

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	外国債券インデックスマザーファンド受益証券および三菱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目指して運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券および三菱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。
	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ます。
	外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、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166期（決算日：2021年2月17日）
 第167期（決算日：2021年3月17日）
 第168期（決算日：2021年4月19日）
 第169期（決算日：2021年5月17日）
 第170期（決算日：2021年6月17日）
 第171期（決算日：2021年7月19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19日に第171期の決算を行いましたので、法令に基づいて第166期～第171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）

お客さまのお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)	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	込 み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円
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	
166期(2021年2月17日)	8,978	16	0.9	496.1121	0.6	97.5	—	1,020	
167期(2021年3月17日)	9,034	16	0.8	501.0462	1.0	97.2	—	1,021	
168期(2021年4月19日)	8,990	16	△0.3	501.6195	0.1	97.2	—	1,012	
169期(2021年5月17日)	9,023	16	0.5	503.6709	0.4	100.5	—	1,030	
170期(2021年6月17日)	9,143	16	1.5	510.6443	1.4	97.7	—	1,042	
171期(2021年7月19日)	9,080	16	△0.5	510.7755	0.0	97.6	—	1,037	

(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166期	(期 首) 2021年1月18日	円 8,913	% —	— 493.1226	% —	% 97.4	% —
	1月末	8,983	0.8	496.2129	0.6	97.9	—
	(期 末) 2021年2月17日	8,994	0.9	496.1121	0.6	97.5	—
第167期	(期 首) 2021年2月17日	8,978	—	— 496.1121	—	97.5	—
	2月末	8,882	△1.1	494.1478	△0.4	99.0	—
	(期 末) 2021年3月17日	9,050	0.8	501.0462	1.0	97.2	—
第168期	(期 首) 2021年3月17日	9,034	—	— 501.0462	—	97.2	—
	3月末	9,055	0.2	501.1200	0.0	98.2	—
	(期 末) 2021年4月19日	9,006	△0.3	501.6195	0.1	97.2	—
第169期	(期 首) 2021年4月19日	8,990	—	— 501.6195	—	97.2	—
	4月末	9,029	0.4	502.9265	0.3	97.3	—
	(期 末) 2021年5月17日	9,039	0.5	503.6709	0.4	100.5	—
第170期	(期 首) 2021年5月17日	9,023	—	— 503.6709	—	100.5	—
	5月末	9,128	1.2	510.4449	1.3	98.0	—
	(期 末) 2021年6月17日	9,159	1.5	510.6443	1.4	97.7	—
第171期	(期 首) 2021年6月17日	9,143	—	— 510.6443	—	97.7	—
	6月末	9,090	△0.6	508.6618	△0.4	98.0	—
	(期 末) 2021年7月19日	9,096	△0.5	510.7755	0.0	97.6	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

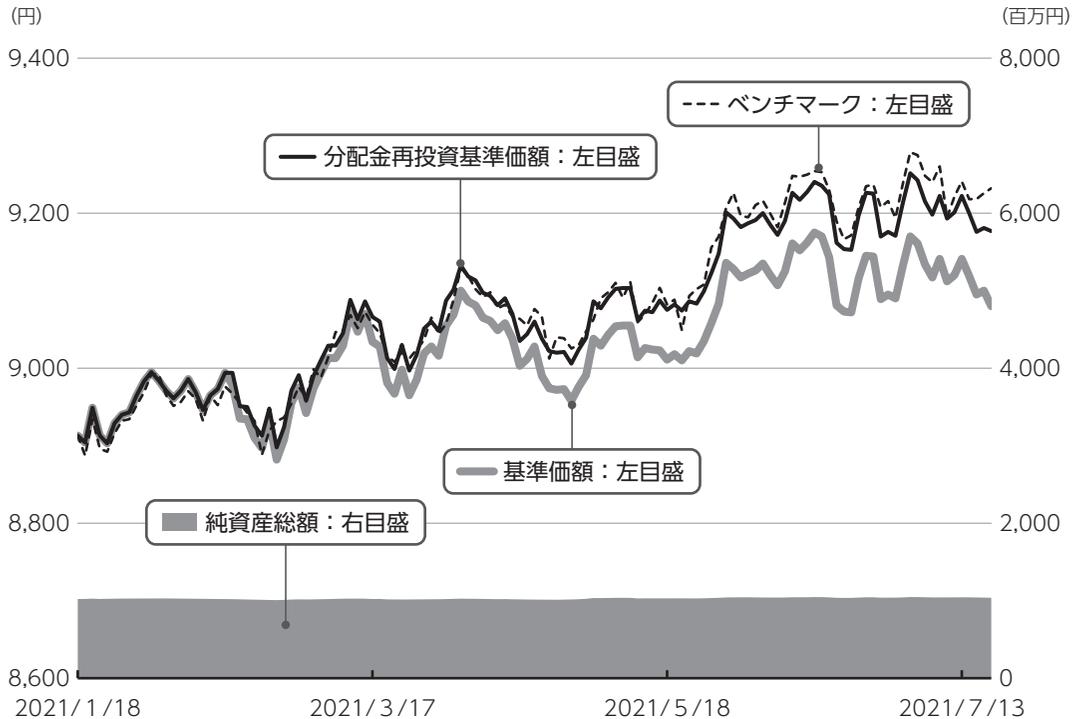
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第166期～第171期：2021年1月19日～2021年7月19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166期首	8,913円
第171期末	9,080円
既払分配金	96円
騰落率	3.0%

(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3.0%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（3.6%）を0.6%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに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166期～第171期：2021年1月19日～2021年7月19日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、新型コロナウイルスのワクチン普及や経済正常化期待を背景とした金利上昇等により、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、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）

資産のほぼ全額を三菱UFJ 外国債券マザーファンドに投資したことにより、基準価額（分配金再投資ベース）は三菱UFJ 外国債券マザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

当期は、投資対象に追加した外国債券インデックスマザーファンドの投資はありません。

※マザーファンドの入替えのため、外国債券インデックスマザーファンドを2021年4月17日に投資対象に追加し、三菱UFJ 外国債券マザーファンドを2021年12月28日に削除する予定です。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

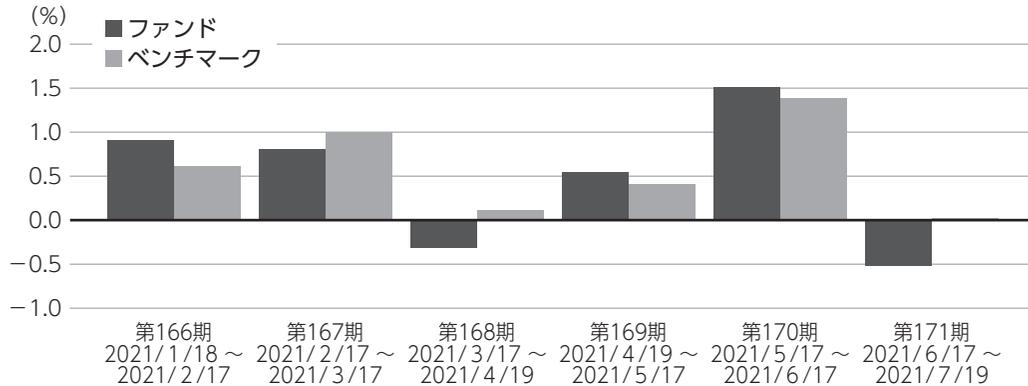
日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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166期～第171期：2021/1/19～2021/7/19

▶ 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 $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.2\%$ 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：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。

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166期 2021年1月19日～ 2021年2月17日	第167期 2021年2月18日～ 2021年3月17日	第168期 2021年3月18日～ 2021年4月19日	第169期 2021年4月20日～ 2021年5月17日	第170期 2021年5月18日～ 2021年6月17日	第171期 2021年6月18日～ 2021年7月19日
当期分配金 （対基準価額比率）	16 (0.178%)	16 (0.177%)	16 (0.178%)	16 (0.177%)	16 (0.175%)	16 (0.176%)
当期の収益	14	13	10	13	15	10
当期の収益以外	1	2	5	2	0	5
翌期繰越分配対象額	1,741	1,739	1,733	1,731	1,730	1,725

（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。

なお、マザーファンドの入替えに伴い、ベンチマークを2021年12月28日にFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に変更する予定です。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年1月19日～2021年7月19日

1万口当たりの費用明細

項目	第166期～第171期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	37	0.411	(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)	(0.219)	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)	(0.165)	交付運用報告書等各种書類の送付、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	0.015	(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
合計	38	0.426	

作成期中の平均基準価額は、9,035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。

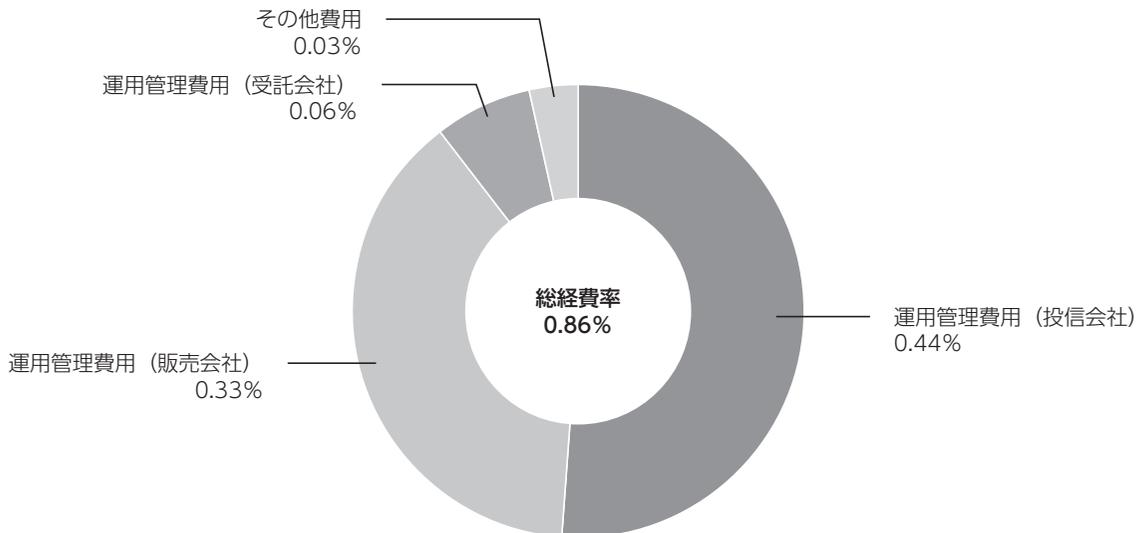
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2021年1月19日～2021年7月19日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第166期～第171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 11,788	千円 34,692	千口 18,164	千円 53,415

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月19日～2021年7月19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166期～第171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 10,906	百万円 4,622	% 42.4	百万円 4,655	百万円 4,570	% 98.2

平均保有割合 1.9%

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

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7月19日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第165期末	第171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 353,513	千口 347,137	千円 1,037,317

○投資信託財産の構成

(2021年7月19日現在)

項 目	第171期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千円 1,037,317	% 99.6
コール・ローン等、その他	3,735	0.4
投資信託財産総額	1,041,052	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 (59,477,561千円) の投資信託財産総額 (59,651,859千円) に対する比率は99.7%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=109.88円	1 カナダドル=86.96円	1 メキシコペソ=5.5109円	1 ユーロ=129.69円
1 イギリスポンド=151.13円	1 スウェーデンクローネ=12.66円	1 ノルウェークローネ=12.37円	1 デンマーククローネ=17.44円
1 ポーランドズロチ=28.2833円	1 オーストラリアドル=81.00円	1 シンガポールドル=80.90円	1 マレーシアリンギット=26.0945円
1 イスラエルシェケル=33.4046円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第166期末	第167期末	第168期末	第169期末	第170期末	第171期末
	2021年2月17日現在	2021年3月17日現在	2021年4月19日現在	2021年5月17日現在	2021年6月17日現在	2021年7月19日現在
(A) 資産	円 1,025,286,031	円 1,026,967,058	円 1,015,823,471	円 1,032,729,859	円 1,045,575,017	円 1,041,052,843
コール・ローン等	1,451,081	1,033,745	975,933	1,171,643	1,056,205	1,014,984
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,020,150,878	1,021,420,224	1,012,277,565	1,029,822,109	1,042,537,088	1,037,317,383
未収入金	3,684,072	4,513,089	2,569,973	1,736,107	1,981,724	2,720,476
(B) 負債	4,823,225	5,231,957	3,189,943	2,547,325	2,719,081	3,371,286
未払収益分配金	1,818,605	1,809,575	1,802,156	1,826,743	1,825,035	1,828,544
未払解約金	2,305,195	2,774,982	623,099	66,422	161,972	785,079
未払信託報酬	695,542	643,804	760,440	650,523	728,008	753,455
未払利息	-	-	-	-	-	1
その他未払費用	3,883	3,596	4,248	3,637	4,066	4,207
(C) 純資産総額(A-B)	1,020,462,806	1,021,735,101	1,012,633,528	1,030,182,534	1,042,855,936	1,037,681,557
元本	1,136,628,276	1,130,984,512	1,126,347,717	1,141,714,589	1,140,647,239	1,142,840,385
次期繰越損益金	△ 116,165,470	△ 109,249,411	△ 113,714,189	△ 111,532,055	△ 97,791,303	△ 105,158,828
(D) 受益権総口数	1,136,628,276口	1,130,984,512口	1,126,347,717口	1,141,714,589口	1,140,647,239口	1,142,840,385口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,978円	9,034円	8,990円	9,023円	9,143円	9,080円

○損益の状況

項 目	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2021年1月19日～ 2021年2月17日	2021年2月18日～ 2021年3月17日	2021年3月18日～ 2021年4月19日	2021年4月20日～ 2021年5月17日	2021年5月18日～ 2021年6月17日	2021年6月18日～ 2021年7月19日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	-	-	-	-	△ 1	△ 9
支払利息	-	-	-	-	△ 1	△ 9
(B) 有価証券売買損益	9,889,040	8,805,202	△ 2,346,851	6,229,093	16,154,256	△ 4,584,631
売買益	10,013,768	8,926,368	27,263	6,308,552	16,251,330	24,426
売買損	△ 124,728	△ 121,166	△ 2,374,114	△ 79,459	△ 97,074	△ 4,609,057
(C) 信託報酬等	△ 699,425	△ 647,400	△ 764,688	△ 654,160	△ 732,074	△ 757,662
(D) 当期損益金 (A+B+C)	9,189,615	8,157,802	△ 3,111,539	5,574,933	15,422,181	△ 5,342,302
(E) 前期繰越損益金	8,565,120	15,758,991	21,882,959	16,864,318	20,476,418	33,918,957
(F) 追加信託差損益金	△132,101,600	△131,356,629	△130,683,453	△132,144,563	△131,864,867	△131,906,939
(配当等相当額)	(99,243,764)	(99,364,095)	(99,547,240)	(102,809,951)	(103,264,212)	(104,075,106)
(売買損益相当額)	(△231,345,364)	(△230,720,724)	(△230,230,693)	(△234,954,514)	(△235,129,079)	(△235,982,045)
(G) 計 (D+E+F)	△114,346,865	△107,439,836	△111,912,033	△109,705,312	△ 95,966,268	△103,330,284
(H) 収益分配金	△ 1,818,605	△ 1,809,575	△ 1,802,156	△ 1,826,743	△ 1,825,035	△ 1,828,544
次期繰越損益金 (G+H)	△116,165,470	△109,249,411	△113,714,189	△111,532,055	△ 97,791,303	△105,158,828
追加信託差損益金	△132,101,600	△131,356,629	△130,683,453	△132,144,563	△131,864,867	△131,906,939
(配当等相当額)	(99,249,623)	(99,366,205)	(99,553,164)	(102,822,803)	(103,268,209)	(104,080,003)
(売買損益相当額)	(△231,351,223)	(△230,722,834)	(△230,236,617)	(△234,967,366)	(△235,133,076)	(△235,986,942)
分配準備積立金	98,745,340	97,346,513	95,752,089	94,844,839	94,168,973	93,083,253
繰越損益金	△ 82,809,210	△ 75,239,295	△ 78,782,825	△ 74,232,331	△ 60,095,409	△ 66,335,142

(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 1,146,786,823円
 作成期中追加設定元本額 58,028,166円
 作成期中一部解約元本額 61,974,604円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9080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105,158,828円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2021年1月19日～ 2021年2月17日	2021年2月18日～ 2021年3月17日	2021年3月18日～ 2021年4月19日	2021年4月20日～ 2021年5月17日	2021年5月18日～ 2021年6月17日	2021年6月18日～ 2021年7月19日
費用控除後の配当等収益額	1,668,662円	1,508,360円	1,195,229円	1,511,671円	1,775,369円	1,170,111円
費用控除後・繰越大損金繰戻後の有価証券売買等損益額	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	99,249,623円	99,366,205円	99,553,164円	102,822,803円	103,268,209円	104,080,003円
分配準備積立金額	98,895,283円	97,647,728円	96,359,016円	95,159,911円	94,218,639円	93,741,686円
当ファンドの分配対象収益額	199,813,568円	198,522,293円	197,107,409円	199,494,385円	199,262,217円	198,991,800円
1万口当たり収益分配対象額	1,757円	1,755円	1,749円	1,747円	1,746円	1,741円
1万口当たり分配金額	16円	16円	16円	16円	16円	16円
収益分配金金額	1,818,605円	1,809,575円	1,802,156円	1,826,743円	1,825,035円	1,828,544円

○分配金のお知らせ

	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171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。

[お 知 ら せ]

投資の対象とするマザーファンドの追加および付随する変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年4月17日)

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第21期》決算日2021年5月20日

[計算期間：2020年5月21日～2021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21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21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
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
21期(2021年5月20日)	29,509	5.0	500.6569	4.5	97.9	—	56,667

(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) 2020年5月20日	円	%		%	%	%
	28,109	—	479.0346	—	98.3	—
5月末	28,230	0.4	481.0488	0.4	99.5	—
6月末	28,679	2.0	488.8139	2.0	97.8	—
7月末	28,964	3.0	494.1351	3.2	98.4	—
8月末	28,936	2.9	492.6490	2.8	99.3	—
9月末	29,073	3.4	494.8770	3.3	97.8	—
10月末	28,642	1.9	488.0379	1.9	97.8	—
11月末	28,936	2.9	493.2010	3.0	100.6	—
12月末	29,177	3.8	497.3313	3.8	98.0	—
2021年1月末	29,138	3.7	496.2129	3.6	97.9	—
2月末	28,879	2.7	494.1478	3.2	99.0	—
3月末	29,516	5.0	501.1200	4.6	98.2	—
4月末	29,503	5.0	502.9265	5.0	97.3	—
(期 末) 2021年5月20日	円	%		%	%	%
	29,509	5.0	500.6569	4.5	97.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

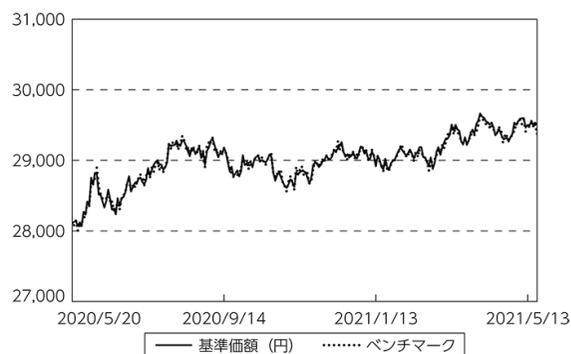
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(4.5%)を0.5%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について**◎ 外国債券市況**

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

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは4.5%の上昇になったため、乖離は0.5%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月21日～2021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	%	(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)	(8)	(0.027)	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	8	0.027	
期中の平均基準価額は、29,014円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年5月21日～2021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 139,377	千アメリカドル 99,417
	カナダ	千カナダドル 6,475	千カナダドル 3,831
	メキシコ	千メキシコペソ 24,447	千メキシコペソ 16,210
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 12,789	9,668
	イタリア	国債証券 18,787	14,001
	フランス	国債証券 18,795	13,623
	オランダ	国債証券 3,000	2,622
	スペイン	国債証券 14,557	9,237
	ベルギー	国債証券 4,747	4,263
国	オーストリア	国債証券 2,554	2,052
	フィンランド	国債証券 751	534
	アイルランド	国債証券 1,278	822
	イギリス	千イギリスポンド 10,932	千イギリスポンド 7,623
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 4,385	千スウェーデンクローネ 536
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 2,393	千ノルウェークローネ 1,888
	デンマーク	千デンマーククローネ 4,516	千デンマーククローネ 3,359
	ポーランド	千ポーランドズロチ 4,298	千ポーランドズロチ 2,323
	オーストラリア	千オーストラリアドル 7,555	千オーストラリアドル 5,229
	シンガポール	千シンガポールドル 925	千シンガポールドル 524
	マレーシア	千マレーシアリングギット 3,346	千マレーシアリングギット 1,695
	イスラエル	千イスラエルシェケル 2,745	千イスラエルシェケル 1,054

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月21日～2021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 17,997	百万円 9,319	% 51.8	百万円 10,542	百万円 8,352	% 79.2

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

(2021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 212,580	千アメリカドル 226,544	千円 24,749,943	% 43.7	% —	% 19.7	% 18.8	% 5.2
カナダ	千カナダドル 12,030	千カナダドル 12,785	1,152,864	2.0	—	0.9	0.8	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 77,400	千メキシコペソ 81,633	447,734	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	25,130	29,943	3,984,935	7.0	—	4.7	2.2	0.2
イタリア	34,230	40,681	5,413,947	9.6	—	6.0	2.8	0.7
フランス	35,490	42,188	5,614,472	9.9	—	6.8	2.9	0.2
オランダ	6,150	7,429	988,723	1.7	—	1.4	0.3	—
スペイン	23,000	27,818	3,702,056	6.5	—	4.4	2.2	—
ベルギー	7,800	9,729	1,294,852	2.3	—	1.8	0.5	—
オーストリア	4,950	5,928	788,917	1.4	—	1.0	0.4	—
フィンランド	2,220	2,392	318,403	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	2,980	3,373	448,894	0.8	—	0.5	0.2	0.0
イギリス	千イギリスポンド 17,960	千イギリスポンド 23,754	3,663,691	6.5	—	5.1	1.1	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 13,690	千スウェーデンクローネ 14,836	194,060	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,750	千ノルウェークローネ 10,002	131,535	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 12,320	千デンマーククローネ 14,961	267,807	0.5	—	0.3	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 10,550	千ポーランドズロチ 11,455	336,866	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 13,520	千オーストラリアドル 14,707	1,242,785	2.2	—	1.5	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,630	千シンガポールドル 2,899	237,480	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 9,720	千マレーシアリンギット 10,304	271,553	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 5,610	千イスラエルシェケル 6,929	231,530	0.4	—	0.3	0.1	—
合 計	—	—	55,483,057	97.9	—	56.4	34.1	7.4

(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 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.125 T-NOTE 220731	0.125	1,500	1,500	163,939	2022/7/31
	0.125 T-NOTE 230515	0.125	2,000	1,998	218,329	2023/5/15
	0.125 T-NOTE 231215	0.125	1,850	1,843	201,417	2023/12/15
	0.25 T-NOTE 230615	0.25	1,300	1,301	142,230	2023/6/15
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	1,870	1,852	202,374	2025/4/30
	0.5 T-NOTE 230315	0.5	1,900	1,912	208,920	2023/3/15
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	3,350	3,232	353,135	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,800	1,730	189,106	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	2,150	2,059	224,969	2027/8/31
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	2,530	2,426	265,054	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	2,470	2,267	247,690	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	3,450	3,152	344,447	2030/8/15
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	3,270	3,047	332,951	2030/11/15
	1.125 T-NOTE 250228	1.125	1,600	1,633	178,507	2025/2/28
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,700	1,739	190,005	2023/7/31
	1.375 T-BOND 500815	1.375	2,410	1,885	205,944	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	3,300	3,357	366,848	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	2,052	224,261	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,650	2,722	297,406	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	1,270	1,308	143,002	2025/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,700	1,742	190,404	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	1,350	1,397	152,718	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	2,120	2,180	238,223	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,529	167,056	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,108	230,375	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	850	874	95,575	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,900	1,964	214,621	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,540	2,636	288,020	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,880	1,949	212,987	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,300	1,344	146,940	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	1,210	1,250	136,602	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	2,360	2,383	260,448	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,550	1,592	173,947	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,000	2,063	225,413	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	2,550	2,658	290,492	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	2,450	2,556	279,257	2024/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,650	1,687	184,332	2022/8/31
	2 T-NOTE 230215	2.0	1,900	1,961	214,272	2023/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,950	2,046	223,589	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	3,600	3,795	414,608	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	1,970	2,079	227,194	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	2,350	2,478	270,747	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,950	2,012	219,861	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	3,700	3,875	423,346	2023/11/30

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	2.125	T-NOTE 240229	2.125	3,000	3,152	344,380	2024/2/29
		2.125	T-NOTE 240331	2.125	3,000	3,154	344,675	2024/3/31
		2.125	T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,477	161,433	2024/7/31
		2.125	T-NOTE 240930	2.125	1,400	1,478	161,565	2024/9/30
		2.125	T-NOTE 250515	2.125	1,870	1,982	216,635	2025/5/15
		2.125	T-NOTE 260531	2.125	1,000	1,061	115,941	2026/5/31
		2.25	T-BOND 460815	2.25	1,050	1,023	111,808	2046/8/15
		2.25	T-BOND 490815	2.25	1,490	1,444	157,790	2049/8/15
		2.25	T-NOTE 231231	2.25	1,520	1,598	174,628	2023/12/31
		2.25	T-NOTE 240131	2.25	2,450	2,579	281,829	2024/1/31
		2.25	T-NOTE 240430	2.25	1,700	1,795	196,128	2024/4/30
		2.25	T-NOTE 241115	2.25	2,300	2,441	266,734	2024/11/15
		2.25	T-NOTE 270215	2.25	1,900	2,028	221,594	2027/2/15
		2.25	T-NOTE 270815	2.25	2,390	2,546	278,252	2027/8/15
		2.25	T-NOTE 271115	2.25	2,390	2,543	277,926	2027/11/15
		2.375	T-NOTE 230131	2.375	1,200	1,245	136,057	2023/1/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	3,290	3,500	382,416	2024/8/15
		2.375	T-NOTE 270515	2.375	1,720	1,846	201,739	2027/5/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	940	963	105,274	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	1,030	1,053	115,085	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	1,050	1,073	117,298	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	1,800	1,891	206,697	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	1,800	1,915	209,293	2024/5/15
		2.5	T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,725	407,036	2026/2/28
		2.625	T-NOTE 230228	2.625	2,100	2,192	239,525	2023/2/28
		2.625	T-NOTE 230630	2.625	1,600	1,682	183,806	2023/6/30
		2.625	T-NOTE 250331	2.625	1,010	1,089	119,053	2025/3/31
		2.625	T-NOTE 251231	2.625	1,600	1,734	189,514	2025/12/31
		2.75	T-BOND 421115	2.75	850	913	99,812	2042/11/15
		2.75	T-BOND 470815	2.75	770	825	90,221	2047/8/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	780	836	91,346	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 230731	2.75	2,700	2,850	311,452	2023/7/31
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	2,350	2,496	272,713	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	2,300	2,454	268,186	2024/2/15
		2.75	T-NOTE 250228	2.75	1,630	1,763	192,636	2025/2/28
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	1,370	1,488	162,605	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	2,410	2,618	286,114	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	2,430	2,663	290,967	2028/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	950	1,040	113,691	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	750	821	89,743	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	890	975	106,549	2046/11/15
		2.875	T-BOND 490515	2.875	1,300	1,430	156,310	2049/5/15
		2.875	T-NOTE 230930	2.875	950	1,009	110,282	2023/9/30
		2.875	T-NOTE 250430	2.875	2,200	2,396	261,812	2025/4/30
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	2,300	2,538	277,325	2028/5/15

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.875 T-NOTE 280815	2.875	2,500	2,761	301,664	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,390	1,554	169,878	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	940	1,051	114,898	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	480	536	58,640	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	600	671	73,385	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	790	886	96,863	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	700	785	85,846	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	1,050	1,179	128,863	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	1,240	1,394	152,387	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	1,250	1,407	153,808	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	1,500	1,648	180,083	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	1,000	1,099	120,128	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	620	706	77,175	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,380	1,574	172,013	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	780	889	97,135	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,060	1,210	132,221	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	1,010	1,160	126,837	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	2,740	3,075	336,049	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	920	1,093	119,414	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	1,270	1,529	167,076	2048/11/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	790	974	106,444	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	970	1,206	131,811	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	730	915	100,005	2043/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,060	1,395	152,419	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	660	872	95,358	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	900	1,194	130,457	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,738	189,914	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,330	1,785	195,085	2040/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	670	889	97,175	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	760	1,023	111,772	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	810	1,098	120,011	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,242	135,696	2040/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	880	1,239	135,369	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,148	125,525	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	800	1,025	112,070	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	760	1,018	111,221	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	1,080	1,391	152,013	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	850	1,055	115,334	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,180	1,544	168,777	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	900	1,021	111,625	2023/8/15
小計					24,749,943	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,360	1,373	123,817	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	430	426	38,475	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	1,230	1,203	108,551	2030/6/1

銘柄		当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,760	1,801	162,450	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	130	133	12,016	2026/6/1	
	2 CAN GOVT 280601	2.0	350	367	33,155	2028/6/1	
	2 CAN GOVT 511201	2.0	740	707	63,835	2051/12/1	
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,850	1,958	176,642	2025/6/1	
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	390	416	37,570	2029/6/1	
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,150	1,218	109,848	2024/6/1	
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	872	78,660	2022/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	250	280	25,254	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	230	262	23,696	2064/12/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	300	378	34,094	2045/12/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	220	290	26,225	2041/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	190	271	24,461	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	370	493	44,469	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	230	328	29,634	2033/6/1	
小計					1,152,864		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	8,653	47,463	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,600	1,993	10,935	2036/11/20	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	13,200	12,937	70,956	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,692	31,222	2022/6/9	
	6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	2,500	2,570	14,097	2023/3/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,100	7,484	41,047	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,100	4,358	23,907	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	1,700	1,786	9,801	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,150	5,173	28,372	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	11,700	12,412	68,080	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	3,800	3,896	21,369	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	7,200	8,018	43,979	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,100	6,654	36,499	2038/11/18	
小計					447,734		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	940	964	128,410	2026/8/15
		0 BUND 290815	—	990	1,010	134,461	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	750	763	101,653	2030/2/15
		0 BUND 350515	—	360	353	47,058	2035/5/15
		0 BUND 500815	—	570	500	66,670	2050/8/15
		0 OBL 231013	—	550	559	74,403	2023/10/13
		0 OBL 240405	—	670	682	90,851	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	1,100	1,123	149,528	2024/10/18
		0.25 BUND 270215	0.25	940	978	130,274	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	800	834	111,077	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	1,000	1,042	138,761	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	1,600	1,667	221,904	2025/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	850	899	119,729	2027/8/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 280215	0.5	760	805	107,242	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	730	769	102,385	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,040	1,110	147,793	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	660	803	106,972	2048/8/15
		1.5 BUND 230515	1.5	800	834	111,113	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,110	1,182	157,342	2024/5/15
		1.75 BUND 240215	1.75	720	768	102,229	2024/2/15
		2 BUND 230815	2.0	730	774	103,036	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	650	970	129,160	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	810	1,231	163,863	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	460	744	99,092	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	680	1,089	144,976	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	500	864	115,047	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	550	755	100,488	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	710	1,154	153,621	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	570	1,058	140,893	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	750	1,166	155,262	2031/1/4
5.625 BUND 280104	5.625	350	492	65,593	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	480	568	75,638	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	390	613	81,580	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	560	802	106,816	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,060	1,069	142,394	2025/2/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	800	815	108,540	2023/10/15
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	600	613	81,580	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	152	20,262	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,350	1,379	183,556	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	630	658	87,614	2026/12/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	650	685	91,168	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	750	796	106,042	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	720	755	100,484	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	422	56,236	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	720	776	103,386	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	730	794	105,797	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	580	632	84,203	2027/8/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	600	660	87,840	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	810	890	118,466	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 231001	2.45	550	583	77,716	2023/10/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	650	733	97,626	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	410	444	59,112	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	730	792	105,476	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	620	682	90,828	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	490	559	74,481	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	800	919	122,345	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	520	581	77,346	2067/3/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	950	1,110	147,843	2029/8/1

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	3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	410	513	68,382	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	430	532	70,843	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	430	557	74,172	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,270	1,544	205,553	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	850	954	126,988	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	350	485	64,623	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,030	1,375	183,066	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	750	819	109,029	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	900	1,014	134,989	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	640	767	102,194	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,250	1,386	184,514	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	770	988	131,591	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	480	736	98,066	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	980	1,160	154,502	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	730	1,048	139,482	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	780	1,185	157,828	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	790	1,209	161,014	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,120	1,519	202,178	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	570	617	82,214	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	660	983	130,838	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	770	1,129	150,304	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	750	1,029	137,019	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	752	100,176	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	700	856	114,016	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 250325	—	1,080	1,098	146,204	2025/3/25
		0 O. A. T 301125	—	1,330	1,306	173,849	2030/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	900	924	123,086	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,220	1,266	168,517	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	1,110	1,155	153,826	2026/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	1,660	1,758	233,986	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	1,460	1,545	205,724	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	660	603	80,356	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,230	1,307	173,985	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	920	987	131,351	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	1,070	1,178	156,865	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	1,090	1,198	159,541	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,080	1,217	161,997	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	870	974	129,733	2050/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,740	1,823	242,625	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,220	1,317	175,275	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	810	960	127,870	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	420	505	67,269	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	740	921	122,642	2048/5/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	850	922	122,702	2024/5/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,950	2,367	315,067	2030/5/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	2.75	1,230	1,463	194,715	2027/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	690	1,046	139,230	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,030	1,226	163,262	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	720	1,121	149,296	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	490	897	119,424	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	440	839	111,713	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	2,060	2,304	306,666	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	950	1,615	214,967	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	720	1,139	151,658	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,230	1,768	235,367	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	830	1,341	178,482	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	850	1,094	145,595	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	840	988	131,608	2023/4/25
		オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 240115	—	90	91
0 NETH GOVT 520115	—			220	186	24,831	2052/1/15
0.25 NETH GOVT 250715	0.25			420	433	57,686	2025/7/15
0.5 NETH GOVT 260715	0.5			420	440	58,572	2026/7/15
0.5 NETH GOVT 400115	0.5			300	307	40,938	2040/1/15
0.75 NETH GOVT 270715	0.75			510	543	72,376	2027/7/15
0.75 NETH GOVT 280715	0.75			1,190	1,273	169,468	2028/7/15
1.75 NETH GOVT 230715	1.75			490	515	68,643	2023/7/15
2 NETH GOVT 240715	2.0			250	270	36,032	2024/7/15
2.5 NETH GOVT 330115	2.5			460	588	78,318	2033/1/15
2.75 NETH GOVT 470115	2.75			390	608	80,991	2047/1/15
3.75 NETH GOVT 420115	3.75			440	737	98,098	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0			450	710	94,504	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	520	721	96,076	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	550	560	74,543	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	750	751	100,049	2030/4/30
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	880	894	118,995	2029/10/31
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	390	337	44,920	2050/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	660	714	95,129	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	670	726	96,654	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	950	1,031	137,220	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	650	706	94,019	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,000	1,087	144,709	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,110	1,191	158,604	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	980	1,080	143,762	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	650	735	97,828	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,000	1,104	147,018	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	930	1,097	146,025	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	350	443	59,027	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,030	1,139	151,704	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	420	549	73,073	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	430	634	84,493	2066/7/30

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	940	1,056	140,639	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	790	1,153	153,501	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	750	840	111,808	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	910	1,097	146,024	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	570	918	122,291	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,070	1,221	162,618	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	620	1,014	134,960	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	550	748	99,604	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	400	703	93,581	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,050	1,623	216,089	2032/7/30
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,170	1,534	204,211	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	780	1,119	148,943	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	300	305	40,713	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	570	599	79,846	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	700	744	99,071	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	500	533	70,941	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	560	601	79,985	2029/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	300	324	43,174	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	380	428	56,989	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	370	422	56,180	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	230	306	40,780	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	100	106	14,116	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	180	240	32,043	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	549	73,114	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	520	691	91,999	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	300	484	64,440	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	270	378	50,416	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	590	968	128,856	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	350	434	57,775	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	490	789	105,035	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	590	821	109,374	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	450	448	59,633	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	250	261	34,817	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	340	354	47,195	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	290	307	40,875	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	410	435	57,971	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	268	35,703	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	250	297	39,546	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	80	98	13,137	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	537	71,554	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	550	581	77,370	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	170	261	34,816	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	220	278	37,123	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	240	373	49,657	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	200	26,667	2062/1/26

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							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	390	614	81,788	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	314	41,803	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	210	294	39,254	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,753	2023/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	160	153	20,368	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	80	66	8,880	2052/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	365	48,633	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	330	345	45,943	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	170	180	24,049	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	130	137	18,312	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	110	121	16,145	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	180	211	28,191	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	124	16,629	2023/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	220	236	31,517	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	60	84	11,298	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	241	32,196	2028/7/4
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	60	71	9,483	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	230	245	32,658	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	420	447	59,504	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	250	270	35,996	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	350	387	51,502	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	230	255	33,963	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	160	179	23,855	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	230	268	35,690	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	210	261	34,813	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	330	396	52,759	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	120	133	17,737	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	162	21,601	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	300	366	48,810	2025/3/13
小 計						22,555,205	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.125 GILT 230131	0.125	800	800	123,514	2023/1/31	
	0.125 GILT 260130	0.125	400	395	61,012	2026/1/30	
	0.375 GILT 301022	0.375	550	525	81,014	2030/10/22	
	0.75 GILT 230722	0.75	330	334	51,651	2023/7/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	630	657	101,470	2027/7/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	580	612	94,499	2026/7/22	
	1.625 GILT 281022	1.625	290	310	47,923	2028/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	320	373	57,583	2071/10/22	
	1.75 GILT 370907	1.75	530	567	87,531	2037/9/7	
	2 GILT 250907	2.0	660	709	109,362	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,250	1,312	202,397	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	500	706	109,004	2065/7/22	
	3.25 GILT 440122	3.25	830	1,133	174,846	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	710	1,014	156,517	2045/1/22	

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	520	937	144,534	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	400	641	98,942	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	400	728	112,322	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	650	804	124,146	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	710	953	147,064	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	560	792	122,235	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	320	474	73,225	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	340	511	78,933	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	630	1,017	156,948	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	710	1,191	183,715	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	560	1,010	155,869	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	600	851	131,393	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	740	1,175	181,248	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	460	624	96,359	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	400	620	95,724	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	1,120	1,322	203,976	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	460	640	98,720	2028/12/7
小	計					3,663,691	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	1,400	1,354	17,714	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	1,050	1,089	14,252	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	1,700	1,758	23,002	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	2,900	3,051	39,919	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	1,640	1,712	22,398	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,750	1,934	25,305	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	1,900	1,975	25,837	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,350	1,959	25,631	2039/3/30
小	計					194,060	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	500	486	6,398	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,400	1,387	18,249	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	714	9,390	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	979	12,880	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,030	13,553	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	1,000	1,026	13,492	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,802	23,696	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	1,750	1,831	24,082	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	700	744	9,791	2024/3/14
小	計					131,535	
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 521115	0.25	920	819	14,664	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,700	1,774	31,769	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	2,900	3,020	54,074	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,200	2,311	41,380	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	1,460	1,599	28,635	2025/11/15

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		
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	千円	
国債証券	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,140	5,434	97,282	2039/11/15
小計					267,807	
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	1.25 POLAND 301025	1.25	340	322	9,471	2030/10/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	900	956	28,115	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	1,160	1,230	36,182	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	1,400	1,511	44,459	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	1,000	1,079	31,730	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,350	2,564	75,404	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,600	1,741	51,213	2023/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,300	1,397	41,105	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	652	19,184	2029/4/25
小計					336,866	
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 AUST GOVT 301221	1.0	830	781	66,039	2030/12/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	1,200	1,133	95,738	2032/5/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	390	315	26,643	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	154	13,093	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	550	588	49,766	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	990	1,068	90,315	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	800	862	72,863	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	540	596	50,386	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	650	716	60,563	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	580	628	53,119	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	320	334	28,268	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	290	310	26,277	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,310	1,451	122,641	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	750	856	72,379	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	237	20,089	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	338	28,573	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,070	1,252	105,833	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	710	912	77,114	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	850	1,035	87,537	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	300	331	27,988	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	799	67,551	2022/7/15
小計					1,242,785	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.75 SINGAPORGVT 230201	1.75	200	204	16,767	2023/2/1
	2.125 SINGAPORGVT 260601	2.125	120	127	10,414	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGVT 360801	2.25	250	264	21,684	2036/8/1
	2.75 SINGAPORGVT 230701	2.75	350	367	30,087	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGVT 420401	2.75	200	231	18,921	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGVT 460301	2.75	250	294	24,153	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGVT 290701	2.875	200	222	18,241	2029/7/1
	2.875 SINGAPORGVT 300901	2.875	290	324	26,584	2030/9/1

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 SINGAPORGOVT 240901	3.0	400	431	35,378	2024/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	220	260	21,314	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	150	170	13,932	2027/3/1
小		計				237,480	
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	356	9,395	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	256	6,760	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	700	725	19,119	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	500	524	13,826	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	256	6,753	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	350	362	9,556	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	302	7,969	2033/4/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	550	582	15,342	2027/11/16
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	430	456	12,019	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	790	834	21,995	2025/9/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	422	11,127	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,030	1,104	29,109	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	207	5,462	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	400	431	11,364	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,070	1,174	30,955	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	216	5,707	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	700	738	19,462	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	900	970	25,563	2037/4/7
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	381	10,061	2043/9/30
小		計				271,553	
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	1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	230	219	7,342	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	1,300	1,438	48,055	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	1,950	2,154	71,981	2024/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,080	1,716	57,354	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	1,050	1,400	46,796	2026/10/30
小		計				231,530	
合		計				55,483,057	

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

○投資信託財産の構成

(2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 55,483,057	% 97.7
コール・ローン等、その他	1,306,116	2.3
投資信託財産総額	56,789,173	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (56,669,025千円) の投資信託財産総額 (56,789,173千円) に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=109.25円	1 カナダドル=90.17円	1 メキシコペソ=5.4847円	1 ユーロ=133.08円
1 イギリスポンド=154.23円	1 スウェーデンクローネ=13.08円	1 ノルウェークローネ=13.15円	1 デンマーククローネ=17.90円
1 ポーランドズロチ=29.4055円	1 オーストラリアドル=84.50円	1 シンガポールドル=81.91円	1 マレーシアリンギット=26.3535円
1 イスラエルシェケル=33.4107円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	56,827,892,484
コール・ローン等	918,473,085
公社債(評価額)	55,483,057,540
未収入金	53,482,719
未収利息	327,422,164
前払費用	45,456,976
(B) 負債	159,904,482
未払金	96,122,337
未払解約金	63,782,129
未払利息	16
(C) 純資産総額(A-B)	56,667,988,002
元本	19,203,331,473
次期繰越損益金	37,464,656,529
(D) 受益権総口数	19,203,331,473口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,509円

<注記事項>

- ①期首元本額 16,674,794,007円
 期中追加設定元本額 6,498,823,027円
 期中一部解約元本額 3,970,285,561円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,9509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)	4,085,864,763円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,696,084,742円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	2,324,959,799円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,145,874,536円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,596,240,774円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,489,715,548円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,336,010,178円
三菱UFJ 外国債券オープン	869,988,688円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	486,643,704円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	447,882,965円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	378,772,761円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	349,057,149円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	227,400,417円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	194,741,830円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	159,198,085円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	149,323,189円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	127,628,782円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	66,808,465円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	57,560,921円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	13,567,258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)	6,919円
合計	19,203,331,473円

○損益の状況 (2020年5月21日~2021年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,098,907,858
受取利息	1,101,615,447
支払利息	△ 2,707,589
(B) 有価証券売買損益	1,314,059,176
売買益	4,132,357,073
売買損	△ 2,818,297,897
(C) 保管費用等	△ 13,599,081
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,399,367,953
(E) 前期繰越損益金	30,195,559,586
(F) 追加信託差損益金	12,399,402,266
(G) 解約差損益金	△ 7,529,673,276
(H) 計(D+E+F+G)	37,464,656,529
次期繰越損益金(H)	37,464,656,529

- (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】

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年4月3日)