

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、円換算ベース）の動きに概ね連動することを目指して運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 | |
| 主要運用対象 | ベビード ファンド | 外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。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 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビード ファンド | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| | マザー ファンド | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、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172期（決算日：2021年8月17日）
 第173期（決算日：2021年9月17日）
 第174期（決算日：2021年10月18日）
 第175期（決算日：2021年11月17日）
 第176期（決算日：2021年12月17日）
 第177期（決算日：2022年1月17日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ世界国債インデックスファンド（毎月分配型）」は、去る1月17日に第177期の決算を行いましたので、法令に基づいて第172期～第177期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-------------------|---------------|------|-----|------|---------------------------------|------|-------|--------|-------|
| | | 税込分配 | み騰落 | 期中率 | (除く日本、円換算ベース) | 期中率 | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 148期(2019年8月19日) | 8,746 | | 16 | 0.9 | 27,391.5986 | 0.9 | 98.0 | — | 1,091 |
| 149期(2019年9月17日) | 8,749 | | 16 | 0.2 | 27,440.3460 | 0.2 | 98.3 | — | 1,088 |
| 150期(2019年10月17日) | 8,832 | | 16 | 1.1 | 27,745.7326 | 1.1 | 98.5 | — | 1,099 |
| 151期(2019年11月18日) | 8,760 | | 16 | △0.6 | 27,621.1880 | △0.4 | 101.8 | — | 1,084 |
| 152期(2019年12月17日) | 8,836 | | 16 | 1.1 | 27,932.5491 | 1.1 | 98.5 | — | 1,094 |
| 153期(2020年1月17日) | 8,890 | | 16 | 0.8 | 28,189.8268 | 0.9 | 98.5 | — | 1,097 |
| 154期(2020年2月17日) | 8,867 | | 16 | △0.1 | 28,184.9946 | △0.0 | 102.0 | — | 1,087 |
| 155期(2020年3月17日) | 8,752 | | 16 | △1.1 | 27,780.2858 | △1.4 | 98.9 | — | 1,055 |
| 156期(2020年4月17日) | 8,852 | | 16 | 1.3 | 28,240.2949 | 1.7 | 98.4 | — | 1,021 |
| 157期(2020年5月18日) | 8,740 | | 16 | △1.1 | 28,003.3987 | △0.8 | 98.3 | — | 1,012 |
| 158期(2020年6月17日) | 8,929 | | 16 | 2.3 | 28,641.0308 | 2.3 | 98.7 | — | 1,035 |
| 159期(2020年7月17日) | 9,034 | | 16 | 1.4 | 29,162.1860 | 1.8 | 98.6 | — | 1,049 |
| 160期(2020年8月17日) | 9,120 | | 16 | 1.1 | 29,417.5145 | 0.9 | 97.7 | — | 1,055 |
| 161期(2020年9月17日) | 8,984 | | 16 | △1.3 | 29,137.6828 | △1.0 | 97.6 | — | 1,036 |
| 162期(2020年10月19日) | 9,015 | | 16 | 0.5 | 29,231.6486 | 0.3 | 97.5 | — | 1,044 |
| 163期(2020年11月17日) | 8,933 | | 16 | △0.7 | 29,014.3177 | △0.7 | 97.4 | — | 1,032 |
| 164期(2020年12月17日) | 8,981 | | 16 | 0.7 | 29,269.8295 | 0.9 | 97.5 | — | 1,036 |
| 165期(2021年1月18日) | 8,913 | | 16 | △0.6 | 29,144.6987 | △0.4 | 97.4 | — | 1,022 |
| 166期(2021年2月17日) | 8,978 | | 16 | 0.9 | 29,460.3495 | 1.1 | 97.5 | — | 1,020 |
| 167期(2021年3月17日) | 9,034 | | 16 | 0.8 | 29,658.4466 | 0.7 | 97.2 | — | 1,021 |
| 168期(2021年4月19日) | 8,990 | | 16 | △0.3 | 29,617.4837 | △0.1 | 97.2 | — | 1,012 |
| 169期(2021年5月17日) | 9,023 | | 16 | 0.5 | 29,785.1093 | 0.6 | 100.5 | — | 1,030 |
| 170期(2021年6月17日) | 9,143 | | 16 | 1.5 | 30,425.4099 | 2.1 | 97.7 | — | 1,042 |
| 171期(2021年7月19日) | 9,080 | | 16 | △0.5 | 30,139.3946 | △0.9 | 97.6 | — | 1,037 |
| 172期(2021年8月17日) | 9,062 | | 16 | △0.0 | 30,157.3670 | 0.1 | 97.5 | — | 1,035 |
| 173期(2021年9月17日) | 9,023 | | 16 | △0.3 | 30,082.5913 | △0.2 | 97.6 | — | 1,030 |
| 174期(2021年10月18日) | 9,189 | | 16 | 2.0 | 30,744.1062 | 2.2 | 97.4 | — | 1,042 |
| 175期(2021年11月17日) | 9,122 | | 16 | △0.6 | 30,606.0300 | △0.4 | 97.5 | — | 1,022 |
| 176期(2021年12月17日) | 9,097 | | 16 | △0.1 | 30,539.1743 | △0.2 | 97.9 | — | 1,019 |
| 177期(2022年1月17日) | 8,966 | | 16 | △1.3 | 30,217.2817 | △1.1 | 98.2 | — | 1,002 |

(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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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、 円換算ベース) | | 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172期 | (期 首) 2021年7月19日 | 円 | % | 30,139.3946 | % | % | % |
| | 7月末 | 9,080 | — | — | — | 97.6 | — |
| | (期 末) 2021年8月17日 | 9,131 | 0.6 | 30,301.4568 | 0.5 | 97.2 | — |
| 第173期 | (期 首) 2021年8月17日 | 9,078 | △0.0 | 30,157.3670 | 0.1 | 97.5 | — |
| | 8月末 | 9,062 | — | 30,157.3670 | — | 97.5 | — |
| | (期 末) 2021年9月17日 | 9,106 | 0.5 | 30,289.2006 | 0.4 | 98.3 | — |
| 第174期 | (期 首) 2021年9月17日 | 9,039 | △0.3 | 30,082.5913 | △0.2 | 97.6 | — |
| | 9月末 | 9,023 | — | 30,082.5913 | — | 97.6 | — |
| | (期 末) 2021年10月18日 | 9,021 | △0.0 | 30,096.0581 | 0.0 | 99.1 | — |
| 第175期 | (期 首) 2021年10月18日 | 9,205 | 2.0 | 30,744.1062 | 2.2 | 97.4 | — |
| | 10月末 | 9,189 | — | 30,744.1062 | — | 97.4 | — |
| | (期 末) 2021年11月17日 | 9,191 | 0.0 | 30,724.0683 | △0.1 | 97.6 | — |
| 第176期 | (期 首) 2021年11月17日 | 9,138 | △0.6 | 30,606.0300 | △0.4 | 97.5 | — |
| | 11月末 | 9,122 | — | 30,606.0300 | — | 97.5 | — |
| | (期 末) 2021年12月17日 | 9,066 | △0.6 | 30,354.9670 | △0.8 | 97.5 | — |
| 第177期 | (期 首) 2021年12月17日 | 9,113 | △0.1 | 30,539.1743 | △0.2 | 97.9 | — |
| | 12月末 | 9,097 | — | 30,539.1743 | — | 97.9 | — |
| | (期 末) 2022年1月17日 | 9,100 | 0.0 | 30,575.7823 | 0.1 | 97.9 | — |
| | | 8,982 | △1.3 | 30,217.2817 | △1.1 | 98.2 | — |

(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るので、「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。

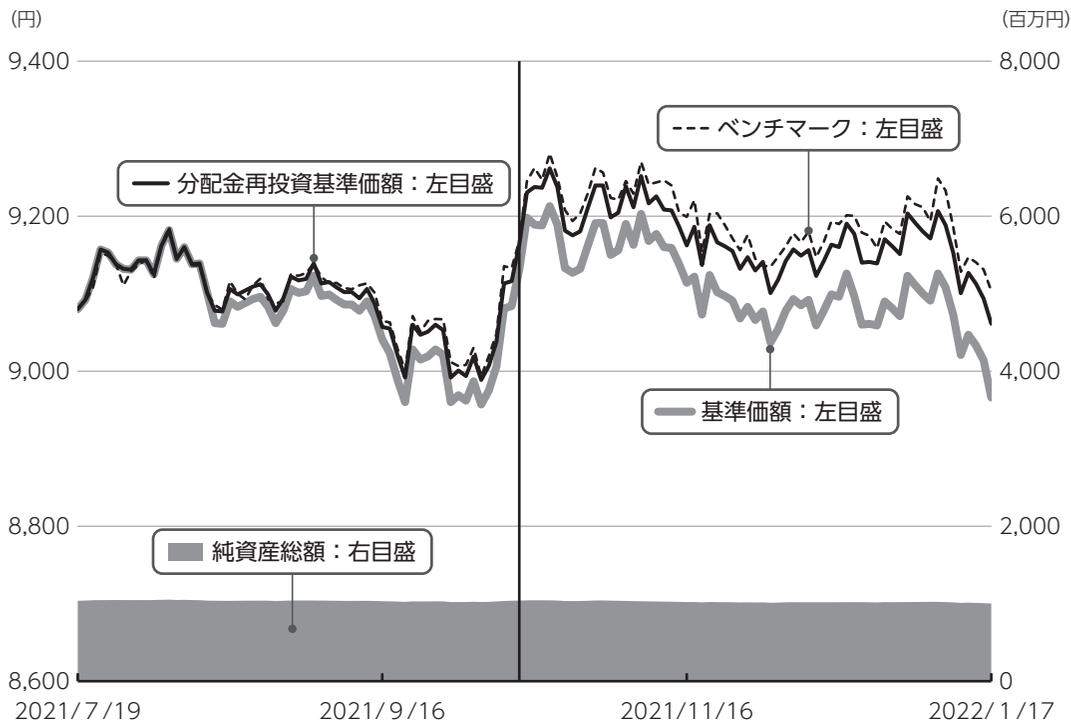
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第172期～第177期：2021年7月20日～2022年1月17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



※2021年10月14日にマザーファンドの入れ替えが終了したため、区切り線を入れております。

| | |
|-------------|--------|
| 第172期首 | 9,080円 |
| 第177期末 | 8,966円 |
| 既払分配金 | 96円 |
| 騰落率 | -0.2% |
| (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す。
 ※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ0.2%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

なお、当作成期中にマザーファンドの入れ替えを行いました。

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（0.3%）を0.5%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172期～第177期：2021年7月20日～2022年1月17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、経済正常化期待や利上げ観測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、外国債券インデックス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、外国債券インデックスマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。なお、2021年10月7日より「三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券」から「外国債券インデックスマザーファンド受益証券」へ投資対象マザーファンドの入れ替えを行い、2021年10月14日に入れ替えを終了しました。

▶ 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。

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。

▶ 外国債券インデックスマザーファンド

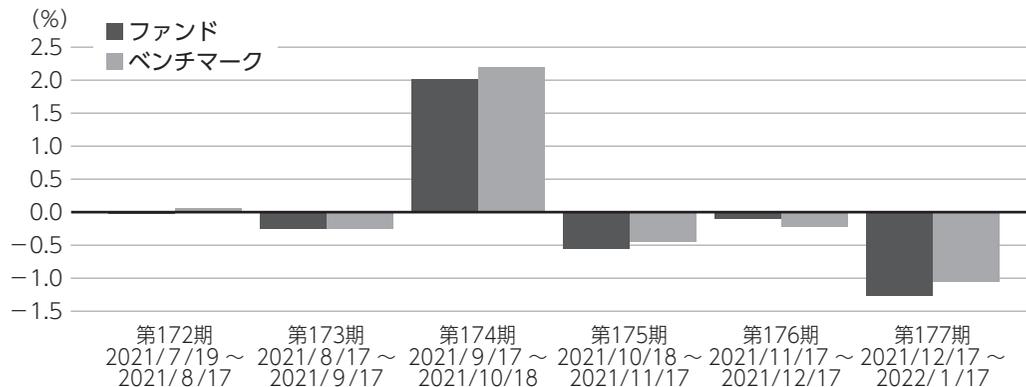
日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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172期～第177期：2021/7/20～2022/1/17

▶ 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 $\Delta 0.5\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

ベンチマーク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：ポートフォリオ要因によるものです。

▶ 外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマーク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172期 2021年7月20日～ 2021年8月17日 | 第173期 2021年8月18日～ 2021年9月17日 | 第174期 2021年9月18日～ 2021年10月18日 | 第175期 2021年10月19日～ 2021年11月17日 | 第176期 2021年11月18日～ 2021年12月17日 | 第177期 2021年12月18日～ 2022年1月17日 |
|--------------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 16 (0.176%) | 16 (0.177%) | 16 (0.174%) | 16 (0.175%) | 16 (0.176%) | 16 (0.178%) |
| 当期の収益 | 9 | 9 | 13 | 8 | 7 | 8 |
| 当期の収益以外 | 6 | 6 | 2 | 7 | 8 | 7 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,718 | 1,711 | 1,709 | 1,702 | 1,694 | 1,686 |

（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。

▶ 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7月20日～2022年1月17日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第172期～第177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種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (2) | (0.027) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) その他費用 | 1 | 0.010 | (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) | (0.008) | 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 | 38 | 0.421 | |

作成期中の平均基準価額は、9,094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。

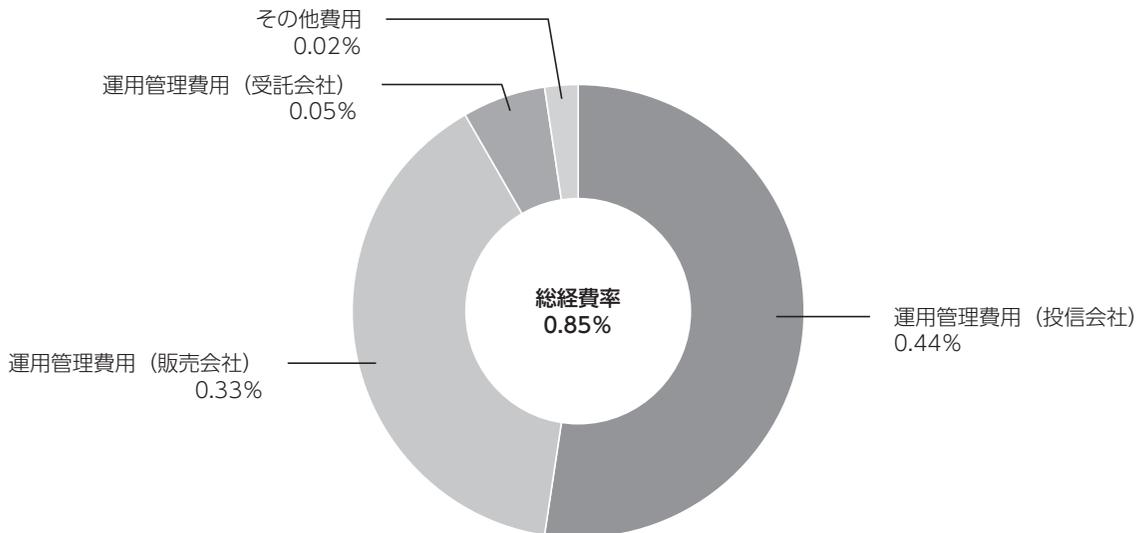
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.85%**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7月20日～2022年1月17日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第172期～第177期 | | | |
|-------------------|-------------|-----------|---------|-----------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド | 3,282 | 9,820 | 350,420 | 1,047,737 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 451,909 | 1,038,407 | 16,621 | 38,693 |

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月20日～2022年1月17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172期～第177期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 3,410 | 百万円 726 | % 21.3 | 百万円 61,385 | 百万円 60,124 | % 97.9 |

平均保有割合 1.8%

※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。

<外国債券インデックスマザーファンド>

| 区分 | 第172期～第177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 | $\frac{D}{C}$ |
| 為替先物取引 | 百万円 9,288 | 百万円 6,142 | % 66.1 | 百万円 6,122 | 百万円 3,078 | % 50.3 |
| 為替直物取引 | 96,757 | 65,278 | 67.5 | 13,805 | 13,396 | 97.0 |

平均保有割合 0.4%

※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

(2022年1月17日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 第171期末 | 第177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 347,137 | 千口 — | 千円 — |
| 外国債券インデックスマザーファンド | — | 435,287 | 1,001,684 |

○投資信託財産の構成

(2022年1月17日現在)

| 項目 | 第177期末 | |
|-------------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千円 1,001,684 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 3,866 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,005,550 | 100.0 |

(注) 外国債券インデックス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 (289,535,233千円) の投資信託財産総額 (294,212,666千円) に対する比率は98.4%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=114.34円 | 1 カナダドル=91.19円 | 1 メキシコペソ=5.6336円 | 1 ユーロ=130.45円 |
| 1 イギリスポンド=156.35円 | 1 スウェーデンクローネ=12.67円 | 1 ノルウェークローネ=13.03円 | 1 デンマーククローネ=17.53円 |
| 1 ポーランドズロチ=28.7374円 | 1 オーストラリアドル=82.45円 | 1 シンガポールドル=84.80円 | 1 マレーシアリンギット=27.3101円 |
| 1 中国元=18.0032円 | 1 イスラエルシェケル=36.7936円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第172期末 | 第173期末 | 第174期末 | 第175期末 | 第176期末 | 第177期末 |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年8月17日現在 | 2021年9月17日現在 | 2021年10月18日現在 | 2021年11月17日現在 | 2021年12月17日現在 | 2022年1月17日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,039,009,160 | 1,032,574,961 | 1,051,147,427 | 1,024,525,993 | 1,022,494,264 | 1,005,550,162 |
| コール・ローン等 | 871,822 | 954,947 | 984,435 | 943,836 | 900,887 | 1,322,777 |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額) | 1,035,455,464 | 1,029,702,712 | — | — | — | — |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | — | — | 1,041,937,162 | 1,021,697,252 | 1,019,642,982 | 1,001,684,342 |
| 未収入金 | 2,681,874 | 1,917,302 | 8,225,830 | 1,884,905 | 1,950,395 | 2,543,043 |
| (B) 負債 | 3,236,539 | 2,557,921 | 8,840,509 | 2,520,108 | 2,540,430 | 3,513,236 |
| 未払収益分配金 | 1,828,789 | 1,826,543 | 1,814,783 | 1,792,598 | 1,793,996 | 1,788,127 |
| 未払解約金 | 718,076 | — | 6,300,463 | 22,090 | 52,374 | 1,007,968 |
| 未払信託報酬 | 685,844 | 727,315 | 721,230 | 701,503 | 690,204 | 713,157 |
| 未払利息 | — | — | 1 | — | — | 1 |
| その他未払費用 | 3,830 | 4,063 | 4,032 | 3,917 | 3,856 | 3,983 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,035,772,621 | 1,030,017,040 | 1,042,306,918 | 1,022,005,885 | 1,019,953,834 | 1,002,036,926 |
| 元本 | 1,142,993,184 | 1,141,589,941 | 1,134,239,634 | 1,120,374,374 | 1,121,247,935 | 1,117,579,701 |
| 次期繰越損益金 | △ 107,220,563 | △ 111,572,901 | △ 91,932,716 | △ 98,368,489 | △ 101,294,101 | △ 115,542,775 |
| (D) 受益権総口数 | 1,142,993,184口 | 1,141,589,941口 | 1,134,239,634口 | 1,120,374,374口 | 1,121,247,935口 | 1,117,579,701口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,062円 | 9,023円 | 9,189円 | 9,122円 | 9,097円 | 8,966円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第172期 | 第173期 | 第174期 | 第175期 | 第176期 | 第177期 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| | 2021年7月20日～ 2021年8月17日 | 2021年8月18日～ 2021年9月17日 | 2021年9月18日～ 2021年10月18日 | 2021年10月19日～ 2021年11月17日 | 2021年11月18日～ 2021年12月17日 | 2021年12月18日～ 2022年1月17日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 3 | △ 1 | △ 6 | △ 6 | △ 9 | △ 2 |
| 支払利息 | △ 3 | △ 1 | △ 6 | △ 6 | △ 9 | △ 2 |
| (B) 有価証券売買損益 | 443,072 | △ 1,940,146 | 21,468,210 | △ 5,053,959 | △ 341,470 | △ 12,070,453 |
| 売買益 | 492,178 | 17,280 | 23,439,437 | 36,787 | 16,451 | 19,570 |
| 売買損 | △ 49,106 | △ 1,957,426 | △ 1,971,227 | △ 5,090,746 | △ 357,921 | △ 12,090,023 |
| (C) 信託報酬等 | △ 689,674 | △ 731,378 | △ 725,262 | △ 705,420 | △ 694,060 | △ 717,140 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | △ 246,605 | △ 2,671,525 | 20,742,942 | △ 5,759,385 | △ 1,035,539 | △ 12,787,595 |
| (E) 前期繰越損益金 | 26,612,483 | 24,373,064 | 19,952,267 | 37,930,958 | 30,221,866 | 27,178,814 |
| (F) 追加信託差損益金 | △131,757,652 | △131,447,897 | △130,513,142 | △128,747,464 | △128,686,432 | △128,145,867 |
| (配当等相当額) | (104,578,370) | (104,954,365) | (104,713,115) | (103,848,293) | (104,448,820) | (104,497,947) |
| (売買損益相当額) | (△236,336,022) | (△236,402,262) | (△235,226,257) | (△232,595,757) | (△233,135,252) | (△232,643,814) |
| (G) 計 (D + E + F) | △105,391,774 | △109,746,358 | △ 90,117,933 | △ 96,575,891 | △ 99,500,105 | △113,754,648 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,828,789 | △ 1,826,543 | △ 1,814,783 | △ 1,792,598 | △ 1,793,996 | △ 1,788,127 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | △107,220,563 | △111,572,901 | △ 91,932,716 | △ 98,368,489 | △101,294,101 | △115,542,775 |
| 追加信託差損益金 | △131,757,652 | △131,447,897 | △130,513,142 | △128,747,464 | △128,686,432 | △128,145,867 |
| (配当等相当額) | (104,581,638) | (104,957,563) | (104,717,061) | (103,850,854) | (104,452,885) | (104,500,949) |
| (売買損益相当額) | (△236,339,290) | (△236,405,460) | (△235,230,203) | (△232,598,318) | (△233,139,317) | (△232,646,816) |
| 分配準備積立金 | 91,831,127 | 90,458,822 | 89,215,403 | 86,867,509 | 85,507,882 | 83,962,001 |
| 繰越損益金 | △ 67,294,038 | △ 70,583,826 | △ 50,634,977 | △ 56,488,534 | △ 58,115,551 | △ 71,358,909 |

(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 1,142,840,385円
 作成期中追加設定元本額 34,790,178円
 作成期中一部解約元本額 60,050,862円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8966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115,542,775円です。
- ③分配金の計算過程

| 項 目 | 2021年7月20日～ 2021年8月17日 | 2021年8月18日～ 2021年9月17日 | 2021年9月18日～ 2021年10月18日 | 2021年10月19日～ 2021年11月17日 | 2021年11月18日～ 2021年12月17日 | 2021年12月18日～ 2022年1月17日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 1,048,653円 | 1,068,117円 | 1,585,094円 | 946,564円 | 883,617円 | 908,757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 | 104,581,638円 | 104,957,563円 | 104,717,061円 | 103,850,854円 | 104,452,885円 | 104,500,949円 |
| 分配準備積立金額 | 92,611,263円 | 91,217,248円 | 89,445,092円 | 87,713,543円 | 86,418,261円 | 84,841,371円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 198,241,554円 | 197,242,928円 | 195,747,247円 | 192,510,961円 | 191,754,763円 | 190,251,077円 |
| 1万円当たり収益分配対象額 | 1,734円 | 1,727円 | 1,725円 | 1,718円 | 1,710円 | 1,702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 | 1,828,789円 | 1,826,543円 | 1,814,783円 | 1,792,598円 | 1,793,996円 | 1,788,127円 |

○分配金のお知らせ

| | 第172期 | 第173期 | 第174期 | 第175期 | 第176期 | 第177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】

- ①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年9月30日)
- ②投資の対象とするマザーファンドの削除および付随する変更（ファンドのベンチマーク変更を含む）を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年12月28日)
- ③「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

外国債券インデックスマザーファンド

《第20期》決算日2021年5月12日

[計算期間：2020年5月13日～2021年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第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 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主要運用対象 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|---------------------------------|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 16期(2017年5月12日) | 19,894 | 1.1 | 111,054.04 | 1.0 | 98.8 | — | 132,430 |
| 17期(2018年5月14日) | 20,178 | 1.4 | 112,563.85 | 1.4 | 98.9 | — | 120,314 |
| 18期(2019年5月13日) | 20,412 | 1.2 | 113,996.81 | 1.3 | 98.7 | — | 137,361 |
| 19期(2020年5月12日) | 21,324 | 4.5 | 119,287.72 | 4.6 | 98.6 | — | 149,310 |
| 20期(2021年5月12日) | 22,636 | 6.2 | 126,522.01 | 6.1 | 97.7 | — | 197,147 |

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------------------------------|-------|----------------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020年5月12日 | 円 | % | 119,287.72 | % | % | % |
| 5月末 | 21,324 | — | 120,973.12 | — | 98.6 | — |
| 6月末 | 21,689 | 1.7 | 123,063.01 | 1.4 | 98.5 | — |
| 7月末 | 22,034 | 3.3 | 123,870.50 | 3.2 | 98.6 | — |
| 8月末 | 22,254 | 4.4 | 124,064.52 | 3.8 | 98.6 | — |
| 9月末 | 22,232 | 4.3 | 124,690.18 | 4.0 | 97.7 | — |
| 10月末 | 22,338 | 4.8 | 124,727.67 | 4.5 | 97.6 | — |
| 11月末 | 22,007 | 3.2 | 124,001.42 | 2.9 | 97.6 | — |
| 12月末 | 22,233 | 4.3 | 125,045.38 | 4.0 | 98.1 | — |
| 2021年1月末 | 22,419 | 5.1 | 125,100.34 | 4.8 | 98.0 | — |
| 2月末 | 22,388 | 5.0 | 124,359.44 | 4.9 | 97.5 | — |
| 3月末 | 22,188 | 4.1 | 126,595.03 | 4.3 | 96.9 | — |
| 4月末 | 22,675 | 6.3 | 126,569.17 | 6.1 | 97.3 | — |
| (期 末) 2021年5月12日 | 22,666 | 6.3 | 126,522.01 | 6.1 | 97.7 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

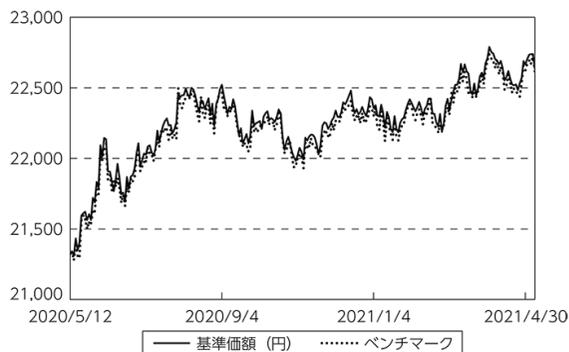
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.1%)を0.1%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

◎ 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

- ・ 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

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.1%の上昇になったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 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13日～2021年5月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (2) | (0.011) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 2 | 0.011 | |
| 期中の平均基準価額は、22,261円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月13日～2021年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 53,450 | 百万円 22,889 | % 42.8 | 百万円 15,522 | 百万円 11,605 | % 74.8 |

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12日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千アメリカドル 745,900 | 千アメリカドル 791,527 | 千円 86,118,145 | % 43.7 | % — | % 19.9 | % 18.4 | % 5.3 |
| カナダ | 千カナダドル 41,220 | 千カナダドル 44,059 | 3,958,295 | 2.0 | — | 0.9 | 0.7 | 0.3 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 258,890 | 千メキシコペソ 277,114 | 1,508,276 | 0.8 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 84,150 | 104,102 | 13,747,828 | 7.0 | — | 4.7 | 2.3 | — |
| イタリア | 121,670 | 143,401 | 18,937,589 | 9.6 | — | 6.0 | 2.6 | 1.0 |
| フランス | 121,490 | 145,132 | 19,166,233 | 9.7 | — | 6.7 | 2.9 | 0.1 |
| オランダ | 22,080 | 26,797 | 3,538,940 | 1.8 | — | 1.4 | 0.4 | — |
| スペイン | 81,600 | 97,583 | 12,886,874 | 6.5 | — | 4.3 | 1.9 | 0.3 |
| ベルギー | 27,480 | 33,751 | 4,457,265 | 2.3 | — | 1.8 | 0.4 | — |
| オーストリア | 16,180 | 19,648 | 2,594,742 | 1.3 | — | 1.0 | 0.3 | — |
| フィンランド | 8,140 | 8,758 | 1,156,609 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 10,400 | 11,767 | 1,553,984 | 0.8 | — | 0.7 | 0.1 | — |
| イギリス | 千イギリスポンド 66,320 | 千イギリスポンド 82,520 | 12,680,141 | 6.4 | — | 4.9 | 1.2 | 0.3 |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローネ 48,070 | 千スウェーデンクローネ 51,639 | 674,934 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 34,610 | 千ノルウェークローネ 35,620 | 468,050 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 44,060 | 千デンマーククローネ 53,168 | 944,270 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| ポーランド | 千ポーランドズロチ 38,930 | 千ポーランドズロチ 42,465 | 1,234,965 | 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 47,250 | 千オーストラリアドル 51,186 | 4,355,450 | 2.2 | — | 1.5 | 0.5 | 0.2 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 9,100 | 千シンガポールドル 9,838 | 806,560 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 33,660 | 千マレーシアリンギット 35,465 | 936,001 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| イスラエル | 千イスラエルシケル 20,930 | 千イスラエルシケル 24,476 | 809,198 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 192,534,359 | 97.7 | — | 56.5 | 33.1 | 8.0 |

(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 | 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 | 0.125 | T-NOTE 230515 | 0.125 | 6,700 | 6,694 | 728,362 | 2023/5/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 230715 | 0.125 | 2,600 | 2,596 | 282,515 | 2023/7/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 230815 | 0.125 | 4,500 | 4,492 | 488,815 | 2023/8/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 230915 | 0.125 | 6,350 | 6,338 | 689,638 | 2023/9/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 231015 | 0.125 | 4,200 | 4,191 | 455,996 | 2023/10/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 231215 | 0.125 | 8,500 | 8,476 | 922,235 | 2023/12/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 240115 | 0.125 | 9,100 | 9,068 | 986,637 | 2024/1/15 |
| | | 0.125 | T-NOTE 240215 | 0.125 | 6,800 | 6,775 | 737,181 | 2024/2/15 |
| | | 0.25 | T-NOTE 231115 | 0.25 | 4,700 | 4,703 | 511,719 | 2023/11/15 |
| | | 0.25 | T-NOTE 250630 | 0.25 | 3,350 | 3,301 | 359,183 | 2025/6/30 |
| | | 0.25 | T-NOTE 250731 | 0.25 | 4,600 | 4,528 | 492,660 | 2025/7/31 |
| | | 0.375 | T-NOTE 240415 | 0.375 | 3,300 | 3,306 | 359,755 | 2024/4/15 |
| | | 0.375 | T-NOTE 251130 | 0.375 | 5,950 | 5,860 | 637,599 | 2025/11/30 |
| | | 0.375 | T-NOTE 260131 | 0.375 | 5,400 | 5,304 | 577,169 | 2026/1/31 |
| | | 0.375 | T-NOTE 270930 | 0.375 | 6,100 | 5,804 | 631,507 | 2027/9/30 |
| | | 0.5 | T-NOTE 270430 | 0.5 | 4,130 | 3,995 | 434,757 | 2027/4/30 |
| | | 0.5 | T-NOTE 270531 | 0.5 | 4,280 | 4,134 | 449,802 | 2027/5/31 |
| | | 0.5 | T-NOTE 270630 | 0.5 | 4,600 | 4,436 | 482,669 | 2027/6/30 |
| | | 0.5 | T-NOTE 270831 | 0.5 | 6,800 | 6,533 | 710,882 | 2027/8/31 |
| | | 0.625 | T-NOTE 271231 | 0.625 | 5,800 | 5,580 | 607,154 | 2027/12/31 |
| | | 0.625 | T-NOTE 300515 | 0.625 | 6,970 | 6,424 | 698,942 | 2030/5/15 |
| | | 0.625 | T-NOTE 300815 | 0.625 | 8,110 | 7,441 | 809,676 | 2030/8/15 |
| | | 0.75 | T-NOTE 260331 | 0.75 | 7,800 | 7,786 | 847,214 | 2026/3/31 |
| | | 0.75 | T-NOTE 280131 | 0.75 | 10,200 | 9,880 | 1,075,036 | 2028/1/31 |
| | | 0.875 | T-NOTE 301115 | 0.875 | 5,570 | 5,214 | 567,335 | 2030/11/15 |
| | | 1.125 | T-NOTE 270228 | 1.125 | 2,950 | 2,969 | 323,078 | 2027/2/28 |
| | | 1.125 | T-NOTE 310215 | 1.125 | 6,000 | 5,730 | 623,526 | 2031/2/15 |
| | | 1.25 | T-BOND 500515 | 1.25 | 5,250 | 4,022 | 437,637 | 2050/5/15 |
| | | 1.25 | T-NOTE 230731 | 1.25 | 2,550 | 2,609 | 283,953 | 2023/7/31 |
| | | 1.375 | T-BOND 500815 | 1.375 | 3,730 | 2,953 | 321,361 | 2050/8/15 |
| | | 1.375 | T-NOTE 230215 | 1.375 | 3,000 | 3,065 | 333,489 | 2023/2/15 |
| | | 1.375 | T-NOTE 230630 | 1.375 | 2,900 | 2,973 | 323,555 | 2023/6/30 |
| | | 1.375 | T-NOTE 230831 | 1.375 | 4,550 | 4,672 | 508,382 | 2023/8/31 |
| | | 1.375 | T-NOTE 230930 | 1.375 | 3,800 | 3,905 | 424,922 | 2023/9/30 |
| | | 1.375 | T-NOTE 250131 | 1.375 | 4,050 | 4,180 | 454,874 | 2025/1/31 |
| | | 1.5 | T-NOTE 230228 | 1.5 | 4,200 | 4,302 | 468,116 | 2023/2/28 |
| | | 1.5 | T-NOTE 230331 | 1.5 | 3,250 | 3,332 | 362,605 | 2023/3/31 |
| | | 1.5 | T-NOTE 240930 | 1.5 | 6,000 | 6,220 | 676,821 | 2024/9/30 |
| | | 1.5 | T-NOTE 241031 | 1.5 | 2,900 | 3,005 | 327,043 | 2024/10/31 |
| | | 1.5 | T-NOTE 241130 | 1.5 | 2,580 | 2,674 | 291,022 | 2024/11/30 |
| | | 1.5 | T-NOTE 260815 | 1.5 | 6,050 | 6,245 | 679,478 | 2026/8/15 |
| | | 1.5 | T-NOTE 270131 | 1.5 | 2,740 | 2,818 | 306,636 | 2027/1/31 |
| | | 1.5 | T-NOTE 300215 | 1.5 | 5,010 | 5,002 | 544,321 | 2030/2/15 |
| | | 1.625 | T-NOTE 220815 | 1.625 | 1,700 | 1,732 | 188,536 | 2022/8/15 |
| | | 1.625 | T-NOTE 220831 | 1.625 | 7,640 | 7,791 | 847,694 | 2022/8/31 |
| | | 1.625 | T-NOTE 221115 | 1.625 | 5,200 | 5,318 | 578,622 | 2022/11/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| 国債証券 | 1.625 T-NOTE 221215 | 1.625 | 3,000 | 3,071 | 334,190 | 2022/12/15 |
| | 1.625 T-NOTE 230531 | 1.625 | 2,800 | 2,883 | 313,707 | 2023/5/31 |
| | 1.625 T-NOTE 231031 | 1.625 | 3,100 | 3,207 | 348,939 | 2023/10/31 |
| | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625 | 5,720 | 5,951 | 647,521 | 2026/2/15 |
| | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625 | 6,280 | 6,530 | 710,567 | 2026/5/15 |
| | 1.625 T-NOTE 260930 | 1.625 | 3,550 | 3,683 | 400,739 | 2026/9/30 |
| | 1.625 T-NOTE 261130 | 1.625 | 3,400 | 3,523 | 383,372 | 2026/11/30 |
| | 1.625 T-NOTE 290815 | 1.625 | 4,810 | 4,878 | 530,789 | 2029/8/15 |
| | 1.75 T-NOTE 220515 | 1.75 | 4,900 | 4,982 | 542,137 | 2022/5/15 |
| | 1.75 T-NOTE 220531 | 1.75 | 3,700 | 3,765 | 409,659 | 2022/5/31 |
| | 1.75 T-NOTE 220630 | 1.75 | 4,900 | 4,992 | 543,209 | 2022/6/30 |
| | 1.75 T-NOTE 220930 | 1.75 | 1,800 | 1,840 | 200,284 | 2022/9/30 |
| | 1.75 T-NOTE 230131 | 1.75 | 2,700 | 2,774 | 301,884 | 2023/1/31 |
| | 1.75 T-NOTE 230515 | 1.75 | 4,800 | 4,952 | 538,825 | 2023/5/15 |
| | 1.75 T-NOTE 241231 | 1.75 | 2,850 | 2,980 | 324,312 | 2024/12/31 |
| | 1.75 T-NOTE 261231 | 1.75 | 3,100 | 3,233 | 351,785 | 2026/12/31 |
| | 1.875 T-NOTE 220531 | 1.875 | 760 | 774 | 84,254 | 2022/5/31 |
| | 1.875 T-NOTE 220731 | 1.875 | 4,500 | 4,597 | 500,233 | 2022/7/31 |
| | 1.875 T-NOTE 220831 | 1.875 | 5,000 | 5,115 | 556,537 | 2022/8/31 |
| | 1.875 T-NOTE 220930 | 1.875 | 3,500 | 3,585 | 390,096 | 2022/9/30 |
| | 1.875 T-NOTE 221031 | 1.875 | 2,700 | 2,769 | 301,344 | 2022/10/31 |
| | 2 T-BOND 500215 | 2.0 | 4,450 | 4,123 | 448,623 | 2050/2/15 |
| | 2 T-NOTE 220731 | 2.0 | 2,900 | 2,967 | 322,865 | 2022/7/31 |
| | 2 T-NOTE 221031 | 2.0 | 2,850 | 2,928 | 318,631 | 2022/10/31 |
| | 2 T-NOTE 221130 | 2.0 | 6,200 | 6,380 | 694,164 | 2022/11/30 |
| | 2 T-NOTE 240430 | 2.0 | 3,600 | 3,780 | 411,279 | 2024/4/30 |
| | 2 T-NOTE 240531 | 2.0 | 3,850 | 4,045 | 440,151 | 2024/5/31 |
| | 2 T-NOTE 240630 | 2.0 | 2,200 | 2,313 | 251,748 | 2024/6/30 |
| | 2 T-NOTE 250215 | 2.0 | 5,300 | 5,597 | 608,985 | 2025/2/15 |
| | 2 T-NOTE 250815 | 2.0 | 6,610 | 6,993 | 760,913 | 2025/8/15 |
| | 2 T-NOTE 261115 | 2.0 | 5,150 | 5,443 | 592,231 | 2026/11/15 |
| | 2.125 T-NOTE 220630 | 2.125 | 3,300 | 3,376 | 367,363 | 2022/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 221231 | 2.125 | 5,150 | 5,317 | 578,552 | 2022/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 240229 | 2.125 | 4,550 | 4,785 | 520,681 | 2024/2/29 |
| | 2.125 T-NOTE 240331 | 2.125 | 6,460 | 6,800 | 739,912 | 2024/3/31 |
| | 2.125 T-NOTE 240731 | 2.125 | 3,450 | 3,645 | 396,576 | 2024/7/31 |
| | 2.125 T-NOTE 240930 | 2.125 | 2,250 | 2,381 | 259,057 | 2024/9/30 |
| | 2.125 T-NOTE 241130 | 2.125 | 1,900 | 2,012 | 218,953 | 2024/11/30 |
| | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 5,300 | 5,632 | 612,792 | 2025/5/15 |
| | 2.25 T-BOND 460815 | 2.25 | 3,400 | 3,342 | 363,706 | 2046/8/15 |
| | 2.25 T-BOND 490815 | 2.25 | 4,160 | 4,076 | 443,502 | 2049/8/15 |
| | 2.25 T-NOTE 240131 | 2.25 | 3,300 | 3,478 | 378,450 | 2024/1/31 |
| | 2.25 T-NOTE 240430 | 2.25 | 5,000 | 5,287 | 575,237 | 2024/4/30 |
| | 2.25 T-NOTE 241031 | 2.25 | 2,800 | 2,975 | 323,763 | 2024/10/31 |
| | 2.25 T-NOTE 241115 | 2.25 | 7,250 | 7,708 | 838,685 | 2024/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 251115 | 2.25 | 6,490 | 6,946 | 755,760 | 2025/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 270215 | 2.25 | 5,350 | 5,724 | 622,848 | 2027/2/15 |

| 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 | |
| アメリカ | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | 2.25 T-NOTE 270815 | 2.25 | 7,300 | 7,801 | 848,812 | 2027/8/15 |
| | 2.25 T-NOTE 271115 | 2.25 | 5,700 | 6,084 | 662,020 | 2027/11/15 |
| | 2.375 T-BOND 491115 | 2.375 | 3,700 | 3,725 | 405,296 | 2049/11/15 |
| | 2.375 T-NOTE 230131 | 2.375 | 5,000 | 5,191 | 564,867 | 2023/1/31 |
| | 2.375 T-NOTE 240815 | 2.375 | 7,300 | 7,775 | 845,989 | 2024/8/15 |
| | 2.375 T-NOTE 270515 | 2.375 | 6,140 | 6,613 | 719,517 | 2027/5/15 |
| | 2.375 T-NOTE 290515 | 2.375 | 4,650 | 4,987 | 542,638 | 2029/5/15 |
| | 2.5 T-BOND 450215 | 2.5 | 4,240 | 4,383 | 476,917 | 2045/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 3,720 | 3,839 | 417,747 | 2046/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460515 | 2.5 | 3,300 | 3,404 | 370,414 | 2046/5/15 |
| | 2.5 T-NOTE 230815 | 2.5 | 3,900 | 4,102 | 446,381 | 2023/8/15 |
| | 2.5 T-NOTE 240131 | 2.5 | 6,400 | 6,789 | 738,670 | 2024/1/31 |
| | 2.5 T-NOTE 240515 | 2.5 | 5,700 | 6,075 | 661,027 | 2024/5/15 |
| | 2.5 T-NOTE 250131 | 2.5 | 2,450 | 2,632 | 286,395 | 2025/1/31 |
| | 2.625 T-NOTE 230228 | 2.625 | 3,000 | 3,133 | 340,947 | 2023/2/28 |
| | 2.625 T-NOTE 230630 | 2.625 | 2,600 | 2,735 | 297,653 | 2023/6/30 |
| | 2.625 T-NOTE 250331 | 2.625 | 3,800 | 4,105 | 446,709 | 2025/3/31 |
| | 2.625 T-NOTE 251231 | 2.625 | 4,900 | 5,327 | 579,580 | 2025/12/31 |
| | 2.625 T-NOTE 260131 | 2.625 | 4,800 | 5,219 | 567,854 | 2026/1/31 |
| | 2.625 T-NOTE 290215 | 2.625 | 5,470 | 5,969 | 649,511 | 2029/2/15 |
| | 2.75 T-BOND 420815 | 2.75 | 2,450 | 2,662 | 289,717 | 2042/8/15 |
| | 2.75 T-BOND 421115 | 2.75 | 2,930 | 3,180 | 346,054 | 2042/11/15 |
| | 2.75 T-BOND 470815 | 2.75 | 3,060 | 3,307 | 359,900 | 2047/8/15 |
| | 2.75 T-BOND 471115 | 2.75 | 2,920 | 3,158 | 343,670 | 2047/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 230430 | 2.75 | 3,600 | 3,782 | 411,570 | 2023/4/30 |
| | 2.75 T-NOTE 230531 | 2.75 | 6,400 | 6,740 | 733,393 | 2023/5/31 |
| | 2.75 T-NOTE 231115 | 2.75 | 8,050 | 8,559 | 931,264 | 2023/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 240215 | 2.75 | 5,960 | 6,368 | 692,927 | 2024/2/15 |
| | 2.75 T-NOTE 250228 | 2.75 | 4,050 | 4,391 | 477,767 | 2025/2/28 |
| | 2.75 T-NOTE 250630 | 2.75 | 3,800 | 4,136 | 450,100 | 2025/6/30 |
| | 2.75 T-NOTE 250831 | 2.75 | 5,840 | 6,364 | 692,403 | 2025/8/31 |
| | 2.75 T-NOTE 280215 | 2.75 | 7,660 | 8,420 | 916,097 | 2028/2/15 |
| | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875 | 4,100 | 4,537 | 493,719 | 2043/5/15 |
| | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875 | 2,350 | 2,595 | 282,416 | 2045/8/15 |
| | 2.875 T-BOND 461115 | 2.875 | 3,080 | 3,404 | 370,381 | 2046/11/15 |
| | 2.875 T-BOND 490515 | 2.875 | 3,580 | 3,976 | 432,653 | 2049/5/15 |
| | 2.875 T-NOTE 230930 | 2.875 | 6,400 | 6,806 | 740,574 | 2023/9/30 |
| | 2.875 T-NOTE 231031 | 2.875 | 5,200 | 5,539 | 602,711 | 2023/10/31 |
| | 2.875 T-NOTE 250430 | 2.875 | 3,800 | 4,149 | 451,489 | 2025/4/30 |
| | 2.875 T-NOTE 250531 | 2.875 | 4,230 | 4,621 | 502,812 | 2025/5/31 |
| | 2.875 T-NOTE 251130 | 2.875 | 3,800 | 4,173 | 454,057 | 2025/11/30 |
| | 2.875 T-NOTE 280515 | 2.875 | 6,050 | 6,704 | 729,412 | 2028/5/15 |
| | 2.875 T-NOTE 280815 | 2.875 | 7,610 | 8,437 | 917,977 | 2028/8/15 |
| | 3 T-BOND 420515 | 3.0 | 1,810 | 2,047 | 222,774 | 2042/5/15 |
| | 3 T-BOND 441115 | 3.0 | 2,400 | 2,705 | 294,371 | 2044/11/15 |
| | 3 T-BOND 450515 | 3.0 | 2,020 | 2,278 | 247,926 | 2045/5/15 |
| | 3 T-BOND 451115 | 3.0 | 1,500 | 1,694 | 184,352 | 2045/11/15 |

| 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 | 3 T-BOND 470215 | 3.0 | 3,150 | 3,564 | 387,768 | 2047/2/15 |
| | 3 T-BOND 470515 | 3.0 | 2,750 | 3,111 | 338,493 | 2047/5/15 |
| | 3 T-BOND 480215 | 3.0 | 3,470 | 3,932 | 427,883 | 2048/2/15 |
| | 3 T-BOND 480815 | 3.0 | 3,980 | 4,518 | 491,600 | 2048/8/15 |
| | 3 T-BOND 490215 | 3.0 | 4,090 | 4,650 | 505,969 | 2049/2/15 |
| | 3 T-NOTE 250930 | 3.0 | 4,900 | 5,399 | 587,494 | 2025/9/30 |
| | 3 T-NOTE 251031 | 3.0 | 4,800 | 5,291 | 575,749 | 2025/10/31 |
| | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125 | 2,050 | 2,363 | 257,105 | 2041/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125 | 2,180 | 2,515 | 273,725 | 2042/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 2,950 | 3,395 | 369,392 | 2044/8/15 |
| | 3.125 T-BOND 480515 | 3.125 | 3,630 | 4,209 | 457,980 | 2048/5/15 |
| | 3.125 T-NOTE 281115 | 3.125 | 8,450 | 9,523 | 1,036,183 | 2028/11/15 |
| | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375 | 3,840 | 4,599 | 500,420 | 2044/5/15 |
| | 3.375 T-BOND 481115 | 3.375 | 3,770 | 4,577 | 498,075 | 2048/11/15 |
| | 3.625 T-BOND 430815 | 3.625 | 2,420 | 3,005 | 327,021 | 2043/8/15 |
| | 3.75 T-BOND 410815 | 3.75 | 1,650 | 2,076 | 225,956 | 2041/8/15 |
| | 3.75 T-BOND 431115 | 3.75 | 2,650 | 3,352 | 364,747 | 2043/11/15 |
| | 3.875 T-BOND 400815 | 3.875 | 1,220 | 1,555 | 169,207 | 2040/8/15 |
| | 4.25 T-BOND 390515 | 4.25 | 3,400 | 4,513 | 491,068 | 2039/5/15 |
| | 4.25 T-BOND 401115 | 4.25 | 1,850 | 2,473 | 269,164 | 2040/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 380215 | 4.375 | 2,920 | 3,902 | 424,570 | 2038/2/15 |
| | 4.375 T-BOND 391115 | 4.375 | 2,750 | 3,714 | 404,107 | 2039/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 400515 | 4.375 | 4,200 | 5,689 | 619,037 | 2040/5/15 |
| | 4.375 T-BOND 410515 | 4.375 | 1,660 | 2,261 | 246,036 | 2041/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 360215 | 4.5 | 2,410 | 3,218 | 350,191 | 2036/2/15 |
| | 4.5 T-BOND 380515 | 4.5 | 2,930 | 3,973 | 432,300 | 2038/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 390815 | 4.5 | 2,830 | 3,873 | 421,419 | 2039/8/15 |
| | 4.625 T-BOND 400215 | 4.625 | 2,700 | 3,762 | 409,336 | 2040/2/15 |
| | 4.75 T-BOND 410215 | 4.75 | 2,080 | 2,958 | 321,917 | 2041/2/15 |
| | 5 T-BOND 370515 | 5.0 | 3,040 | 4,309 | 468,918 | 2037/5/15 |
| | 5.25 T-BOND 281115 | 5.25 | 780 | 1,000 | 108,818 | 2028/11/15 |
| | 5.25 T-BOND 290215 | 5.25 | 1,030 | 1,326 | 144,317 | 2029/2/15 |
| | 5.375 T-BOND 310215 | 5.375 | 2,770 | 3,729 | 405,798 | 2031/2/15 |
| | 5.5 T-BOND 280815 | 5.5 | 3,550 | 4,591 | 499,516 | 2028/8/15 |
| | 6 T-BOND 260215 | 6.0 | 3,700 | 4,612 | 501,847 | 2026/2/15 |
| | 6.125 T-BOND 271115 | 6.125 | 2,300 | 3,022 | 328,870 | 2027/11/15 |
| | 6.25 T-BOND 230815 | 6.25 | 3,630 | 4,126 | 449,017 | 2023/8/15 |
| | 6.25 T-BOND 300515 | 6.25 | 1,150 | 1,614 | 175,695 | 2030/5/15 |
| 小 | 計 | | | | 86,118,145 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 220801 | 0.25 | 1,200 | 1,200 | 107,863 | 2022/8/1 |
| | 0.5 CAN GOVT 301201 | 0.5 | 2,200 | 1,997 | 179,466 | 2030/12/1 |
| | 1 CAN GOVT 220901 | 1.0 | 2,350 | 2,374 | 213,300 | 2022/9/1 |
| | 1 CAN GOVT 270601 | 1.0 | 1,200 | 1,194 | 107,335 | 2027/6/1 |
| | 1.25 CAN GOVT 250301 | 1.25 | 2,100 | 2,147 | 192,953 | 2025/3/1 |
| | 1.5 CAN GOVT 230601 | 1.5 | 1,650 | 1,690 | 151,897 | 2023/6/1 |
| | 1.5 CAN GOVT 240901 | 1.5 | 2,000 | 2,062 | 185,314 | 2024/9/1 |

| 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 | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | | |
| 国債証券 | 1.5 CAN GOVT 260601 | 1.5 | 1,440 | 1,481 | 133,116 | 2026/6/1 | |
| | 1.75 CAN GOVT 230301 | 1.75 | 2,900 | 2,977 | 267,491 | 2023/3/1 | |
| | 2 CAN GOVT 230901 | 2.0 | 3,000 | 3,113 | 279,743 | 2023/9/1 | |
| | 2 CAN GOVT 280601 | 2.0 | 2,300 | 2,423 | 217,720 | 2028/6/1 | |
| | 2 CAN GOVT 511201 | 2.0 | 3,050 | 2,954 | 265,459 | 2051/12/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 240301 | 2.25 | 1,800 | 1,891 | 169,929 | 2024/3/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 250601 | 2.25 | 2,000 | 2,124 | 190,892 | 2025/6/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 290601 | 2.25 | 1,820 | 1,949 | 175,117 | 2029/6/1 | |
| | 2.5 CAN GOVT 240601 | 2.5 | 2,700 | 2,865 | 257,408 | 2024/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 220601 | 2.75 | 850 | 872 | 78,430 | 2022/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 481201 | 2.75 | 860 | 975 | 87,654 | 2048/12/1 | |
| | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75 | 410 | 475 | 42,730 | 2064/12/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 1,130 | 1,440 | 129,409 | 2045/12/1 | |
| | 4 CAN GOVT 410601 | 4.0 | 810 | 1,082 | 97,209 | 2041/6/1 | |
| | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 600 | 862 | 77,460 | 2037/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 290601 | 5.75 | 1,930 | 2,579 | 231,771 | 2029/6/1 | |
| 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 920 | 1,320 | 118,617 | 2033/6/1 | | |
| 小 計 | | | | | 3,958,295 | | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | |
| 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 10.0 | 37,300 | 42,571 | 231,710 | 2024/12/5 | |
| | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 10,600 | 13,223 | 71,970 | 2036/11/20 | |
| | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 27,700 | 27,434 | 149,319 | 2026/3/5 | |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 19,400 | 19,757 | 107,536 | 2022/6/9 | |
| | 6.75 MEXICAN BONO 230309 | 6.75 | 13,500 | 13,932 | 75,833 | 2023/3/9 | |
| | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 33,150 | 35,257 | 191,899 | 2027/6/3 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 11,650 | 12,428 | 67,647 | 2031/5/29 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 9,500 | 9,987 | 54,358 | 2034/11/23 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 15,240 | 15,238 | 82,939 | 2042/11/13 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 23,450 | 25,063 | 136,413 | 2023/12/7 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 8.0 | 15,800 | 16,083 | 87,539 | 2047/11/7 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 27,000 | 30,254 | 164,669 | 2029/5/31 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 14,600 | 15,880 | 86,436 | 2038/11/18 | |
| 小 計 | | | | | 1,508,276 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 BUND 350515 | — | 1,120 | 1,107 | 146,266 | 2035/5/15 |
| | | 0 BUND 500815 | — | 1,450 | 1,286 | 169,850 | 2050/8/15 |
| | | 0.25 BUND 270215 | 0.25 | 3,450 | 3,601 | 475,650 | 2027/2/15 |
| | | 0.25 BUND 280815 | 0.25 | 4,350 | 4,552 | 601,207 | 2028/8/15 |
| | | 0.25 BUND 290215 | 0.25 | 4,700 | 4,917 | 649,456 | 2029/2/15 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 3,900 | 4,070 | 537,530 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 4,600 | 4,839 | 639,106 | 2026/2/15 |
| | | 0.5 BUND 270815 | 0.5 | 2,620 | 2,780 | 367,232 | 2027/8/15 |
| | | 0.5 BUND 280215 | 0.5 | 2,220 | 2,360 | 311,724 | 2028/2/15 |
| | | 1 BUND 240815 | 1.0 | 2,770 | 2,922 | 385,996 | 2024/8/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 4,200 | 4,492 | 593,329 | 2025/8/15 |
| | | 1.25 BUND 480815 | 1.25 | 2,550 | 3,129 | 413,333 | 2048/8/15 |
| | | 1.5 BUND 230515 | 1.5 | 3,600 | 3,760 | 496,595 | 2023/5/15 |

| 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 | 1.5 BUND 240515 | 1.5 | 3,300 | 3,519 | 464,730 | 2024/5/15 |
| | | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 5,950 | 6,355 | 839,269 | 2024/2/15 |
| | | 2 BUND 230815 | 2.0 | 1,450 | 1,539 | 203,281 | 2023/8/15 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 2,550 | 3,834 | 506,438 | 2044/7/4 |
| | | 2.5 BUND 460815 | 2.5 | 2,520 | 3,858 | 509,579 | 2046/8/15 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 1,930 | 3,146 | 415,578 | 2042/7/4 |
| | | 4 BUND 370104 | 4.0 | 2,570 | 4,144 | 547,339 | 2037/1/4 |
| | | 4.25 BUND 390704 | 4.25 | 1,650 | 2,871 | 379,258 | 2039/7/4 |
| | | 4.75 BUND 280704 | 4.75 | 2,680 | 3,687 | 486,976 | 2028/7/4 |
| | | 4.75 BUND 340704 | 4.75 | 2,720 | 4,449 | 587,565 | 2034/7/4 |
| | | 4.75 BUND 400704 | 4.75 | 1,870 | 3,497 | 461,815 | 2040/7/4 |
| | | 5.5 BUND 310104 | 5.5 | 3,280 | 5,123 | 676,639 | 2031/1/4 |
| | | 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 2,880 | 4,065 | 536,928 | 2028/1/4 |
| | | 6.25 BUND 240104 | 6.25 | 2,530 | 3,001 | 396,356 | 2024/1/4 |
| | | 6.25 BUND 300104 | 6.25 | 2,640 | 4,164 | 549,996 | 2030/1/4 |
| 6.5 BUND 270704 | 6.5 | 2,100 | 3,019 | 398,792 | 2027/7/4 | | |
| イタリア | 国債証券 | 0.35 ITALY GOVT 250201 | 0.35 | 1,900 | 1,923 | 253,974 | 2025/2/1 |
| | | 0.5 ITALY GOVT 260201 | 0.5 | 1,850 | 1,876 | 247,755 | 2026/2/1 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 231015 | 0.65 | 2,720 | 2,777 | 366,746 | 2023/10/15 |
| | | 0.85 ITALY GOVT 270115 | 0.85 | 2,660 | 2,732 | 360,911 | 2027/1/15 |
| | | 0.9 ITALY GOVT 220801 | 0.9 | 3,200 | 3,249 | 429,110 | 2022/8/1 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95 | 2,680 | 2,741 | 361,999 | 2023/3/15 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 370301 | 0.95 | 680 | 631 | 83,420 | 2037/3/1 |
| | | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25 | 2,050 | 2,154 | 284,460 | 2026/12/1 |
| | | 1.35 ITALY GOVT 300401 | 1.35 | 2,180 | 2,277 | 300,715 | 2030/4/1 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45 | 1,400 | 1,433 | 189,348 | 2022/9/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 241115 | 1.45 | 1,600 | 1,682 | 222,185 | 2024/11/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 250515 | 1.45 | 1,600 | 1,687 | 222,895 | 2025/5/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 360301 | 1.45 | 1,280 | 1,291 | 170,581 | 2036/3/1 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 250601 | 1.5 | 1,850 | 1,956 | 258,373 | 2025/6/1 |
| | | 1.6 ITALY GOVT 260601 | 1.6 | 2,090 | 2,231 | 294,650 | 2026/6/1 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 301201 | 1.65 | 1,900 | 2,028 | 267,908 | 2030/12/1 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65 | 2,220 | 2,358 | 311,411 | 2032/3/1 |
| | | 1.7 ITALY GOVT 510901 | 1.7 | 550 | 514 | 67,974 | 2051/9/1 |
| | | 1.8 ITALY GOVT 410301 | 1.8 | 1,230 | 1,252 | 165,371 | 2041/3/1 |
| | | 1.85 ITALY GOVT 240515 | 1.85 | 1,270 | 1,344 | 177,618 | 2024/5/15 |
| | | 2 ITALY GOVT 251201 | 2.0 | 1,760 | 1,906 | 251,821 | 2025/12/1 |
| | | 2 ITALY GOVT 280201 | 2.0 | 2,200 | 2,412 | 318,595 | 2028/2/1 |
| | | 2.05 ITALY GOVT 270801 | 2.05 | 1,950 | 2,140 | 282,734 | 2027/8/1 |
| | | 2.1 ITALY GOVT 260715 | 2.1 | 1,650 | 1,804 | 238,335 | 2026/7/15 |
| | | 2.2 ITALY GOVT 270601 | 2.2 | 1,900 | 2,103 | 277,733 | 2027/6/1 |
| | | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25 | 1,350 | 1,506 | 198,961 | 2036/9/1 |
| | | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45 | 1,810 | 2,070 | 273,365 | 2033/9/1 |
| | | 2.45 ITALY GOVT 500901 | 2.45 | 1,460 | 1,616 | 213,534 | 2050/9/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 241201 | 2.5 | 2,300 | 2,504 | 330,755 | 2024/12/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 251115 | 2.5 | 1,710 | 1,890 | 249,639 | 2025/11/15 |
| 2.7 ITALY GOVT 470301 | 2.7 | 1,490 | 1,737 | 229,419 | 2047/3/1 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | 2.8 ITALY GOVT 281201 | 2.8 | 1,750 | 2,027 | 267,712 | 2028/12/1 |
| | | 2.8 ITALY GOVT 670301 | 2.8 | 1,440 | 1,648 | 217,740 | 2067/3/1 |
| | | 2.95 ITALY GOVT 380901 | 2.95 | 1,250 | 1,517 | 200,417 | 2038/9/1 |
| | | 3 ITALY GOVT 290801 | 3.0 | 1,850 | 2,183 | 288,311 | 2029/8/1 |
| | | 3.1 ITALY GOVT 400301 | 3.1 | 1,090 | 1,349 | 178,256 | 2040/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 1,540 | 1,968 | 259,944 | 2046/9/1 |
| | | 3.35 ITALY GOVT 350301 | 3.35 | 1,020 | 1,280 | 169,077 | 2035/3/1 |
| | | 3.45 ITALY GOVT 480301 | 3.45 | 1,450 | 1,918 | 253,370 | 2048/3/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 300301 | 3.5 | 2,610 | 3,205 | 423,291 | 2030/3/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75 | 2,200 | 2,476 | 327,053 | 2024/9/1 |
| | | 3.85 ITALY GOVT 490901 | 3.85 | 1,220 | 1,727 | 228,166 | 2049/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 370201 | 4.0 | 2,420 | 3,279 | 433,146 | 2037/2/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 230501 | 4.5 | 3,200 | 3,502 | 462,521 | 2023/5/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 240301 | 4.5 | 2,520 | 2,847 | 376,027 | 2024/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 260301 | 4.5 | 2,100 | 2,531 | 334,359 | 2026/3/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75 | 3,700 | 4,112 | 543,066 | 2023/8/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75 | 3,200 | 4,140 | 546,742 | 2028/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75 | 1,710 | 2,672 | 352,930 | 2044/9/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 250301 | 5.0 | 2,920 | 3,471 | 458,471 | 2025/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 340801 | 5.0 | 2,460 | 3,575 | 472,213 | 2034/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 390801 | 5.0 | 2,200 | 3,396 | 448,592 | 2039/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 400901 | 5.0 | 1,860 | 2,893 | 382,098 | 2040/9/1 |
| | | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 3,740 | 5,119 | 676,096 | 2029/11/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 220901 | 5.5 | 1,650 | 1,775 | 234,513 | 2022/9/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 221101 | 5.5 | 2,200 | 2,388 | 315,386 | 2022/11/1 |
| | | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75 | 2,080 | 3,135 | 414,016 | 2033/2/1 |
| | | 6 ITALY GOVT 310501 | 6.0 | 2,780 | 4,119 | 544,043 | 2031/5/1 |
| | | 6.5 ITALY GOVT 271101 | 6.5 | 2,420 | 3,344 | 441,721 | 2027/11/1 |
| | | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 2,050 | 2,821 | 372,650 | 2026/11/1 |
| | | 9 ITALY GOVT 231101 | 9.0 | 2,550 | 3,129 | 413,338 | 2023/11/1 |
| フランス | 国債証券 | 0 O. A. T 240225 | — | 2,000 | 2,031 | 268,328 | 2024/2/25 |
| | | 0 O. A. T 240325 | — | 2,000 | 2,033 | 268,528 | 2024/3/25 |
| | | 0 O. A. T 250325 | — | 2,750 | 2,801 | 370,008 | 2025/3/25 |
| | | 0 O. A. T 260225 | — | 2,500 | 2,545 | 336,169 | 2026/2/25 |
| | | 0 O. A. T 291125 | — | 3,800 | 3,791 | 500,719 | 2029/11/25 |
| | | 0 O. A. T 301125 | — | 1,600 | 1,580 | 208,747 | 2030/11/25 |
| | | 0.25 O. A. T 261125 | 0.25 | 2,550 | 2,630 | 347,330 | 2026/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 250525 | 0.5 | 3,450 | 3,588 | 473,843 | 2025/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 260525 | 0.5 | 3,500 | 3,655 | 482,718 | 2026/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 290525 | 0.5 | 3,500 | 3,649 | 481,990 | 2029/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 400525 | 0.5 | 1,150 | 1,107 | 146,319 | 2040/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 720525 | 0.5 | 1,010 | 754 | 99,660 | 2072/5/25 |
| | | 0.75 O. A. T 280525 | 0.75 | 3,570 | 3,798 | 501,657 | 2028/5/25 |
| | | 0.75 O. A. T 281125 | 0.75 | 3,900 | 4,150 | 548,104 | 2028/11/25 |
| | | 0.75 O. A. T 520525 | 0.75 | 630 | 586 | 77,446 | 2052/5/25 |
| | | 1 O. A. T 251125 | 1.0 | 3,420 | 3,643 | 481,220 | 2025/11/25 |
| | | 1 O. A. T 270525 | 1.0 | 3,230 | 3,479 | 459,462 | 2027/5/25 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|----------------------|------|------------------------|-------|-----------|------------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | 1.25 O.A.T 340525 | 1.25 | 3,750 | 4,159 | 549,305 | 2034/5/25 |
| | | 1.25 O.A.T 360525 | 1.25 | 3,040 | 3,367 | 444,657 | 2036/5/25 |
| | | 1.5 O.A.T 310525 | 1.5 | 3,990 | 4,525 | 597,613 | 2031/5/25 |
| | | 1.5 O.A.T 500525 | 1.5 | 2,870 | 3,263 | 431,015 | 2050/5/25 |
| | | 1.75 O.A.T 230525 | 1.75 | 2,900 | 3,041 | 401,641 | 2023/5/25 |
| | | 1.75 O.A.T 241125 | 1.75 | 3,550 | 3,839 | 507,039 | 2024/11/25 |
| | | 1.75 O.A.T 390625 | 1.75 | 2,610 | 3,122 | 412,332 | 2039/6/25 |
| | | 1.75 O.A.T 660525 | 1.75 | 1,340 | 1,644 | 217,227 | 2066/5/25 |
| | | 2 O.A.T 480525 | 2.0 | 2,800 | 3,534 | 466,711 | 2048/5/25 |
| | | 2.25 O.A.T 240525 | 2.25 | 3,340 | 3,628 | 479,191 | 2024/5/25 |
| | | 2.5 O.A.T 300525 | 2.5 | 4,830 | 5,897 | 778,764 | 2030/5/25 |
| | | 2.75 O.A.T 271025 | 2.75 | 4,790 | 5,721 | 755,633 | 2027/10/25 |
| | | 3.25 O.A.T 450525 | 3.25 | 2,220 | 3,401 | 449,254 | 2045/5/25 |
| | | 3.5 O.A.T 260425 | 3.5 | 4,450 | 5,317 | 702,259 | 2026/4/25 |
| | | 4 O.A.T 381025 | 4.0 | 2,290 | 3,595 | 474,882 | 2038/10/25 |
| | | 4 O.A.T 550425 | 4.0 | 1,810 | 3,363 | 444,213 | 2055/4/25 |
| | | 4 O.A.T 600425 | 4.0 | 1,680 | 3,255 | 429,889 | 2060/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 6,500 | 7,282 | 961,722 | 2023/10/25 |
| 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 3,510 | 6,021 | 795,150 | 2041/4/25 | | |
| 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 2,570 | 4,092 | 540,423 | 2035/4/25 | | |
| 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 5,250 | 7,589 | 1,002,315 | 2029/4/25 | | |
| 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 2,840 | 4,617 | 609,789 | 2032/10/25 | | |
| 6 O.A.T 251025 | 6.0 | 2,700 | 3,486 | 460,409 | 2025/10/25 | | |
| 8.5 O.A.T 230425 | 8.5 | 1,300 | 1,533 | 202,532 | 2023/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 240115 | — | 1,250 | 1,272 | 168,065 | 2024/1/15 |
| | | 0 NETH GOVT 300715 | — | 400 | 403 | 53,297 | 2030/7/15 |
| | | 0 NETH GOVT 520115 | — | 670 | 575 | 76,056 | 2052/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25 | 1,350 | 1,395 | 184,322 | 2025/7/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 290715 | 0.25 | 1,550 | 1,604 | 211,933 | 2029/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 1,830 | 1,921 | 253,782 | 2026/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 400115 | 0.5 | 500 | 517 | 68,296 | 2040/1/15 |
| | | 0.75 NETH GOVT 270715 | 0.75 | 1,740 | 1,860 | 245,639 | 2027/7/15 |
| | | 0.75 NETH GOVT 280715 | 0.75 | 1,530 | 1,642 | 216,959 | 2028/7/15 |
| | | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1.75 | 1,500 | 1,580 | 208,732 | 2023/7/15 |
| | | 2 NETH GOVT 240715 | 2.0 | 1,550 | 1,681 | 222,054 | 2024/7/15 |
| | | 2.5 NETH GOVT 330115 | 2.5 | 1,790 | 2,303 | 304,138 | 2033/1/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 1,330 | 2,094 | 276,663 | 2047/1/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 1,500 | 2,532 | 334,428 | 2042/1/15 |
| 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 2,090 | 3,320 | 438,483 | 2037/1/15 | | |
| 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 1,500 | 2,090 | 276,084 | 2028/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | 0 SPAIN GOVT 240531 | — | 1,900 | 1,923 | 253,960 | 2024/5/31 |
| | | 0 SPAIN GOVT 250131 | — | 4,630 | 4,686 | 618,874 | 2025/1/31 |
| | | 0 SPAIN GOVT 260131 | — | 2,300 | 2,320 | 306,488 | 2026/1/31 |
| | | 0.35 SPAIN GOVT 230730 | 0.35 | 1,720 | 1,752 | 231,483 | 2023/7/30 |
| | | 0.4 SPAIN GOVT 220430 | 0.4 | 1,600 | 1,614 | 213,269 | 2022/4/30 |
| | | 0.45 SPAIN GOVT 221031 | 0.45 | 1,450 | 1,471 | 194,332 | 2022/10/31 |
| | | 0.6 SPAIN GOVT 291031 | 0.6 | 1,600 | 1,636 | 216,159 | 2029/10/31 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | 0.8 SPAIN GOVT 270730 | 0.8 | 3,650 | 3,827 | 505,423 | 2027/7/30 |
| | | 1 SPAIN GOVT 501031 | 1.0 | 1,400 | 1,236 | 163,246 | 2050/10/31 |
| | | 1.2 SPAIN GOVT 401031 | 1.2 | 550 | 549 | 72,626 | 2040/10/31 |
| | | 1.25 SPAIN GOVT 301031 | 1.25 | 4,230 | 4,540 | 599,671 | 2030/10/31 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 280430 | 1.4 | 1,750 | 1,905 | 251,692 | 2028/4/30 |
| | | 1.45 SPAIN GOVT 271031 | 1.45 | 3,250 | 3,545 | 468,245 | 2027/10/31 |
| | | 1.45 SPAIN GOVT 290430 | 1.45 | 3,070 | 3,358 | 443,470 | 2029/4/30 |
| | | 1.45 SPAIN GOVT 711031 | 1.45 | 290 | 249 | 32,949 | 2071/10/31 |
| | | 1.6 SPAIN GOVT 250430 | 1.6 | 2,050 | 2,206 | 291,429 | 2025/4/30 |
| | | 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 1.85 | 2,150 | 2,430 | 320,927 | 2035/7/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | 1,900 | 2,101 | 277,587 | 2026/4/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95 | 1,620 | 1,845 | 243,782 | 2030/7/30 |
| | | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15 | 4,660 | 5,164 | 681,991 | 2025/10/31 |
| | | 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 2.35 | 1,920 | 2,287 | 302,105 | 2033/7/30 |
| | | 2.7 SPAIN GOVT 481031 | 2.7 | 1,230 | 1,584 | 209,257 | 2048/10/31 |
| | | 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2.9 | 1,540 | 2,045 | 270,101 | 2046/10/31 |
| | | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45 | 1,320 | 1,990 | 262,845 | 2066/7/30 |
| | | 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 4.2 | 2,090 | 3,087 | 407,752 | 2037/1/31 |
| | | 4.4 SPAIN GOVT 231031 | 4.4 | 2,350 | 2,636 | 348,223 | 2023/10/31 |
| | | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | 2,150 | 2,600 | 343,477 | 2025/7/30 |
| | | 4.7 SPAIN GOVT 410730 | 4.7 | 1,810 | 2,955 | 390,316 | 2041/7/30 |
| | | 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 4.8 | 2,140 | 2,449 | 323,458 | 2024/1/31 |
| | | 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 4.9 | 2,340 | 3,875 | 511,808 | 2040/7/30 |
| | | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | 2,910 | 3,985 | 526,374 | 2028/10/31 |
| | | 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15 | 1,310 | 2,334 | 308,232 | 2044/10/31 |
| | | 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 5.4 | 1,750 | 1,929 | 254,815 | 2023/1/31 |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 2,330 | 3,634 | 480,036 | 2032/7/30 | | |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 5.9 | 5,190 | 6,835 | 902,677 | 2026/7/30 | | |
| 6 SPAIN GOVT 290131 | 6.0 | 3,450 | 4,980 | 657,775 | 2029/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | 0.1 BEL GOVT 300622 | 0.1 | 800 | 804 | 106,228 | 2030/6/22 |
| | | 0.2 BEL GOVT 231022 | 0.2 | 350 | 357 | 47,165 | 2023/10/22 |
| | | 0.5 BEL GOVT 241022 | 0.5 | 800 | 829 | 109,554 | 2024/10/22 |
| | | 0.65 BEL GOVT 710622 | 0.65 | 420 | 335 | 44,312 | 2071/6/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 250622 | 0.8 | 1,600 | 1,686 | 222,749 | 2025/6/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 270622 | 0.8 | 1,080 | 1,152 | 152,175 | 2027/6/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 280622 | 0.8 | 1,600 | 1,712 | 226,174 | 2028/6/22 |
| | | 0.9 BEL GOVT 290622 | 0.9 | 1,380 | 1,488 | 196,520 | 2029/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 1,600 | 1,715 | 226,555 | 2026/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 310622 | 1.0 | 1,200 | 1,305 | 172,452 | 2031/6/22 |
| | | 1.25 BEL GOVT 330422 | 1.25 | 1,030 | 1,149 | 151,831 | 2033/4/22 |
| | | 1.45 BEL GOVT 370622 | 1.45 | 490 | 557 | 73,572 | 2037/6/22 |
| | | 1.6 BEL GOVT 470622 | 1.6 | 970 | 1,122 | 148,173 | 2047/6/22 |
| | | 1.7 BEL GOVT 500622 | 1.7 | 590 | 698 | 92,206 | 2050/6/22 |
| | | 1.9 BEL GOVT 380622 | 1.9 | 1,100 | 1,332 | 175,908 | 2038/6/22 |
| | | 2.15 BEL GOVT 660622 | 2.15 | 570 | 773 | 102,185 | 2066/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 230622 | 2.25 | 820 | 870 | 114,969 | 2023/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 570622 | 2.25 | 530 | 721 | 95,313 | 2057/6/22 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ベルギー | 国債証券 | 2.6 BEL GOVT 240622 | 2.6 | 1,580 | 1,738 | 229,574 | 2024/6/22 |
| | | 3 BEL GOVT 340622 | 3.0 | 810 | 1,084 | 143,167 | 2034/6/22 |
| | | 3.75 BEL GOVT 450622 | 3.75 | 900 | 1,469 | 194,082 | 2045/6/22 |
| | | 4 BEL GOVT 320328 | 4.0 | 720 | 1,016 | 134,284 | 2032/3/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 1,630 | 2,700 | 356,681 | 2041/3/28 |
| | | 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 980 | 1,218 | 160,964 | 2026/3/28 |
| | | 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 1,850 | 3,000 | 396,227 | 2035/3/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 2,080 | 2,909 | 384,233 | 2028/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 230715 | — | 250 | 253 | 33,468 | 2023/7/15 |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 300220 | — | 1,000 | 1,001 | 132,312 | 2030/2/20 |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 310220 | — | 400 | 397 | 52,428 | 2031/2/20 |
| | | 0.5 AUSTRIA GOVT 270420 | 0.5 | 1,150 | 1,208 | 159,623 | 2027/4/20 |
| | | 0.5 AUSTRIA GOVT 290220 | 0.5 | 700 | 734 | 96,973 | 2029/2/20 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | 850 | 903 | 119,318 | 2026/10/20 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 0.75 | 1,200 | 1,282 | 169,317 | 2028/2/20 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 0.75 | 460 | 462 | 61,087 | 2051/3/20 |
| | | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020 | 1.2 | 1,110 | 1,194 | 157,690 | 2025/10/20 |
| | | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220 | 1.5 | 570 | 683 | 90,298 | 2047/2/20 |
| | | 1.5 AUSTRIA GOVT 861102 | 1.5 | 270 | 339 | 44,835 | 2086/11/2 |
| | | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65 | 1,160 | 1,250 | 165,078 | 2024/10/21 |
| | | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 1,700 | 1,799 | 237,614 | 2023/10/20 |
| | | 2.1 AUSTRIA GOVT 170920 | 2.1 | 600 | 945 | 124,871 | 2117/9/20 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 740 | 944 | 124,758 | 2034/5/23 |
| | | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | 610 | 955 | 126,232 | 2044/6/20 |
| | | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 3.8 | 520 | 1,055 | 139,394 | 2062/1/26 |
| | | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15 | 1,370 | 2,173 | 287,081 | 2037/3/15 |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 550 | 693 | 91,590 | 2026/3/15 | | |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 970 | 1,368 | 180,767 | 2027/7/15 | | |
| フィンランド | 国債証券 | 0 FINNISH GOVT 230915 | — | 350 | 355 | 46,928 | 2023/9/15 |
| | | 0 FINNISH GOVT 240915 | — | 850 | 866 | 114,467 | 2024/9/15 |
| | | 0 FINNISH GOVT 300915 | — | 450 | 449 | 59,342 | 2030/9/15 |
| | | 0.125 FINNISH GOV 360415 | 0.125 | 630 | 606 | 80,145 | 2036/4/15 |
| | | 0.125 FINNISH GOV 520415 | 0.125 | 250 | 211 | 27,901 | 2052/4/15 |
| | | 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 0.25 | 130 | 123 | 16,305 | 2040/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 0.5 | 400 | 418 | 55,314 | 2026/4/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 270915 | 0.5 | 1,000 | 1,051 | 138,843 | 2027/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 280915 | 0.5 | 250 | 262 | 34,702 | 2028/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 290915 | 0.5 | 400 | 419 | 55,420 | 2029/9/15 |
| | | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75 | 350 | 373 | 49,386 | 2031/4/15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 500 | 530 | 70,030 | 2025/9/15 |
| | | 1.125 FINNISH GOV 340415 | 1.125 | 380 | 421 | 55,703 | 2034/4/15 |
| | | 1.375 FINNISH GOV 470415 | 1.375 | 360 | 427 | 56,514 | 2047/4/15 |
| | | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 1.5 | 250 | 260 | 34,401 | 2023/4/15 |
| | | 2 FINNISH GOVT 240415 | 2.0 | 200 | 215 | 28,464 | 2024/4/15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 400 | 570 | 75,326 | 2042/7/4 |
| | | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 530 | 644 | 85,111 | 2028/7/4 |
| 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 460 | 547 | 72,296 | 2025/7/4 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-----------------------|------|------------------------|-------|----------|-----------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| アイルランド | 国債証券 | 0.4 IRISH GOVT 350515 | 0.4 | 700 | 692 | 91,499 | 2035/5/15 |
| | | 0.9 IRISH GOVT 280515 | 0.9 | 850 | 911 | 120,375 | 2028/5/15 |
| | | 1 IRISH GOVT 260515 | 1.0 | 1,570 | 1,676 | 221,436 | 2026/5/15 |
| | | 1.1 IRISH GOVT 290515 | 1.1 | 1,150 | 1,250 | 165,196 | 2029/5/15 |
| | | 1.3 IRISH GOVT 330515 | 1.3 | 600 | 667 | 88,165 | 2033/5/15 |
| | | 1.35 IRISH GOVT 310318 | 1.35 | 540 | 602 | 79,610 | 2031/3/18 |
| | | 1.5 IRISH GOVT 500515 | 1.5 | 460 | 521 | 68,906 | 2050/5/15 |
| | | 1.7 IRISH GOVT 370515 | 1.7 | 900 | 1,057 | 139,615 | 2037/5/15 |
| | | 2 IRISH GOVT 450218 | 2.0 | 750 | 942 | 124,510 | 2045/2/18 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 1,180 | 1,425 | 188,307 | 2030/5/15 |
| | | 3.4 IRISH GOVT 240318 | 3.4 | 600 | 667 | 88,180 | 2024/3/18 |
| 5.4 IRISH GOVT 250313 | 5.4 | 1,100 | 1,349 | 178,177 | 2025/3/13 | | |
| 小 計 | | | | | | 78,040,068 | |
| 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 | 0.125 GILT 240131 | 0.125 | 1,200 | 1,199 | 184,253 | 2024/1/31 |
| | | 0.125 GILT 260130 | 0.125 | 2,000 | 1,978 | 304,056 | 2026/1/30 |
| | | 0.375 GILT 301022 | 0.375 | 2,080 | 1,987 | 305,409 | 2030/10/22 |
| | | 0.625 GILT 250607 | 0.625 | 1,380 | 1,401 | 215,411 | 2025/6/7 |
| | | 0.625 GILT 350731 | 0.625 | 880 | 812 | 124,914 | 2035/7/31 |
| | | 0.625 GILT 501022 | 0.625 | 1,840 | 1,502 | 230,934 | 2050/10/22 |
| | | 0.75 GILT 230722 | 0.75 | 2,450 | 2,487 | 382,245 | 2023/7/22 |
| | | 0.875 GILT 291022 | 0.875 | 1,060 | 1,070 | 164,430 | 2029/10/22 |
| | | 1 GILT 240422 | 1.0 | 1,700 | 1,743 | 267,930 | 2024/4/22 |
| | | 1.25 GILT 270722 | 1.25 | 2,240 | 2,341 | 359,750 | 2027/7/22 |
| | | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 1,910 | 2,019 | 310,287 | 2026/7/22 |
| | | 1.5 GILT 470722 | 1.5 | 1,840 | 1,885 | 289,717 | 2047/7/22 |
| | | 1.625 GILT 281022 | 1.625 | 880 | 943 | 145,041 | 2028/10/22 |
| | | 1.625 GILT 711022 | 1.625 | 750 | 874 | 134,309 | 2071/10/22 |
| | | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 3,900 | 3,988 | 612,836 | 2022/9/7 |
| | | 1.75 GILT 370907 | 1.75 | 1,930 | 2,072 | 318,452 | 2037/9/7 |
| | | 1.75 GILT 490122 | 1.75 | 1,070 | 1,160 | 178,268 | 2049/1/22 |
| | | 1.75 GILT 570722 | 1.75 | 1,850 | 2,074 | 318,723 | 2057/7/22 |
| | | 2 GILT 250907 | 2.0 | 1,080 | 1,161 | 178,504 | 2025/9/7 |
| | | 2.25 GILT 230907 | 2.25 | 2,170 | 2,280 | 350,376 | 2023/9/7 |
| | | 2.5 GILT 650722 | 2.5 | 1,410 | 1,994 | 306,498 | 2065/7/22 |
| | | 2.75 GILT 240907 | 2.75 | 1,160 | 1,259 | 193,605 | 2024/9/7 |
| | | 3.25 GILT 440122 | 3.25 | 2,020 | 2,762 | 424,555 | 2044/1/22 |
| | | 3.5 GILT 450122 | 3.5 | 1,910 | 2,733 | 420,023 | 2045/1/22 |
| | | 3.5 GILT 680722 | 3.5 | 1,380 | 2,488 | 382,367 | 2068/7/22 |
| | | 3.75 GILT 520722 | 3.75 | 1,780 | 2,855 | 438,850 | 2052/7/22 |
| | | 4 GILT 600122 | 4.0 | 1,180 | 2,150 | 330,444 | 2060/1/22 |
| | | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 1,530 | 1,897 | 291,531 | 2027/12/7 |
| | | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 2,090 | 2,809 | 431,631 | 2032/6/7 |
| | | 4.25 GILT 360307 | 4.25 | 1,550 | 2,198 | 337,772 | 2036/3/7 |
| | | 4.25 GILT 390907 | 4.25 | 1,130 | 1,682 | 258,481 | 2039/9/7 |
| 4.25 GILT 401207 | 4.25 | 1,390 | 2,098 | 322,451 | 2040/12/7 | | |
| 4.25 GILT 461207 | 4.25 | 1,590 | 2,571 | 395,079 | 2046/12/7 | | |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | |
|--------|------|-------------------------|-------------|-------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| イギリス | | % | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | 千円 | |
| | 国債証券 | 4.25 GILT 491207 | 4.25 1,280 | 2,150 | 330,389 | 2049/12/7 |
| | | 4.25 GILT 551207 | 4.25 1,670 | 3,015 | 463,395 | 2055/12/7 |
| | | 4.5 GILT 340907 | 4.5 1,990 | 2,828 | 434,561 | 2034/9/7 |
| | | 4.5 GILT 421207 | 4.5 1,980 | 3,152 | 484,489 | 2042/12/7 |
| | | 4.75 GILT 301207 | 4.75 1,920 | 2,610 | 401,124 | 2030/12/7 |
| | | 4.75 GILT 381207 | 4.75 1,290 | 2,006 | 308,375 | 2038/12/7 |
| | | 5 GILT 250307 | 5.0 1,530 | 1,809 | 277,992 | 2025/3/7 |
| | | 6 GILT 281207 | 6.0 330 | 459 | 70,665 | 2028/12/7 |
| 小 | 計 | | | | 12,680,141 | |
| 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 6,450 | 6,254 | 81,745 | 2031/5/12 |
| | | 0.75 SWD GOVT 280512 | 0.75 5,850 | 6,080 | 79,467 | 2028/5/12 |
| | | 0.75 SWD GOVT 291112 | 0.75 4,900 | 5,080 | 66,398 | 2029/11/12 |
| | | 1 SWD GOVT 261112 | 1.0 5,660 | 5,962 | 77,932 | 2026/11/12 |
| | | 1.5 SWD GOVT 231113 | 1.5 8,300 | 8,672 | 113,350 | 2023/11/13 |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 6,230 | 6,895 | 90,130 | 2025/5/12 |
| | | 3.5 SWD GOVT 220601 | 3.5 6,900 | 7,178 | 93,825 | 2022/6/1 |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 3,780 | 5,515 | 72,084 | 2039/3/30 |
| 小 | 計 | | | | 674,934 | |
| 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 3,000 | 2,935 | 38,576 | 2031/9/17 |
| | | 1.375 NORWE GOVT 300819 | 1.375 4,200 | 4,183 | 54,967 | 2030/8/19 |
| | | 1.5 NORWE GOVT 260219 | 1.5 4,160 | 4,261 | 56,002 | 2026/2/19 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1.75 4,000 | 4,135 | 54,343 | 2025/3/13 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 270217 | 1.75 3,050 | 3,158 | 41,496 | 2027/2/17 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 290906 | 1.75 3,200 | 3,298 | 43,347 | 2029/9/6 |
| | | 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 4,150 | 4,278 | 56,219 | 2023/5/24 |
| | | 2 NORWE GOVT 280426 | 2.0 4,450 | 4,677 | 61,462 | 2028/4/26 |
| | | 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 4,400 | 4,690 | 61,635 | 2024/3/14 |
| 小 | 計 | | | | 468,050 | |
| 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 221115 | 0.25 3,000 | 3,036 | 53,919 | 2022/11/15 |
| | | 0.25 DMK GOVT 521115 | 0.25 3,300 | 2,995 | 53,194 | 2052/11/15 |
| | | 0.5 DMK GOVT 271115 | 0.5 7,350 | 7,701 | 136,779 | 2027/11/15 |
| | | 0.5 DMK GOVT 291115 | 0.5 9,050 | 9,474 | 168,271 | 2029/11/15 |
| | | 1.5 DMK GOVT 231115 | 1.5 6,050 | 6,361 | 112,983 | 2023/11/15 |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 1.75 4,850 | 5,327 | 94,612 | 2025/11/15 |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 10,460 | 18,271 | 324,508 | 2039/11/15 |
| 小 | 計 | | | | 944,270 | |
| 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 | 2.25 POLAND 241025 | 2.25 4,000 | 4,229 | 123,013 | 2024/10/25 |
| | | 2.5 POLAND 230125 | 2.5 2,500 | 2,601 | 75,662 | 2023/1/25 |
| | | 2.5 POLAND 240425 | 2.5 2,600 | 2,759 | 80,257 | 2024/4/25 |
| | | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 5,500 | 5,875 | 170,872 | 2026/7/25 |
| | | 2.5 POLAND 270725 | 2.5 3,850 | 4,111 | 119,561 | 2027/7/25 |
| | | 2.75 POLAND 280425 | 2.75 6,710 | 7,287 | 211,941 | 2028/4/25 |
| | | 2.75 POLAND 291025 | 2.75 900 | 974 | 28,343 | 2029/10/25 |

| 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 | |
| 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 | 3.25 POLAND 250725 | 4,950 | 5,430 | 157,937 | 2025/7/25 |
| | | 4 POLAND 231025 | 2,700 | 2,951 | 85,831 | 2023/10/25 |
| | | 5.75 POLAND 220923 | 1,550 | 1,671 | 48,597 | 2022/9/23 |
| | | 5.75 POLAND 290425 | 2,870 | 3,771 | 109,693 | 2029/4/25 |
| | | POLAND 220725 | 800 | 799 | 23,253 | 2022/7/25 |
| 小 | 計 | | | | 1,234,965 | |
| オーストラリア | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| | 国債証券 | 0.25 AUST GOVT 251121 | 2,650 | 2,611 | 222,191 | 2025/11/21 |
| | | 1 AUST GOVT 311121 | 2,510 | 2,336 | 198,821 | 2031/11/21 |
| | | 1.25 AUST GOVT 320521 | 1,650 | 1,565 | 133,237 | 2032/5/21 |
| | | 1.5 AUST GOVT 310621 | 2,240 | 2,206 | 187,721 | 2031/6/21 |
| | | 1.75 AUST GOVT 321121 | 800 | 795 | 67,731 | 2032/11/21 |
| | | 1.75 AUST GOVT 510621 | 1,320 | 1,070 | 91,126 | 2051/6/21 |
| | | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2,300 | 2,471 | 210,292 | 2028/5/21 |
| | | 2.5 AUST GOVT 300521 | 2,950 | 3,197 | 272,034 | 2030/5/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2,400 | 2,588 | 220,215 | 2024/4/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2,250 | 2,492 | 212,095 | 2027/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 281121 | 1,930 | 2,139 | 182,040 | 2028/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2,580 | 2,854 | 242,893 | 2029/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 350621 | 820 | 893 | 76,025 | 2035/6/21 |
| | | 3 AUST GOVT 470321 | 2,070 | 2,226 | 189,484 | 2047/3/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 250421 | 2,000 | 2,220 | 188,936 | 2025/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3,950 | 4,524 | 385,020 | 2029/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 390621 | 820 | 932 | 79,304 | 2039/6/21 |
| | | 3.75 AUST GOVT 370421 | 1,130 | 1,371 | 116,710 | 2037/4/21 |
| | | 4.25 AUST GOVT 260421 | 3,210 | 3,770 | 320,823 | 2026/4/21 |
| | | 4.5 AUST GOVT 330421 | 1,270 | 1,641 | 139,670 | 2033/4/21 |
| | | 4.75 AUST GOVT 270421 | 2,250 | 2,750 | 234,045 | 2027/4/21 |
| | | 5.5 AUST GOVT 230421 | 2,550 | 2,818 | 239,793 | 2023/4/21 |
| | | 5.75 AUST GOVT 220715 | 1,600 | 1,706 | 145,233 | 2022/7/15 |
| 小 | 計 | | | | 4,355,450 | |
| 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 SINGAPORGOVT 230201 | 550 | 562 | 46,125 | 2023/2/1 |
| | | 1.875 SINGAPORGOV 500301 | 700 | 699 | 57,354 | 2050/3/1 |
| | | 2 SINGAPORGOVT 240201 | 100 | 103 | 8,515 | 2024/2/1 |
| | | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 460 | 486 | 39,860 | 2026/6/1 |
| | | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 610 | 640 | 52,497 | 2036/8/1 |
| | | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 600 | 639 | 52,434 | 2025/6/1 |
| | | 2.375 SINGAPORGOV 390701 | 200 | 214 | 17,546 | 2039/7/1 |
| | | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 800 | 870 | 71,355 | 2028/5/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 450 | 471 | 38,665 | 2023/7/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 410 | 466 | 38,283 | 2042/4/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 520 | 601 | 49,322 | 2046/3/1 |
| | | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 590 | 655 | 53,712 | 2029/7/1 |
| | | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 650 | 725 | 59,492 | 2030/9/1 |
| | | 3 SINGAPORGOVT 240901 | 600 | 646 | 52,970 | 2024/9/1 |
| | | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 800 | 828 | 67,918 | 2022/9/1 |

| 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 | | |
| 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 | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 560 | 659 | 54,103 | 2033/9/1 |
| | 3.5 SINGAPORGOVT 270301 | 3.5 | 500 | 566 | 46,400 | 2027/3/1 |
| 小計 | | | | | 806,560 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | |
| 国債証券 | 3.418MALAYSIAGOV 220815 | 3.418 | 900 | 917 | 24,204 | 2022/8/15 |
| | 3.48 MALAYSIAGOV 230315 | 3.48 | 1,200 | 1,230 | 32,483 | 2023/3/15 |
| | 3.502MALAYSIAGOV 270531 | 3.502 | 900 | 932 | 24,620 | 2027/5/31 |
| | 3.733 MALAYSIAGO 280615 | 3.733 | 1,100 | 1,154 | 30,475 | 2028/6/15 |
| | 3.795 MALAYSIAGOV 220930 | 3.795 | 500 | 512 | 13,531 | 2022/9/30 |
| | 3.8 MALAYSIAGOV 230817 | 3.8 | 1,200 | 1,243 | 32,807 | 2023/8/17 |
| | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3.828 | 2,300 | 2,295 | 60,593 | 2034/7/5 |
| | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 1,400 | 1,408 | 37,172 | 2033/4/15 |
| | 3.882 MALAYSIAGOV 250314 | 3.882 | 1,000 | 1,051 | 27,756 | 2025/3/14 |
| | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3.885 | 2,000 | 2,104 | 55,544 | 2029/8/15 |
| | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 500 | 530 | 14,007 | 2027/3/15 |
| | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3.899 | 1,100 | 1,163 | 30,712 | 2027/11/16 |
| | 3.9 MALAYSIAGOV 261130 | 3.9 | 1,000 | 1,065 | 28,122 | 2026/11/30 |
| | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 3.906 | 1,700 | 1,797 | 47,434 | 2026/7/15 |
| | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 800 | 845 | 22,311 | 2025/9/15 |
| | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 4,100 | 4,329 | 114,272 | 2024/7/15 |
| | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254 | 850 | 883 | 23,310 | 2035/5/31 |
| | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 900 | 971 | 25,631 | 2026/4/15 |
| | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 1,700 | 1,862 | 49,167 | 2030/4/15 |
| | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 4.642 | 1,200 | 1,299 | 34,295 | 2033/11/7 |
| | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736 | 1,650 | 1,740 | 45,944 | 2046/3/15 |
| | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4.762 | 3,340 | 3,600 | 95,012 | 2037/4/7 |
| | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 4.921 | 1,120 | 1,213 | 32,038 | 2048/7/6 |
| | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935 | 1,200 | 1,309 | 34,548 | 2043/9/30 |
| 小計 | | | | | 936,001 | |
| 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 | 0.5 ISRAEL FIXED 250430 | 0.5 | 2,800 | 2,805 | 92,749 | 2025/4/30 |
| | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 1.0 | 700 | 682 | 22,578 | 2030/3/31 |
| | 1.5 ISRAEL FIXED 370531 | 1.5 | 1,250 | 1,175 | 38,868 | 2037/5/31 |
| | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 2.25 | 2,880 | 3,162 | 104,558 | 2028/9/28 |
| | 3.75 ISRAEL FIXED 240331 | 3.75 | 4,300 | 4,749 | 157,035 | 2024/3/31 |
| | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 3.75 | 1,600 | 2,002 | 66,197 | 2047/3/31 |
| | 4.25 ISRAEL FIXED 230331 | 4.25 | 1,800 | 1,947 | 64,373 | 2023/3/31 |
| | 5.5 ISRAEL FIXED 420131 | 5.5 | 2,100 | 3,287 | 108,694 | 2042/1/31 |
| | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 6.25 | 3,500 | 4,662 | 154,144 | 2026/10/30 |
| 小計 | | | | | 809,198 | |
| 合計 | | | | | 192,534,359 | |

(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12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 192,534,359 | % 96.8 |
| コール・ローン等、その他 | 6,283,184 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 198,817,543 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（198,059,384千円）の投資信託財産総額（198,817,543千円）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=108.80円 | 1 カナダドル=89.84円 | 1 メキシコペソ=5.4428円 | 1 ユーロ=132.06円 |
| 1 イギリスポンド=153.66円 | 1 スウェーデンクローネ=13.07円 | 1 ノルウェークローネ=13.14円 | 1 デンマーククローネ=17.76円 |
| 1 ポーランドズロチ=29.0819円 | 1 オーストラリアドル=85.09円 | 1 シンガポールドル=81.98円 | 1 マレーシアリングギット=26.392円 |
| 1 イスラエルシェケル=33.0602円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 199,845,425,451 |
| コール・ローン等 | 3,681,628,034 |
| 公社債(評価額) | 192,534,359,448 |
| 未収入金 | 2,171,028,221 |
| 未収利息 | 1,309,658,157 |
| 前払費用 | 148,751,591 |
| (B) 負債 | 2,698,255,110 |
| 未払金 | 1,402,319,690 |
| 未払解約金 | 1,295,935,299 |
| 未払利息 | 121 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 197,147,170,341 |
| 元本 | 87,094,050,705 |
| 次期繰越損益金 | 110,053,119,636 |
| (D) 受益権総口数 | 87,094,050,705口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 22,636円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 70,021,031,430円
 期中追加設定元本額 24,738,230,739円
 期中一部解約元本額 7,665,211,464円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,2636円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

| | |
|---------------------------------------|-----------------|
| MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 29,803,072,262円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | 11,404,539,028円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス | 10,057,402,905円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | 6,016,217,221円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 5,069,032,183円 |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定) | 2,603,395,815円 |
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 2,528,084,995円 |
| つみたて8資産均等バランス | 2,348,179,805円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 2,241,938,399円 |
| 外国債券インデックスファンドi(適格機関投資家限定) | 1,981,395,788円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定) | 1,935,497,618円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,913,410,294円 |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド | 1,890,205,455円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定) | 1,490,578,017円 |
| ファンド・マネジャー(海外債券) | 780,618,642円 |
| つみたて4資産均等バランス | 670,714,190円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定) | 648,037,989円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型) | 599,217,462円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型) | 467,808,317円 |
| eMAXIS バランス(4資産均等型) | 401,078,845円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 329,596,923円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券) | 265,721,496円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型) | 228,722,487円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 225,207,248円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型) | 175,334,952円 |

○損益の状況 (2020年5月13日~2021年5月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,714,184,847 |
| 受取利息 | 3,722,576,271 |
| 支払利息 | △ 8,391,424 |
| (B) 有価証券売買損益 | 6,022,987,801 |
| 売買益 | 15,085,636,756 |
| 売買損 | △ 9,062,648,955 |
| (C) 保管費用等 | △ 18,999,923 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,718,172,725 |
| (E) 前期繰越損益金 | 79,289,207,528 |
| (F) 追加信託差損益金 | 30,390,584,207 |
| (G) 解約差損益金 | △ 9,344,844,824 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 110,053,119,636 |
| 次期繰越損益金(H) | 110,053,119,636 |

- (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。

| | |
|--|-----------------|
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 129,085,044円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 111,119,836円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 100,996,372円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 82,812,826円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金) | 70,411,380円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 66,959,620円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定) | 51,658,210円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金) | 49,867,397円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | 36,559,597円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 34,417,736円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 33,234,146円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) | 30,135,434円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフワード) | 28,555,224円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 28,363,872円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 26,634,308円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 23,312,362円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 22,743,263円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 20,246,172円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 18,410,281円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 11,806,374円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 11,504,199円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 9,655,419円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 6,186,974円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 4,457,516円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 2,210,966円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 1,708,160円 |
| コアバランス | 1,524,285円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 1,430,832円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 970,542円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定) | 887,872円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 453,867円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券 | 442,839円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 217,254円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 62,190円 |
| 合計 | 87,094,050,705円 |

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《繰上償還(第22期)》信託終了日2021年12月27日

[計算期間：2021年5月21日～2021年12月27日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、12月27日に繰り上げて償還させていただきます。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22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 | 期中率 | 期騰落 | 期中率 | | | |
| | 円 銭 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| (償還時) | (償還価額) | | | | | | |
| 22期(2021年12月27日) | 30,059.96 | 1.9 | 515.1104 | 2.9 | — | — | 499 |

(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 |
|----------------------|---------------------|-------|-----------------------------------|-------|----------------|----------------|
| | 円 銭 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2021年5月20日 | 29,509 | — | 500.6569 | — | 97.9 | — |
| 5月末 | 29,902 | 1.3 | 510.4449 | 2.0 | 98.1 | — |
| 6月末 | 29,849 | 1.2 | 508.6618 | 1.6 | 98.0 | — |
| 7月末 | 30,057 | 1.9 | 513.0811 | 2.5 | 97.2 | — |
| 8月末 | 30,050 | 1.8 | 512.2887 | 2.3 | 98.3 | — |
| 9月末 | 29,841 | 1.1 | 508.9534 | 1.7 | 99.1 | — |
| 10月末 | 30,081 | 1.9 | 518.3172 | 3.5 | — | — |
| 11月末 | 30,060 | 1.9 | 512.7684 | 2.4 | — | — |
| (償還時) 2021年12月27日 | (償還価額) 30,059.96 | 1.9 | 515.1104 | 2.9 | — | — |

(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

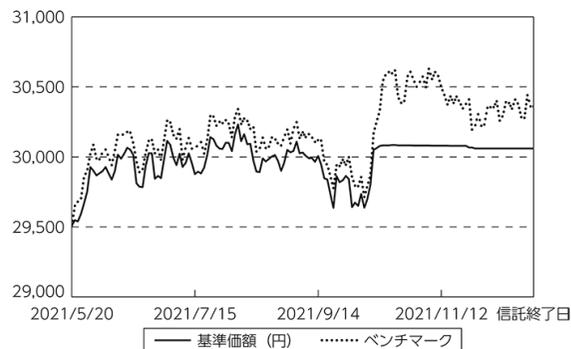
◎基準価額の動き

償還価額は期首に比べ1.9%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(2.9%)を1.0%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)

- ・ 期首から償還に向け保有資産を売却し始めた2021年10月中旬までは、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。
- ・ 10月中旬から信託終了日にかけては、基準価額はほぼ横ばいの動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

- ・ 先進国の債券市況は上昇しました。
- ・ 先進国の債券市況は、経済正常化期待や利上げ観測を背景とした金利上昇等により、下落する局面もありましたが、新型コロナウイルス感染再拡大による景気の先行き懸念を背景とした金利低下等により、期首との比較では上昇しました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドルは対円で上昇、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。
- ・ 第22期（2021年5月21日～信託終了日）は、前記の運用を維持しましたが、2021年10月中旬に保有資産の売却を行いました。

● 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2.9%の上昇になったため、乖離は△1.0%程度となりました。
- ・ ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因^{*}によるものです。

^{*}償還に向け保有資産を売却した後、ベンチマークが上昇したことによる要因などが含まれます。

● 償還価額

償還価額は、30,059円96銭となりました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月21日～2021年12月27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 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用) | 9 | 0.029 | |
| (そ の 他) | (9) | (0.029) | |
| 合 計 | (0) | (0.000) | |
| 期中の平均基準価額は、29,980円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月21日～2021年12月27日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 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 | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |

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12月27日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2021年12月27日現在)

| 項 目 | 償 還 時 | |
|--------------|---------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コール・ローン等、その他 | 千円 499,700 | % 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 499,700 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2021年12月27日現在)

| 項 目 | 償 還 時 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 499,700,309 |
| コール・ローン等 | 499,700,309 |
| (B) 負債 | 252 |
| 未払利息 | 252 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 499,700,057 |
| 元本 | 166,234,457 |
| 償還差益金 | 333,465,600 |
| (D) 受益権総口数 | 166,234,457口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 30,059円96銭 |

<注記事項>

- ①期首元本額 19,203,331,473円
 期中追加設定元本額 2,159,957,827円
 期中一部解約元本額 21,197,054,843円
 また、1口当たり純資産額は、期末3,005,996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 プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) 166,234,457円

【お知らせ】

- ①当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が、当該投資信託を投資対象から除外することとなるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。
 (2021年12月27日)
- ②「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

○損益の状況 (2021年5月21日～2021年12月27日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 480,789,431 |
| 受取利息 | 482,357,762 |
| 支払利息 | △ 1,568,331 |
| (B) 有価証券売買損益 | 281,040,134 |
| 売買益 | 1,369,799,240 |
| 売買損 | △ 1,088,759,106 |
| (C) 保管費用等 | △ 10,883,924 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 750,945,641 |
| (E) 前期繰越損益金 | 37,464,656,529 |
| (F) 追加信託差損益金 | 4,301,418,549 |
| (G) 解約差損益金 | △42,183,555,119 |
| 償還差益金(D+E+F+G) | 333,465,600 |

- (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。