094	
153期(2020年1月17日)	8,890	16	0.8	475.8955	0.7	98.5	—	1,097	
154期(2020年2月17日)	8,867	16	△0.1	476.5043	0.1	102.0	—	1,087	
155期(2020年3月17日)	8,752	16	△1.1	465.6683	△2.3	98.9	—	1,055	
156期(2020年4月17日)	8,852	16	1.3	475.9540	2.2	98.4	—	1,021	
157期(2020年5月18日)	8,740	16	△1.1	474.1149	△0.4	98.3	—	1,012	
158期(2020年6月17日)	8,929	16	2.3	484.4584	2.2	98.7	—	1,035	
159期(2020年7月17日)	9,034	16	1.4	492.4691	1.7	98.6	—	1,049	
160期(2020年8月17日)	9,120	16	1.1	497.0794	0.9	97.7	—	1,055	
161期(2020年9月17日)	8,984	16	△1.3	491.6882	△1.1	97.6	—	1,036	
162期(2020年10月19日)	9,015	16	0.5	494.4499	0.6	97.5	—	1,044	
163期(2020年11月17日)	8,933	16	△0.7	491.2440	△0.6	97.4	—	1,032	
164期(2020年12月17日)	8,981	16	0.7	495.3842	0.8	97.5	—	1,036	
165期(2021年1月18日)	8,913	16	△0.6	493.1226	△0.5	97.4	—	1,022	

(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160期	(期 首) 2020年7月17日	円 9,034	% —	492.4691	% —	% 98.6	% —
	7月末	9,062	0.3	494.1351	0.3	98.4	—
	(期 末) 2020年8月17日	9,136	1.1	497.0794	0.9	97.7	—
第161期	(期 首) 2020年8月17日	9,120	—	497.0794	—	97.7	—
	8月末	9,031	△1.0	492.6490	△0.9	99.3	—
	(期 末) 2020年9月17日	9,000	△1.3	491.6882	△1.1	97.6	—
第162期	(期 首) 2020年9月17日	8,984	—	491.6882	—	97.6	—
	9月末	9,052	0.8	494.8770	0.6	97.8	—
	(期 末) 2020年10月19日	9,031	0.5	494.4499	0.6	97.5	—
第163期	(期 首) 2020年10月19日	9,015	—	494.4499	—	97.5	—
	10月末	8,896	△1.3	488.0379	△1.3	97.8	—
	(期 末) 2020年11月17日	8,949	△0.7	491.2440	△0.6	97.4	—
第164期	(期 首) 2020年11月17日	8,933	—	491.2440	—	97.4	—
	11月末	8,965	0.4	493.2010	0.4	100.6	—
	(期 末) 2020年12月17日	8,997	0.7	495.3842	0.8	97.5	—
第165期	(期 首) 2020年12月17日	8,981	—	495.3842	—	97.5	—
	12月末	9,017	0.4	497.3313	0.4	98.0	—
	(期 末) 2021年1月18日	8,929	△0.6	493.1226	△0.5	97.4	—

(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

第160期～第165期：2020年7月18日～2021年1月18日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第160期首	9,034円
第165期末	8,913円
既払分配金	96円
騰落率	-0.3%

(分配金再投資ベース)

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

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

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ0.3%（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（0.1%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

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

第160期～第165期：2020年7月18日～2021年1月18日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、欧州各国の金利は概ね低下したものの、米国大統領選の結果を受け、財政支出拡大による国債増発懸念が高まったことなどを背景に米国長期金利が上昇したことなどから、当作成期首との比較では下落しました。

▶ 為替市況

当作成期首に比べて米ドルは対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）

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

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

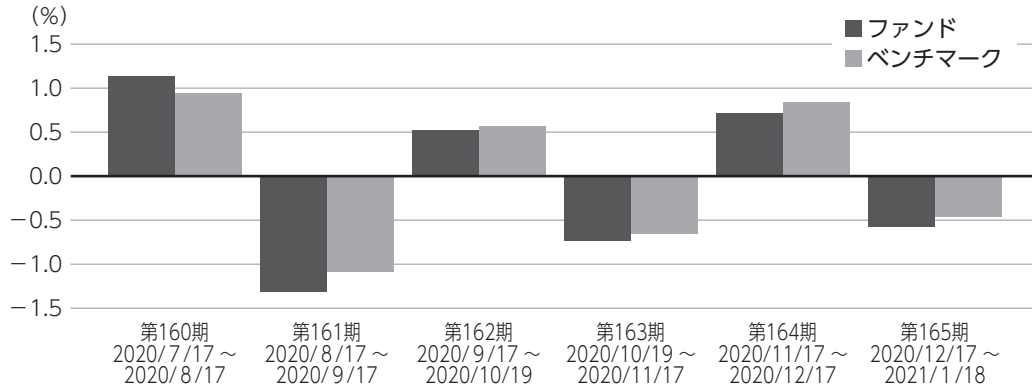
日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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。

第160期～第165期：2020/7/18～2021/1/18

当該投資信託のベンチマークとの差異について

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）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.4\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

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160期 2020年7月18日～ 2020年8月17日	第161期 2020年8月18日～ 2020年9月17日	第162期 2020年9月18日～ 2020年10月19日	第163期 2020年10月20日～ 2020年11月17日	第164期 2020年11月18日～ 2020年12月17日	第165期 2020年12月18日～ 2021年1月18日
当期分配金 （対基準価額比率）	16 (0.175%)	16 (0.178%)	16 (0.177%)	16 (0.179%)	16 (0.178%)	16 (0.179%)
当期の収益	15	9	14	9	13	9
当期の収益以外	0	6	1	6	2	6
翌期繰越分配対象額	1,766	1,760	1,758	1,751	1,749	1,743

（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）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2020年7月18日～2021年1月18日

1万口当たりの費用明細

項目	第160期～第165期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	38	0.418	(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）	(20)	(0.223)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(15)	(0.167)	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）	(3)	(0.028)	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)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.002)	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
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	39	0.434	

作成期中の平均基準価額は、9,017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。

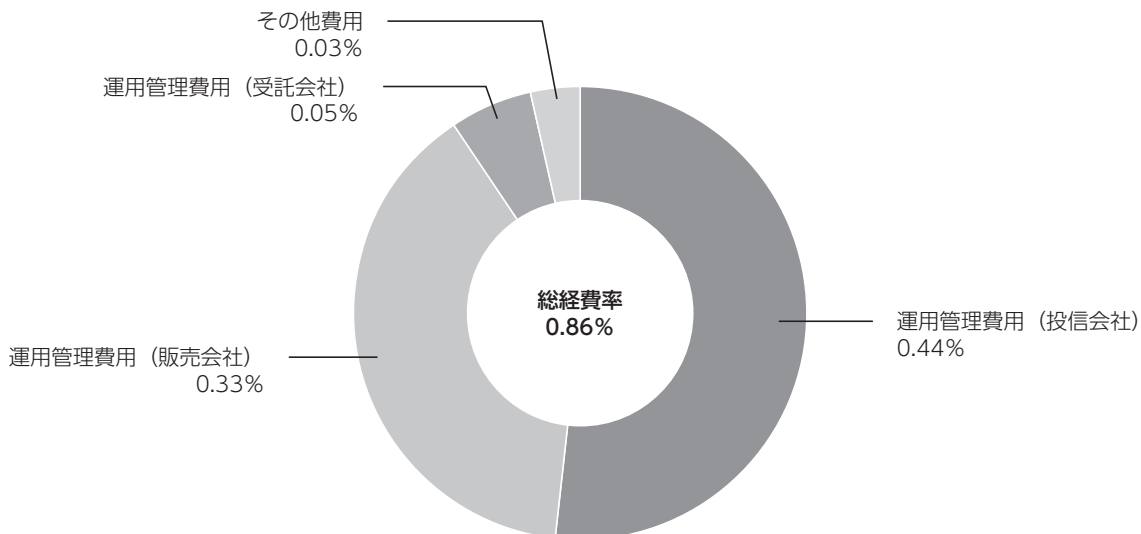
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.86%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2020年7月18日～2021年1月18日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第160期～第165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 9,359	千円 27,004	千口 19,426	千円 56,438

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月18日～2021年1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160期～第165期					
	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 7,304	百万円 3,405	46.6 %	百万円 5,167	百万円 3,639	70.4 %

平均保有割合 2.2%

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

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

○組入資産の明細

(2021年1月18日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第159期末		第165期末		
	口 数		口 数		評 価 額
	千口		千口		
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	363,580		353,513		1,021,759

○投資信託財産の構成

(2021年1月18日現在)

項 目	第165期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千円 1,021,759	% 99.7
コール・ローン等、その他	2,949	0.3
投資信託財産総額	1,024,708	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(49,310,140千円)の投資信託財産総額(50,527,029千円)に対する比率は97.6%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=103.83円	1 カナダドル=81.35円	1 メキシコペソ=5.24円	1 ユーロ=125.36円
1 イギリスポンド=140.98円	1 スウェーデンクローネ=12.36円	1 ノルウェークローネ=12.11円	1 デンマーククローネ=16.85円
1 ポーランドズロチ=27.62円	1 オーストラリアドル=79.86円	1 シンガポールドル=78.00円	1 マレーシアリンギット=25.66円
1 イスラエルシェケル=31.79円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第160期末	第161期末	第162期末	第163期末	第164期末	第165期末
	2020年8月17日現在	2020年9月17日現在	2020年10月19日現在	2020年11月17日現在	2020年12月17日現在	2021年1月18日現在
(A) 資産	円 1,058,345,632	円 1,039,492,832	円 1,046,960,388	円 1,037,910,354	円 1,039,396,757	円 1,024,708,900
コール・ローン等	1,381,891	952,738	1,091,495	950,951	1,276,813	1,294,942
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,055,053,241	1,036,365,555	1,043,800,957	1,032,588,915	1,036,174,073	1,021,759,970
未収入金	1,910,500	2,174,539	2,067,936	4,370,488	1,945,871	1,653,988
(B) 負債	2,921,316	2,809,979	2,793,535	5,003,260	2,905,367	2,588,629
未払収益分配金	1,851,680	1,846,358	1,853,296	1,850,043	1,846,600	1,834,858
未払解約金	324,145	223,332	180,350	2,472,209	351,348	784
未払信託報酬	741,345	736,177	755,667	677,224	703,490	748,802
未払利息	2	-	-	-	-	-
その他未払費用	4,144	4,112	4,222	3,784	3,929	4,185
(C) 純資産総額(A-B)	1,055,424,316	1,036,682,853	1,044,166,853	1,032,907,094	1,036,491,390	1,022,120,271
元本	1,157,300,303	1,153,974,141	1,158,310,526	1,156,277,254	1,154,125,435	1,146,786,823
次期繰越損益金	△ 101,875,987	△ 117,291,288	△ 114,143,673	△ 123,370,160	△ 117,634,045	△ 124,666,552
(D) 受益権総口数	1,157,300,303口	1,153,974,141口	1,158,310,526口	1,156,277,254口	1,154,125,435口	1,146,786,823口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,120円	8,984円	9,015円	8,933円	8,981円	8,913円

○損益の状況

項 目	第160期	第161期	第162期	第163期	第164期	第165期
	2020年7月18日～ 2020年8月17日	2020年8月18日～ 2020年9月17日	2020年9月18日～ 2020年10月19日	2020年10月20日～ 2020年11月17日	2020年11月18日～ 2020年12月17日	2020年12月18日～ 2021年1月18日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 7	△ 19	△ 1	△ 3	△ 2	△ 1
支払利息	△ 7	△ 19	△ 1	△ 3	△ 2	△ 1
(B) 有価証券売買損益	12,473,243	△ 13,109,296	6,205,082	△ 6,783,376	8,032,847	△ 5,197,223
売買益	12,588,024	15,637	6,287,862	95,280	8,115,452	26,048
売買損	△ 114,781	△ 13,124,933	△ 82,780	△ 6,878,656	△ 82,605	△ 5,223,271
(C) 信託報酬等	△ 745,489	△ 740,289	△ 759,889	△ 681,008	△ 707,419	△ 752,987
(D) 当期損益金 (A+B+C)	11,727,747	△ 13,849,604	5,445,192	△ 7,464,387	7,325,426	△ 5,950,211
(E) 前期繰越損益金	23,463,438	33,077,714	17,284,618	20,602,351	11,205,522	16,485,687
(F) 追加信託差損益金	△135,215,492	△134,673,040	△135,020,187	△134,658,081	△134,318,393	△133,367,170
(配当等相当額)	(96,459,918)	(96,723,453)	(98,084,370)	(99,121,703)	(99,505,724)	(99,446,024)
(売買損益相当額)	(△231,675,410)	(△231,396,493)	(△233,104,557)	(△233,779,784)	(△233,824,117)	(△232,813,194)
(G) 計 (D+E+F)	△100,024,307	△115,444,930	△112,290,377	△121,520,117	△115,787,445	△122,831,694
(H) 収益分配金	△ 1,851,680	△ 1,846,358	△ 1,853,296	△ 1,850,043	△ 1,846,600	△ 1,834,858
次期繰越損益金 (G+H)	△101,875,987	△117,291,288	△114,143,673	△123,370,160	△117,634,045	△124,666,552
追加信託差損益金	△135,215,492	△134,673,040	△135,020,187	△134,658,081	△134,318,393	△133,367,170
(配当等相当額)	(96,463,267)	(96,726,644)	(98,092,460)	(99,127,761)	(99,510,545)	(99,450,168)
(売買損益相当額)	(△231,678,759)	(△231,399,684)	(△233,112,647)	(△233,785,842)	(△233,828,938)	(△232,817,338)
分配準備積立金	107,958,359	106,376,134	105,604,021	103,411,687	102,411,942	100,459,758
繰越損益金	△ 74,618,854	△ 88,994,382	△ 84,727,507	△ 92,123,766	△ 85,727,594	△ 91,759,140

(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 1,162,030,739円
 作成期中追加設定元本額 47,831,281円
 作成期中一部解約元本額 63,075,197円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8913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124,666,552円です。
- ③ 分配金の計算過程

項 目	2020年7月18日～ 2020年8月17日	2020年8月18日～ 2020年9月17日	2020年9月18日～ 2020年10月19日	2020年10月20日～ 2020年11月17日	2020年11月18日～ 2020年12月17日	2020年12月18日～ 2021年1月18日
費用控除後の配当等収益額	1,787,208円	1,111,852円	1,675,648円	1,044,562円	1,601,737円	1,102,090円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	96,463,267円	96,726,644円	98,092,460円	99,127,761円	99,510,545円	99,450,168円
分配準備積立金額	108,022,831円	107,110,640円	105,781,669円	104,217,168円	102,656,805円	101,192,526円
当ファンドの分配対象収益額	206,273,306円	204,949,136円	205,549,777円	204,389,491円	203,769,087円	201,744,784円
1万円当たり収益分配対象額	1,782円	1,776円	1,774円	1,767円	1,765円	1,759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	1,851,680円	1,846,358円	1,853,296円	1,850,043円	1,846,600円	1,834,858円

○分配金のお知らせ

	第160期	第161期	第162期	第163期	第164期	第165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。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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、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。

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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
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
19期(2019年5月20日)	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—	51,055
20期(2020年5月20日)	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	—	46,870

(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 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年5月20日	円	%		%	%	%
	26,691	—	453.5333	—	98.6	—
5月末	26,639	△0.2	455.6393	0.5	97.5	—
6月末	26,987	1.1	459.5523	1.3	98.7	—
7月末	27,069	1.4	460.6900	1.6	97.6	—
8月末	27,245	2.1	464.2836	2.4	97.0	—
9月末	27,377	2.6	467.4782	3.1	99.1	—
10月末	27,644	3.6	470.0589	3.6	99.0	—
11月末	27,658	3.6	470.8993	3.8	98.4	—
12月末	27,783	4.1	472.8141	4.3	98.8	—
2020年1月末	28,004	4.9	475.3494	4.8	97.6	—
2月末	28,336	6.2	484.7936	6.9	96.3	—
3月末	28,373	6.3	480.5834	6.0	96.2	—
4月末	27,831	4.3	472.8751	4.3	99.6	—
(期 末) 2020年5月20日	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

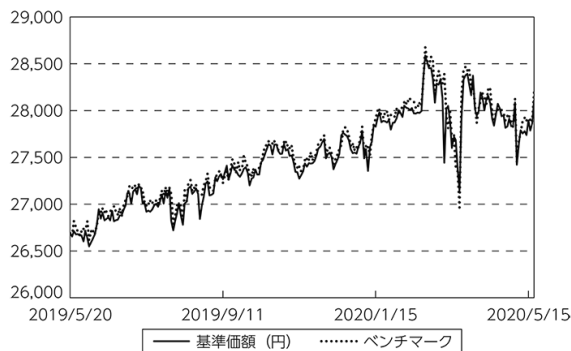
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.3%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(5.6%)を0.3%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について**◎ 外国債券市況**

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

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロは対円で下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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5.6%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.3\%$ 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：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因[※]によるものです。

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

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.025	(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 ）	(7)	(0.025)	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	7	0.025	
期中の平均基準価額は、27,486円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	千アメリカドル 100,369	千アメリカドル 139,912	
	カナダ	千カナダドル 3,768	千カナダドル 5,224	
	メキシコ	千メキシコペソ 21,548	千メキシコペソ 23,215	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券 20,049	18,998	
	イタリア	国債証券 11,670	13,730	
	フランス	国債証券 20,639	23,176	
	オランダ	国債証券 2,014	3,089	
	スペイン	国債証券 21,314	22,142	
	ベルギー	国債証券 2,291	3,370	
	オーストリア	国債証券 1,534	1,663	
	フィンランド	国債証券 869	1,004	
	アイルランド	国債証券 720	867	
	イギリス	国債証券 9,203	千イギリスポンド 12,175	
	スウェーデン	国債証券 1,568	千スウェーデンクローネ 4,991	
	ノルウェー	国債証券 2,117	千ノルウェークローネ 1,958	
	国	デンマーク	国債証券 3,483	千デンマーククローネ 4,195
		ポーランド	国債証券 2,271	千ポーランドズロチ 3,299
オーストラリア		国債証券 3,643	千オーストラリアドル 3,762	
シンガポール		国債証券 525	千シンガポールドル 587	
マレーシア		国債証券 2,170	千マレーシアリングgit 2,012	
イスラエル		国債証券 5,673	千イスラエルシェケル -	
南アフリカ		国債証券 7,218	千南アフリカランド 39,483	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20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 14,598	百万円 10,696	% 73.3	百万円 21,485	百万円 12,717	% 59.2

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

○組入資産の明細

(2020年5月20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 176,800	千アメリカドル 199,196	千円 21,509,212	% 45.9	% —	% 20.8	% 17.1	% 8.0
カナダ	千カナダドル 9,280	千カナダドル 10,982	851,988	1.8	—	1.0	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 70,150	千メキシコペソ 77,001	351,897	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,520	28,129	3,322,117	7.1	—	4.4	2.3	0.3
イタリア	30,970	35,057	4,140,303	8.8	—	5.2	2.4	1.2
フランス	31,050	38,675	4,567,546	9.7	—	6.9	2.5	0.4
オランダ	5,970	7,380	871,672	1.9	—	1.2	0.4	0.2
スペイン	19,320	23,019	2,718,608	5.8	—	3.8	1.3	0.7
ベルギー	7,650	9,584	1,131,947	2.4	—	1.9	0.3	0.2
オーストリア	4,650	5,725	676,215	1.4	—	1.0	0.3	0.2
フィンランド	1,980	2,251	265,896	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	2,630	2,996	353,926	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 15,640	千イギリスポンド 22,998	3,045,723	6.5	—	5.3	1.2	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 10,040	千スウェーデンクローネ 11,450	127,670	0.3	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,250	千ノルウェークローネ 10,010	108,412	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 11,410	千デンマーククローネ 14,562	230,662	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,890	千ポーランドズロチ 9,852	255,579	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,460	千オーストラリアドル 13,346	944,239	2.0	—	1.4	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,310	千シンガポールドル 2,677	204,158	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,270	千マレーシアリンギット 8,961	222,331	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 4,300	千イスラエルシェケル 5,667	174,158	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	46,074,269	98.3	—	56.0	30.1	12.2

(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	0.5 T-NOTE 230315	0.5	1,900	1,915	206,804	2023/3/15
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,114	120,336	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	800	812	87,733	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,700	1,755	189,546	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	3,000	3,084	333,114	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	500	518	56,001	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	986	106,515	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	2,340	2,452	264,852	2025/1/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	204	22,076	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,700	1,762	190,349	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	800	842	90,959	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	2,400	2,548	275,146	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	2,050	2,116	228,492	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,548	167,259	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,134	230,524	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	600	625	67,531	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	1,099	118,746	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,400	2,560	276,442	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,400	2,563	276,826	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,430	1,530	165,280	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	1,210	1,296	139,995	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	2,820	3,061	330,529	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,587	171,383	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,158	233,100	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	3,150	3,242	350,128	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,900	1,958	211,429	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,250	2,319	250,490	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,650	178,247	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,550	1,614	174,312	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,254	135,467	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	769	83,095	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,753	189,331	2022/3/31
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,650	3,775	407,644	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	2,350	2,437	263,149	2022/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	778	84,110	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	950	987	106,628	2022/9/30
	2 T-NOTE 210531	2.0	450	458	49,509	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,125	121,557	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,128	121,905	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,540	166,392	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2.0	450	463	50,010	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,237	133,630	2022/2/15
	2 T-NOTE 230215	2.0	1,900	1,992	215,179	2023/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,950	2,083	224,987	2024/5/31

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	
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	1,900	2,047	221,142	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,200	2,383	257,358	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,650	1,806	195,106	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,175	126,883	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,100	1,126	121,636	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,129	121,914	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,550	1,598	172,612	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,102	119,047	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,150	2,292	247,519	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,200	1,283	138,585	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	1,350	1,445	156,102	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,506	162,710	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	1,800	1,941	209,594	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,250	1,358	146,711	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,000	1,098	118,592	2026/5/31
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	1,243	134,283	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	60	71	7,754	2049/8/15
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,332	143,899	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,520	1,628	175,887	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	750	804	86,900	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	2,100	2,261	244,243	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,500	2,714	293,085	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	800	891	96,250	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	1,350	1,513	163,413	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	1,000	1,123	121,325	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 220315	2.375	2,100	2,183	235,784	2022/3/15
	2.375 T-NOTE 230131	2.375	1,200	1,270	137,137	2023/1/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,990	3,249	350,933	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	950	1,069	115,531	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	1,020	1,255	135,609	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	1,175	126,923	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	950	1,176	127,052	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 220215	2.5	300	312	33,691	2022/2/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,100	1,180	127,463	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,632	176,243	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	900	1,005	108,562	2026/2/28
	2.625 T-NOTE 210715	2.625	1,600	1,645	177,660	2021/7/15
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	800	853	92,154	2023/2/28
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	600	644	69,611	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,010	1,120	121,013	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	1,600	1,794	193,783	2025/12/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	650	828	89,444	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	590	751	81,168	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,180	1,536	165,900	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	630	821	88,658	2047/11/15

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	2.75	T-NOTE 210815	2.75	1,000	1,032	111,447	2021/8/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	1,900	2,064	222,889	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	1,100	1,201	129,718	2024/2/15
		2.75	T-NOTE 250228	2.75	1,630	1,815	196,055	2025/2/28
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	1,600	1,792	193,554	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	950	1,066	115,195	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	2,610	3,038	328,065	2028/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	1,050	1,366	147,583	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	1,400	1,842	198,962	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	950	1,261	136,240	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	2,300	2,708	292,475	2028/5/15
		2.875	T-NOTE 280815	2.875	1,800	2,126	229,653	2028/8/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	400	530	57,242	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	1,320	1,764	190,488	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	1,490	1,997	215,712	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	1,200	1,615	174,482	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	950	1,292	139,574	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	1,410	1,918	207,157	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	950	1,296	139,991	2048/2/15
		3.0	T-BOND 480815	3.0	500	684	73,959	2048/8/15
		3.0	T-NOTE 250930	3.0	850	967	104,446	2025/9/30
		3.0	T-NOTE 251031	3.0	1,700	1,936	209,150	2025/10/31
		3.125	T-BOND 411115	3.125	440	592	63,976	2041/11/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	500	674	72,848	2042/2/15
		3.125	T-BOND 430215	3.125	1,300	1,756	189,620	2043/2/15
		3.125	T-BOND 440815	3.125	770	1,047	113,154	2044/8/15
		3.125	T-BOND 480515	3.125	600	838	90,500	2048/5/15
		3.125	T-NOTE 210515	3.125	750	771	83,354	2021/5/15
		3.125	T-NOTE 281115	3.125	2,980	3,594	388,097	2028/11/15
		3.375	T-BOND 440515	3.375	930	1,312	141,770	2044/5/15
		3.375	T-BOND 481115	3.375	500	731	79,021	2048/11/15
		3.5	T-BOND 390215	3.5	380	535	57,842	2039/2/15
		3.625	T-BOND 430815	3.625	950	1,383	149,395	2043/8/15
		3.625	T-BOND 440215	3.625	1,410	2,060	222,448	2044/2/15
		3.75	T-BOND 410815	3.75	400	586	63,303	2041/8/15
		3.75	T-BOND 431115	3.75	930	1,381	149,125	2043/11/15
		3.875	T-BOND 400815	3.875	450	667	72,036	2040/8/15
		4.25	T-BOND 390515	4.25	460	708	76,461	2039/5/15
		4.25	T-BOND 401115	4.25	500	777	83,903	2040/11/15
		4.375	T-BOND 380215	4.375	310	479	51,730	2038/2/15
		4.375	T-BOND 391115	4.375	440	689	74,410	2039/11/15
		4.375	T-BOND 400515	4.375	470	739	79,874	2040/5/15
		4.375	T-BOND 410515	4.375	350	553	59,819	2041/5/15
		4.5	T-BOND 380515	4.5	250	392	42,350	2038/5/15
		4.75	T-BOND 410215	4.75	500	824	89,032	2041/2/15

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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	5.25	281115	553	59,790	2028/11/15
		5.25	290215	1,115	120,438	2029/2/15
		5.5	280815	306	33,120	2028/8/15
		6.0	260215	1,119	120,845	2026/2/15
		6.125	271115	564	60,951	2027/11/15
		6.25	230815	1,314	141,976	2023/8/15
		8.0	211115	558	60,310	2021/11/15
小	計				21,509,212	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.5	220301	301	23,371	2022/3/1
		0.75	210901	603	46,851	2021/9/1
		1.0	220901	965	74,902	2022/9/1
		1.0	270601	310	24,083	2027/6/1
		1.5	230601	881	68,396	2023/6/1
		1.5	260601	200	16,493	2026/6/1
		2.0	280601	390	30,302	2028/6/1
		2.0	511201	282	21,914	2051/12/1
		2.25	250601	818	63,514	2025/6/1
		2.25	290601	184	14,280	2029/6/1
		2.5	240601	1,248	96,852	2024/6/1
		2.75	220601	262	20,369	2022/6/1
		2.75	481201	485	37,641	2048/12/1
		2.75	641201	249	19,325	2064/12/1
		3.25	210601	773	60,012	2021/6/1
		3.5	451201	545	42,303	2045/12/1
		4.0	410601	495	38,433	2041/6/1
		5.0	370601	523	40,615	2037/6/1
		5.75	290601	394	30,581	2029/6/1
		5.75	330601	825	64,053	2033/6/1
		8.0	270601	227	17,688	2027/6/1
小	計				851,988	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10.0	241205	9,107	41,622	2024/12/5
		10.0	361120	1,871	8,553	2036/11/20
		5.75	260305	6,271	28,660	2026/3/5
		6.5	210610	7,103	32,462	2021/6/10
		6.5	220609	5,755	26,304	2022/6/9
		6.75	230309	2,607	11,916	2023/3/9
		7.25	211209	3,561	16,274	2021/12/9
		7.5	270603	5,605	25,619	2027/6/3
		7.75	310529	4,578	20,921	2031/5/29
		7.75	341123	1,902	8,694	2034/11/23
		7.75	421113	6,100	27,879	2042/11/13
		8.0	231207	7,321	33,458	2023/12/7
		8.0	471107	1,999	9,139	2047/11/7

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	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	7,200	8,412	38,444	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	4,100	4,802	21,946	2038/11/18
小 計						351,897	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	690	718	84,832	2026/8/15
		0 BUND 290815	—	600	628	74,204	2029/8/15
		0 BUND 500815	—	180	182	21,535	2050/8/15
		0 OBL 230414	—	260	265	31,332	2023/4/14
		0 OBL 240405	—	1,170	1,201	141,898	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	600	618	72,986	2024/10/18
		0.25 BUND 270215	0.25	860	911	107,684	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	700	747	88,296	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	430	460	54,353	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	600	634	74,895	2025/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	720	778	91,954	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	500	542	64,090	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	429	50,669	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,110	1,208	142,766	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	430	591	69,831	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,470	173,706	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,100	1,167	137,833	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	533	62,966	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	435	51,428	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	740	778	91,921	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	720	786	92,924	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,200	1,252	147,924	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	489	57,846	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	620	1,020	120,578	2044/7/4
2.5 BUND 460815	2.5	620	1,047	123,729	2046/8/15		
3.25 BUND 420704	3.25	340	602	71,105	2042/7/4		
4 BUND 370104	4.0	550	950	112,239	2037/1/4		
4.25 BUND 390704	4.25	500	936	110,624	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	570	819	96,798	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	480	834	98,576	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	780	1,576	186,131	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	620	1,021	120,595	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	570	844	99,706	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	350	438	51,826	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	360	598	70,730	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	400	606	71,594	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	100	11,815	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	210	202	23,960	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	501	59,241	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	800	796	94,104	2023/10/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	151	17,850	2022/8/1

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	0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	352	41,617	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	450	455	53,821	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	397	46,989	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	456	53,969	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	250	255	30,117	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	850	864	102,064	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	750	763	90,177	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	480	473	55,882	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	413	48,856	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,100	1,146	135,345	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,040	1,079	127,431	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	200	208	24,584	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	150	154	18,206	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	330	346	40,961	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	740	754	89,160	2036/9/1
		2.3 ITALY GOVT 211015	2.3	500	513	60,661	2021/10/15
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	380	402	47,477	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	584	69,007	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	420	448	52,920	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	460	478	56,531	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	490	538	63,595	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	460	473	55,885	2067/3/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	530	593	70,035	2029/8/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	410	467	55,193	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	330	383	45,263	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	390	459	54,264	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	650	756	89,310	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	258	30,535	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,000	1,041	123,039	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	556	65,713	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	290	365	43,129	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	770	959	113,308	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	750	832	98,268	2023/5/1
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	900	1,018	120,265	2024/3/1		
4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	500	589	69,624	2026/3/1		
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	650	687	81,155	2021/9/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	470	528	62,461	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	650	811	95,782	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	380	532	62,941	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	702	82,934	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	820	967	114,274	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	690	938	110,885	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	750	1,059	125,148	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	470	665	78,651	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	700	920	108,693	2029/11/1		

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	5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	833	98,381	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,370	1,531	180,814	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	550	783	92,576	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	540	764	90,302	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	876	103,538	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	350	476	56,309	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	383	45,262	2023/11/1
		フランス	国債証券	0 O. A. T 220525	—	950	960
0.25 O. A. T 261125	0.25			600	619	73,117	2026/11/25
0.5 O. A. T 250525	0.5			1,220	1,274	150,509	2025/5/25
0.5 O. A. T 260525	0.5			650	681	80,428	2026/5/25
0.75 O. A. T 280525	0.75			1,200	1,285	151,814	2028/5/25
0.75 O. A. T 281125	0.75			1,250	1,341	158,400	2028/11/25
1 O. A. T 251125	1.0			800	859	101,450	2025/11/25
1 O. A. T 270525	1.0			1,100	1,192	140,885	2027/5/25
1.25 O. A. T 340525	1.25			290	329	38,912	2034/5/25
1.25 O. A. T 360525	1.25			660	752	88,827	2036/5/25
1.5 O. A. T 310525	1.5			950	1,100	129,912	2031/5/25
1.75 O. A. T 230525	1.75			2,340	2,501	295,441	2023/5/25
1.75 O. A. T 241125	1.75			900	988	116,798	2024/11/25
1.75 O. A. T 390625	1.75			800	990	116,960	2039/6/25
1.75 O. A. T 660525	1.75			510	699	82,594	2066/5/25
2 O. A. T 480525	2.0			660	882	104,244	2048/5/25
2.25 O. A. T 221025	2.25			1,170	1,250	147,642	2022/10/25
2.25 O. A. T 240525	2.25			1,050	1,165	137,626	2024/5/25
2.5 O. A. T 300525	2.5			1,090	1,363	160,979	2030/5/25
2.75 O. A. T 271025	2.75			1,150	1,403	165,748	2027/10/25
3 O. A. T 220425	3.0			1,400	1,495	176,647	2022/4/25
3.25 O. A. T 450525	3.25			660	1,063	125,587	2045/5/25
3.5 O. A. T 260425	3.5			830	1,018	120,268	2026/4/25
4 O. A. T 381025	4.0			500	817	96,513	2038/10/25
4 O. A. T 550425	4.0			500	1,001	118,320	2055/4/25
4 O. A. T 600425	4.0			440	927	109,567	2060/4/25
4.25 O. A. T 231025	4.25			1,390	1,619	191,294	2023/10/25
4.5 O. A. T 410425	4.5			740	1,326	156,706	2041/4/25
4.75 O. A. T 350425	4.75			930	1,539	181,788	2035/4/25
5.5 O. A. T 290425	5.5			1,310	1,967	232,303	2029/4/25
5.75 O. A. T 321025	5.75			860	1,455	171,893	2032/10/25
6 O. A. T 251025	6.0			1,000	1,347	159,097	2025/10/25
8.5 O. A. T 230425	8.5			1,150	1,455	171,860	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	454	53,657	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	380	387	45,817	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	311	36,844	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	350	370	43,800	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	150	165	19,520	2040/1/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	450	487	57,600	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	350	381	45,098	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	376	44,409	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	250	276	32,701	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	424	50,169	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	490	656	77,583	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	390	670	79,229	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	365	43,145	2021/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	223	26,375	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	350	635	75,084	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	370	623	73,587	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	390	567	67,047	2028/1/15
		スペイン	国債証券	0.05 SPAIN GOVT 211031	0.05	1,000	1,005
0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35			600	609	71,967	2023/7/30
0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45			450	458	54,092	2022/10/31
0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5			680	670	79,243	2030/4/30
0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75			900	912	107,737	2021/7/30
1 SPAIN GOVT 501031	1.0			210	186	21,971	2050/10/31
1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4			660	708	83,673	2028/4/30
1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4			700	751	88,798	2028/7/30
1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45			610	656	77,520	2027/10/31
1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45			650	700	82,687	2029/4/30
1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5			500	540	63,807	2027/4/30
1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6			710	763	90,144	2025/4/30
1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95			860	948	112,011	2026/4/30
1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95			600	676	79,846	2030/7/30
2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15			740	820	96,899	2025/10/31
2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35			490	579	68,451	2033/7/30
2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7			330	426	50,428	2048/10/31
2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75			1,030	1,155	136,483	2024/10/31
2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9			420	558	65,958	2046/10/31
3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45			260	409	48,399	2066/7/30
3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8			240	276	32,666	2024/4/30
4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2			650	963	113,770	2037/1/31
4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4			500	578	68,322	2023/10/31
4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65			410	506	59,835	2025/7/30
4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7			500	821	97,017	2041/7/30
4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8			500	590	69,740	2024/1/31
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9			410	680	80,413	2040/7/30
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15			550	760	89,867	2028/10/31
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15			310	554	65,443	2044/10/31
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4			550	633	74,847	2023/1/31
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75			530	836	98,740	2032/7/30
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85			700	773	91,345	2022/1/31
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9			520	700	82,687	2026/7/30

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	6 SPAIN GOVT 290131	6.0	550	804	95,030	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	420	443	52,409	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	350	373	44,109	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	650	697	82,318	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	370	400	47,347	2029/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	370	405	47,891	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	390	453	53,517	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	367	43,391	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	220	330	39,070	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	450	488	57,684	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	180	264	31,199	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	561	66,352	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	220	302	35,692	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	220	377	44,638	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	400	433	51,241	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	260	376	44,516	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	372	44,004	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	334	39,467	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	390	669	79,051	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	450	576	68,033	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	490	820	96,923	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	370	534	63,084	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	200	201	23,819	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	250	263	31,109	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	250	264	31,188	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	190	203	23,981	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	210	225	26,630	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	271	32,076	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	194	23,004	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	120	174	20,650	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	328	38,779	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	380	409	48,412	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	130	248	29,375	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	170	224	26,481	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	160	268	31,712	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	440	51,986	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	421	49,786	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	270	31,939	2022/4/20
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	80	181	21,388	2062/1/26		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	300	499	58,947	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	326	38,565	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	210	308	36,380	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,007	2023/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	100	100	11,818	2036/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	100	105	12,411	2026/4/15

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	190	200	23,718	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	120	130	15,421	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	130	138	16,395	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	110	126	14,889	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	60	77	9,156	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	127	15,022	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	250	262	31,036	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	220	241	28,537	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	183	21,674	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	248	29,312	2028/7/4
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	210	258	30,494	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	100	100	11,921	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	280	286	33,814	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	360	384	45,421	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	200	213	25,162	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	200	217	25,717	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	180	201	23,778	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	100	117	13,920	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	210	249	29,448	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	180	234	27,691	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	304	36,003	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	120	136	16,179	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	168	19,858	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	300	381	45,010	2025/3/13
小 計					18,048,234		
イギリス			千イギリスポンド	千イギリスポンド			
イギリス	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	800	809	107,179	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	1,050	1,074	142,352	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	420	454	60,196	2027/7/22
		1.5 GILT 260722	1.5	920	1,002	132,768	2026/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	670	753	99,786	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	310	477	63,244	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	720	749	99,225	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	590	704	93,346	2037/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	750	805	106,702	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	490	880	116,607	2065/7/22
		3.25 GILT 440122	3.25	420	658	87,200	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	810	1,333	176,654	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	450	1,024	135,641	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	410	787	104,313	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	50	53	7,101	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	400	896	118,674	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	460	601	79,691	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	330	480	63,698	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	530	831	110,113	2036/3/7

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
イギリス			千イギリスポンド	千イギリスポンド			
	国債証券	4.25 GILT 390907	4.25	320	533	70,679	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	330	561	74,398	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	850	1,593	211,059	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	480	946	125,283	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	460	1,002	132,786	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	320	499	66,148	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	400	725	96,030	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	510	749	99,223	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	360	625	82,867	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	620	766	101,542	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	410	613	81,204	2028/12/7
小計						3,045,723	
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	1,550	1,659	18,504	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	900	968	10,794	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	1,600	1,725	19,238	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	1,640	1,744	19,450	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,250	1,423	15,872	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	1,900	2,047	22,833	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,200	1,881	20,977	2039/3/30
小計						127,670	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,000	1,089	11,797	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	752	8,146	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	1,023	11,084	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,099	11,905	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	600	672	7,282	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,851	20,055	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	750	846	9,170	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,100	1,222	13,240	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	1,400	1,452	15,729	2021/5/25
小計						108,412	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	2,300	2,448	38,779	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	2,050	2,197	34,813	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	900	962	15,251	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	1,460	1,638	25,947	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	1,800	1,892	29,980	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	2,900	5,422	85,889	2039/11/15
小計						230,662	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	600	609	15,800	2021/7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	700	723	18,761	2022/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	1,150	1,247	32,352	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	750	816	21,177	2027/7/25

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	2.75 POLAND 280425	2.75	700	776	20,137	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	600	675	17,533	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	990	1,103	28,624	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,600	1,779	46,161	2023/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	500	537	13,945	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	800	896	23,255	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	687	17,827	2029/4/25
小計					255,579	
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	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	550	559	39,611	2032/5/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	350	359	25,442	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	157	11,142	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	700	777	55,025	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	540	618	43,727	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,100	1,204	85,218	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	540	618	43,780	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	650	750	53,063	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	550	640	45,292	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	239	16,944	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	180	214	15,193	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	290	367	25,996	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	650	780	55,228	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	267	18,951	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	377	26,680	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,160	1,411	99,855	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	610	857	60,682	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	765	54,177	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	749	52,997	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	750	790	55,923	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	838	59,301	2022/7/15
小計					944,239	
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	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	120	131	10,038	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	220	224	17,137	2021/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	150	176	13,429	2036/8/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	350	376	28,724	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	200	263	20,086	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	203	15,499	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	200	238	18,165	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	120	144	11,027	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	250	277	21,197	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	230	245	18,695	2022/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	120	156	11,944	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	238	18,210	2027/3/1
小計					204,158	

銘柄	当期末						償還年月日
	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			
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	350	358	8,906	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	257	6,399	2023/3/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	314	7,805	2027/5/31	
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	350	357	8,876	2021/11/30	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	500	529	13,143	2028/6/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	258	6,421	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	350	365	9,071	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	317	7,887	2033/4/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	550	590	14,651	2027/11/16	
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	210	224	5,573	2026/7/15	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	400	428	10,623	2025/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	492	12,219	2021/9/30	
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	218	5,420	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	100	102	2,539	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	426	10,585	2024/7/15	
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,030	1,134	28,153	2031/6/30	
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	221	5,492	2035/5/31	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	328	8,150	2026/4/15	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	250	281	6,981	2030/4/15	
	4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	228	5,675	2033/11/7	
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	400	458	11,371	2046/3/15	
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	550	647	16,074	2037/4/7	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	415	10,305	2043/9/30	
小計					222,331		
イスラエル			千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル			
国債証券	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	600	684	21,025	2028/9/28	
	3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	800	909	27,954	2024/3/31	
	5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	1,000	1,108	34,058	2022/1/31	
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	850	1,496	45,994	2042/1/31	
	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	1,050	1,468	45,126	2026/10/30	
小計					174,158		
合計					46,074,269		

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 46,074,269	% 98.1
コール・ローン等、その他	890,264	1.9
投資信託財産総額	46,964,533	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(46,788,998千円)の投資信託財産総額(46,964,533千円)に対する比率は99.6%です。

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

1 アメリカドル=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 メキシコペソ=4.57円	1 ユーロ=118.10円
1 イギリスポンド=132.43円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 ポーランドズロチ=25.94円	1 オーストラリアドル=70.75円	1 シンガポールドル=76.26円	1 マレーシアリングgit=24.81円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	47,073,274,557
コール・ローン等	521,094,893
公社債(評価額)	46,074,269,151
未収入金	169,109,777
未収利息	267,997,521
前払費用	40,803,215
(B) 負債	202,920,964
未払金	167,933,756
未払解約金	34,986,994
未払利息	214
(C) 純資産総額(A-B)	46,870,353,593
元本	16,674,794,007
次期繰越損益金	30,195,559,586
(D) 受益権総口数	16,674,794,007口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,109円

<注記事項>

- ①期首元本額 19,128,732,358円
 期中追加設定元本額 4,991,395,696円
 期中一部解約元本額 7,445,334,047円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,8109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 ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,532,857,578円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,135,961,536円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,125,384,692円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,991,985,057円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,486,513,245円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,295,600,495円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,036,950,391円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,020,606,287円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	436,288,764円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	364,609,247円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	363,947,965円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	322,692,321円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	185,300,113円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	176,248,811円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	58,883,225円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	36,531,005円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	35,454,608円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	25,456,956円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	23,989,485円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	19,523,979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)	8,247円
合計	16,674,794,007円

○損益の状況 (2019年5月21日~2020年5月20日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,125,776,960
受取利息	1,126,689,612
その他収益金	10,773
支払利息	△ 923,425
(B) 有価証券売買損益	1,554,022,374
売買益	3,542,533,193
売買損	△ 1,988,510,819
(C) 保管費用等	△ 12,201,576
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,667,597,758
(E) 前期繰越損益金	31,926,812,910
(F) 追加信託差損益金	8,748,712,439
(G) 解約差損益金	△13,147,563,521
(H) 計(D+E+F+G)	30,195,559,586
次期繰越損益金(H)	30,195,559,586

- (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。