

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（2008年3月31日設定）	
運用方針	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざ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。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
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、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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>	

※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 （年1回決算型）

第12期（決算日：2020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（年1回決算型）」は、去る1月17日に第12期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況を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5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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円		%		%	%	%	百万円
8期(2016年1月18日)	12,585		10	△4.5	449.3966	△3.7	98.6	—	3,389
9期(2017年1月17日)	12,081		10	△3.9	434.1533	△3.4	98.7	—	3,379
10期(2018年1月17日)	12,707		10	5.3	460.2736	6.0	98.6	—	3,543
11期(2019年1月17日)	12,110		10	△4.6	441.5102	△4.1	98.6	—	3,423
12期(2020年1月17日)	12,957		10	7.1	475.8955	7.8	98.5	—	3,663

(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		
(期 首) 2019年1月17日	円 12,110	% —	441.5102	% —	% 98.6	% —
1月末	12,221	0.9	447.5574	1.4	99.7	—
2月末	12,386	2.3	452.7745	2.6	98.9	—
3月末	12,545	3.6	456.9806	3.5	98.1	—
4月末	12,504	3.3	456.1044	3.3	98.8	—
5月末	12,396	2.4	455.6393	3.2	97.5	—
6月末	12,551	3.6	459.5523	4.1	98.7	—
7月末	12,582	3.9	460.6900	4.3	97.6	—
8月末	12,657	4.5	464.2836	5.2	97.0	—
9月末	12,711	5.0	467.4782	5.9	99.0	—
10月末	12,828	5.9	470.0589	6.5	99.0	—
11月末	12,828	5.9	470.8993	6.7	98.4	—
12月末	12,879	6.4	472.8141	7.1	98.8	—
(期 末) 2020年1月17日	12,967	7.1	475.8955	7.8	98.5	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第12期：2019年1月18日～2020年1月17日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第12期首	12,110円
第12期末	12,957円
既払分配金	10円
騰落率	7.1%

(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

基準価額は期首に比べ7.1%（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（7.8%）を0.7%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12期：2019年1月18日～2020年1月17日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、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しました。一方、ユーロは対円で下落しました。

為替市況は、期首に比べて1.2%の円安・米ドル高、1.0%の円高・ユーロ安となりました。

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（年1回決算型）

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

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

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

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

▶ 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（年1回決算型）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.7\%$ 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 $\Delta 0.7\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

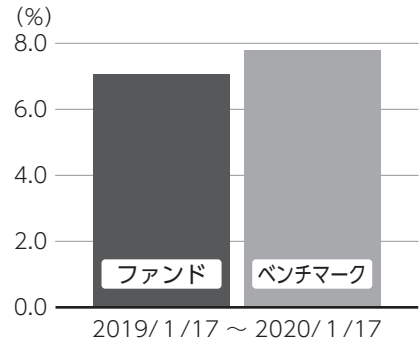
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：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。

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。

▶ 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12期 2019年1月18日～2020年1月17日
当期分配金（対基準価額比率）	10（0.077%）
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,552

（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（年1回決算型）**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **三菱UFJ 外国債券マザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2019年1月18日～2020年1月17日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	82	0.652	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(42)	(0.337)	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）	(33)	(0.261)	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）	(7)	(0.054)	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	3	0.028	(b) 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）	(3)	(0.024)	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)	(0.004)	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	85	0.680	

期中の平均基準価額は、12,572円です。

(注) 期中の費用（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。

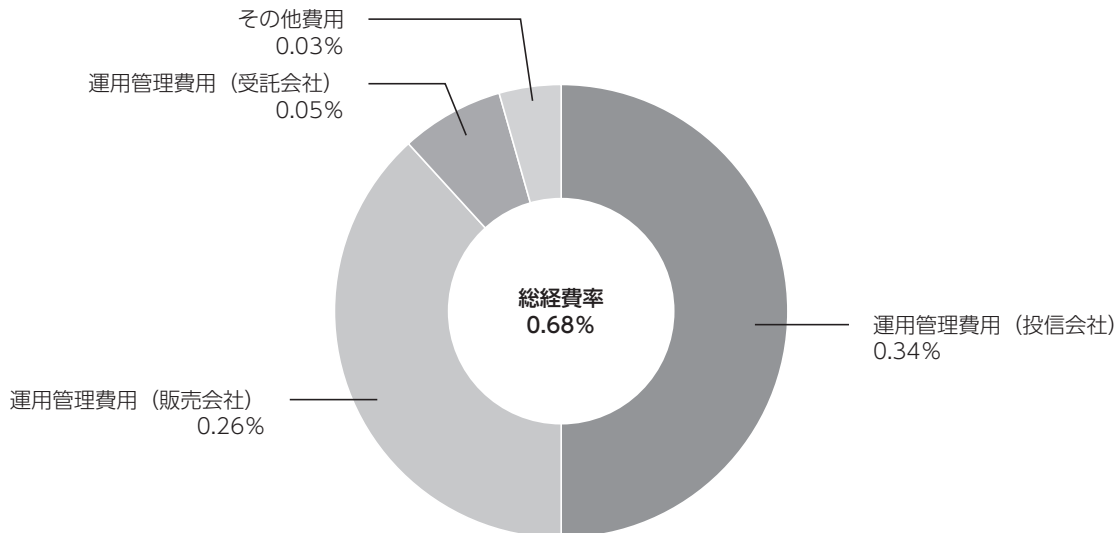
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・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。）を期中の平均受益権口数に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0.68%**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

(2019年1月18日～2020年1月17日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	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 56,729	千円 153,432	千口 66,201	千円 179,318

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月18日～2020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（年1回決算型）>

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	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 16,214	百万円 9,657	% 59.6	百万円 16,998	百万円 6,340	% 37.3

平均保有割合 7.1%

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

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

○組入資産の明細

(2020年1月17日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	口数	評価額	口数	評価額
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千口 1,318,145	千円 3,662,062	千口 1,308,674	千円 3,662,062

○投資信託財産の構成

(2020年1月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	千円 3,662,062	% 99.4
コール・ローン等、その他	20,713	0.6
投資信託財産総額	3,682,775	100.0

(注) 三菱UFJ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（48,933,577千円）の投資信託財産総額（50,527,156千円）に対する比率は96.8%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=110.33円	1 カナダドル=84.59円	1 メキシコペソ=5.88円	1 ユーロ=122.86円
1 イギリスポンド=144.23円	1 スウェーデンクローネ=11.62円	1 ノルウェークローネ=12.41円	1 デンマーククローネ=16.44円
1 ポーランドズロチ=28.95円	1 オーストラリアドル=76.08円	1 シンガポールドル=81.95円	1 マレーシアリングギット=27.15円
1 南アフリカランド=7.66円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年1月17日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,682,775,720
コール・ローン等	15,608,144
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	3,662,062,865
未収入金	5,104,711
(B) 負債	19,748,639
未払収益分配金	2,827,065
未払解約金	4,995,092
未払信託報酬	11,855,404
未払利息	5
その他未払費用	71,073
(C) 純資産総額(A-B)	3,663,027,081
元本	2,827,065,177
次期繰越損益金	835,961,904
(D) 受益権総口数	2,827,065,177口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,957円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,826,715,631円
 期中追加設定元本額 280,341,191円
 期中一部解約元本額 279,991,645円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,957円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年1月18日～ 2020年1月17日
費用控除後の配当等収益額	76,285,259円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	772,127,485円
分配準備積立金額	724,172,595円
当ファンドの分配対象収益額	1,572,585,339円
1万口当たり収益分配対象額	5,562円
1万口当たり分配金額	10円
収益分配金金額	2,827,065円

○損益の状況（2019年1月18日～2020年1月17日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,656
受取利息	26
支払利息	△ 3,682
(B) 有価証券売買損益	252,809,373
売買益	266,885,669
売買損	△ 14,076,296
(C) 信託報酬等	△ 23,229,730
(D) 当期損益金(A+B+C)	229,575,987
(E) 前期繰越損益金	310,132,875
(F) 追加信託差損益金	299,080,107
(配当等相当額)	(771,851,285)
(売買損益相当額)	(△472,771,178)
(G) 計(D+E+F)	838,788,969
(H) 収益分配金	△ 2,827,065
次期繰越損益金(G+H)	835,961,904
追加信託差損益金	299,080,107
(配当等相当額)	(772,127,485)
(売買損益相当額)	(△473,047,378)
分配準備積立金	797,630,789
繰越損益金	△260,748,992

- (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) (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。

○分配金のお知らせ

1 万円当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

◆分配金は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、2020年1月17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。
- ・2020年1月1日以降の分配時において、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に当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第19期》決算日2019年5月20日

[計算期間：2018年5月22日～2019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19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19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
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186
16期(2016年5月20日)	25,716	△ 6.5	436.8953	△ 6.3	98.7	—	73,559
17期(2017年5月22日)	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—	54,433
18期(2018年5月21日)	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—	48,418
19期(2019年5月20日)	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—	51,055

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018年5月21日	円	%		%	%	%
	26,312	—	446.7912	—	98.7	—
5月末	25,783	△2.0	439.0315	△1.7	99.4	—
6月末	26,166	△0.6	444.9739	△0.4	98.3	—
7月末	26,362	0.2	448.9124	0.5	98.9	—
8月末	26,345	0.1	449.7333	0.7	98.6	—
9月末	26,786	1.8	455.6286	2.0	98.6	—
10月末	26,301	△0.0	446.4447	△0.1	96.9	—
11月末	26,538	0.9	451.1517	1.0	98.6	—
12月末	26,371	0.2	447.2109	0.1	96.8	—
2019年1月末	26,207	△0.4	447.5574	0.2	99.8	—
2月末	26,575	1.0	452.7745	1.3	98.9	—
3月末	26,930	2.3	456.9806	2.3	98.1	—
4月末	26,854	2.1	456.1044	2.1	98.8	—
(期 末) 2019年5月20日	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

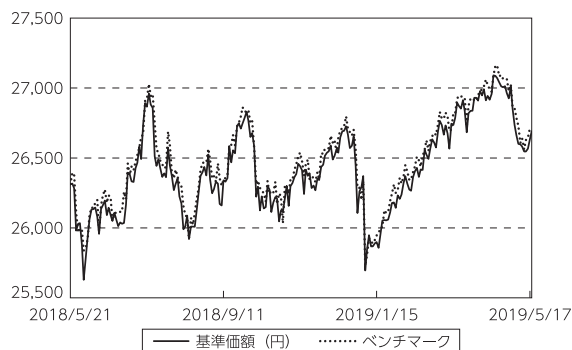
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.5%)を0.1%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。

●投資環境について

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、期の後半にかけての米国の利上げ休止観測などが上昇要因となり、期首との比較では上昇しました。

◎為替市況

- ・期の後半にかけて世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では、米ドル、ユーロは対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.5%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 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：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因[※]

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

○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

(2018年5月22日～2019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)	(7)	(0.025)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	7	0.025	
期中の平均基準価額は、26,420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

(2018年5月22日～2019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 4,431	% 36.4		百万円 1,092	% 10.6	

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

(2019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 213,630	千アメリカドル 216,795	千円 23,884,386	% 46.8	% —	% 19.6	% 17.9	% 9.2
カナダ	千カナダドル 10,840	千カナダドル 11,748	963,167	1.9	—	1.0	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 72,350	千メキシコペソ 71,434	411,462	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,110	26,769	3,291,883	6.4	—	3.6	2.1	0.7
イタリア	33,110	35,585	4,375,897	8.6	—	4.9	2.8	0.8
フランス	34,110	40,702	5,005,212	9.8	—	6.6	2.3	0.9
オランダ	6,980	8,356	1,027,552	2.0	—	1.2	0.7	0.1
スペイン	19,980	23,738	2,919,063	5.7	—	3.7	1.4	0.6
ベルギー	8,610	10,419	1,281,260	2.5	—	2.0	0.4	0.1
オーストリア	4,690	5,714	702,680	1.4	—	1.0	0.4	—
フィンランド	2,140	2,373	291,808	0.6	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	2,740	3,104	381,778	0.7	—	0.5	0.3	0.0
イギリス	千イギリスポンド 18,350	千イギリスポンド 23,316	3,272,751	6.4	—	4.9	1.0	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 13,250	千スウェーデンクローネ 15,073	172,292	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,100	千ノルウェークローネ 9,388	117,734	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 11,700	千デンマーククローネ 15,257	251,283	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 10,000	千ポーランドズロチ 10,429	298,084	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 11,560	千オーストラリアドル 13,079	995,845	2.0	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,400	千シンガポールドル 2,489	199,370	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,180	千マレーシアリンギット 8,303	219,056	0.4	—	0.3	0.1	—
南アフリカ	千南アフリカランド 40,150	千南アフリカランド 36,251	277,688	0.5	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	50,340,263	98.6	—	53.1	31.6	13.9

(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	1.125 T-NOTE 200430	1.125	50	49	5,446	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	686	75,636	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	1,300	1,272	140,155	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,700	1,661	183,060	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,074	118,337	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	884	97,417	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	800	782	86,208	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	2,700	2,599	286,397	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,040	114,648	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,150	2,129	234,570	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,200	2,176	239,779	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,875	206,657	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,250	1,231	135,711	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	300	290	31,974	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	918	101,170	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	1,000	991	109,287	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	550	545	60,084	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,700	2,675	294,728	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 200815	1.5	600	593	65,433	2020/8/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	196	21,663	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,400	2,340	257,880	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,600	1,514	166,893	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,750	1,735	191,246	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201015	1.625	2,900	2,875	316,784	2020/10/15
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,100	1,089	120,003	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	350	344	37,926	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,475	162,517	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,007	221,208	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	600	587	64,717	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	1,025	112,985	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,950	1,870	206,087	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,750	1,675	184,573	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,000	992	109,335	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201115	1.75	5,100	5,061	557,587	2020/11/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	750	743	81,962	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,534	169,015	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	98	10,897	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	939	103,541	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	400	395	43,572	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,600	2,570	283,152	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,581	174,206	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,550	1,530	168,575	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	837	92,298	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,180	130,076	2023/5/15

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					
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	744	82,075	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,687	185,957	2022/3/31
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	99	10,929	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	1,200	1,189	131,078	2022/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	743	81,917	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	950	941	103,762	2022/9/30
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,800	1,783	196,508	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	250	249	27,439	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,350	2,340	257,867	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	450	448	49,386	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	700	696	76,787	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	450	448	49,375	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,095	120,704	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,095	120,713	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,494	164,628	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2.0	450	448	49,398	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,195	131,682	2022/2/15
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,800	2,783	306,692	2023/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,650	1,635	180,175	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,500	2,470	272,132	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,900	2,856	314,725	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,250	1,223	134,818	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	99	10,995	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,148	126,556	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,100	1,098	121,016	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,098	121,063	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,550	1,549	170,656	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,048	115,561	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,600	2,593	285,770	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	500	498	54,938	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	550	548	60,423	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,395	153,695	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,000	1,991	219,410	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,250	1,241	136,787	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	936	103,134	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	200	22,045	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	900	99,249	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,302	143,455	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	3,850	3,860	425,347	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	750	752	82,866	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,950	2,955	325,585	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	895	98,672	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	600	595	65,647	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	1,800	1,785	196,725	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 200430	2.375	1,500	1,500	165,313	2020/4/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.375	T-NOTE 201231	2.375	200	200	22,073	2020/12/31
		2.375	T-NOTE 210415	2.375	2,300	2,306	254,133	2021/4/15
		2.375	T-NOTE 220315	2.375	2,600	2,616	288,310	2022/3/15
		2.375	T-NOTE 230131	2.375	1,550	1,561	172,044	2023/1/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	1,450	1,462	161,081	2024/8/15
		2.375	T-NOTE 270515	2.375	1,900	1,907	210,107	2027/5/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	2,400	2,262	249,266	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	950	893	98,439	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	550	516	56,948	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 201231	2.5	1,000	1,003	110,578	2020/12/31
		2.5	T-NOTE 220115	2.5	2,400	2,420	266,649	2022/1/15
		2.5	T-NOTE 220215	2.5	3,100	3,128	344,662	2022/2/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	3,750	3,799	418,592	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,521	167,630	2024/5/15
		2.5	T-NOTE 260228	2.5	900	912	100,516	2026/2/28
		2.625	T-NOTE 200815	2.625	1,200	1,204	132,715	2020/8/15
		2.625	T-NOTE 201115	2.625	1,350	1,357	149,513	2020/11/15
		2.625	T-NOTE 210715	2.625	1,600	1,614	177,890	2021/7/15
		2.625	T-NOTE 230630	2.625	2,000	2,035	224,247	2023/6/30
		2.625	T-NOTE 250331	2.625	1,600	1,634	180,031	2025/3/31
		2.625	T-NOTE 251231	2.625	1,450	1,481	163,191	2025/12/31
		2.75	T-BOND 420815	2.75	450	448	49,365	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	700	696	76,703	2042/11/15
		2.75	T-BOND 470815	2.75	1,200	1,182	130,293	2047/8/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	450	443	48,848	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 210815	2.75	1,000	1,012	111,525	2021/8/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,946	214,408	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	1,100	1,127	124,254	2024/2/15
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	2,300	2,365	260,656	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	850	874	96,336	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	2,900	2,988	329,252	2028/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	1,050	1,065	117,413	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	1,400	1,417	156,141	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	950	961	105,928	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 250430	2.875	1,130	1,169	128,888	2025/4/30
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	1,750	1,821	200,644	2028/5/15
		2.875	T-NOTE 280815	2.875	3,500	3,643	401,350	2028/8/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	400	415	45,820	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	2,520	2,610	287,583	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	1,700	1,761	194,078	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	1,200	1,244	137,058	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	900	933	102,809	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	750	777	85,603	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	950	982	108,283	2048/2/15
		3.0	T-BOND 480815	3.0	2,240	2,317	255,321	2048/8/15

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		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
国債証券	3 T-NOTE 250930	3.0	2,100	2,191	241,442	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	1,300	1,356	149,498	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	350	372	41,002	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	370	393	43,301	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,300	1,376	151,646	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,250	1,323	145,792	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	600	635	70,031	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	750	763	84,096	2021/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	1,500	1,593	175,531	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	850	938	103,367	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	1,030	1,144	126,134	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	250	282	31,168	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	808	89,117	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	950	1,090	120,164	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	850	976	107,566	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	300	307	33,850	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	400	467	51,518	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	750	878	96,758	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	450	535	59,011	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	250	312	34,402	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	500	625	68,946	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	150	189	20,884	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	230	292	32,178	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	450	571	63,016	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	250	318	35,093	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	410	518	57,118	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	350	449	49,518	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	200	257	28,418	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	550	721	79,448	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	350	467	51,507	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	150	202	22,304	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	400	496	54,747	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	250	311	34,352	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	400	519	57,222	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	150	188	20,784	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	850	1,046	115,277	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,000	1,288	141,964	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,100	1,280	141,092	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	150	205	22,605	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	200	257	28,344	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	500	569	62,773	2021/11/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	800	863	95,093	2020/8/15
小 計					23,884,386	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	300	291	23,866	2022/3/1

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		
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
カナダ	国債証券	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	650	642	52,642	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	550	541	44,409	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	600	588	48,262	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	950	932	76,407	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	300	285	23,365	2027/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	846	69,408	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	396	32,485	2026/6/1
		2 CAN GOVT 201101	2.0	550	552	45,303	2020/11/1
		2 CAN GOVT 280601	2.0	350	359	29,473	2028/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	80	81	6,691	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	900	932	76,414	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	350	367	30,149	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	400	417	34,224	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	250	258	21,193	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	390	462	37,938	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	150	189	15,562	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	350	361	29,632	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	600	610	50,074	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	390	516	42,358	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	380	520	42,693	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	320	471	38,651	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	300	410	33,667	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	330	490	40,197	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	150	220	18,094	2027/6/1
小	計					963,167	
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	8,368	48,199	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,050	2,352	13,552	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	2,700	2,385	13,740	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,000	8,759	50,453	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,386	31,027	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	3,450	3,395	19,558	2021/12/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	10,200	9,868	56,843	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	3,350	3,231	18,614	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,700	3,516	20,256	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	6,350	5,873	33,828	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,500	6,501	37,450	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	4,700	4,718	27,178	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,800	1,699	9,791	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,700	2,767	15,941	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	2,600	2,608	15,025	2038/11/18
小	計					411,462	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	450	461	56,750	2026/8/15
		0 OBL 210409	—	550	556	68,481	2021/4/9

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 OBL 211008	—	400	406	49,971	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	600	611	75,189	2022/4/8
		0 OBL 230414	—	300	307	37,778	2023/4/14
		0.25 BUND 270215	0.25	600	626	77,011	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	430	446	54,888	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	200	206	25,453	2029/2/15
		0.25 OBL 201016	0.25	600	607	74,694	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	750	792	97,468	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	650	689	84,814	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	720	765	94,186	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	250	265	32,682	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	432	53,134	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	500	545	67,074	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	410	489	60,147	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,390	1,489	183,153	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	350	378	46,493	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	542	66,705	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	750	826	101,684	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	806	99,229	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,050	1,166	143,404	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	500	535	65,833	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	500	61,490	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	550	570	70,152	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	450	480	59,062	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	421	51,772	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	640	948	116,632	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	640	965	118,767	2046/8/15
3 BUND 200704	3.0	600	624	76,788	2020/7/4		
3.25 BUND 210704	3.25	550	595	73,276	2021/7/4		
3.25 BUND 420704	3.25	420	684	84,146	2042/7/4		
4 BUND 370104	4.0	630	1,037	127,621	2037/1/4		
4.25 BUND 390704	4.25	390	687	84,587	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	540	787	96,801	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	500	845	103,988	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	430	816	100,382	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	450	742	91,266	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	570	863	106,137	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	150	197	24,325	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	250	420	51,743	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	400	623	76,707	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	1,200	1,198	147,349	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	98	12,153	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	497	61,228	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	400	401	49,399	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	1,870	1,800	221,384	2023/10/15

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	
イタリア	国債証券	0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	402	49,462	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	148	18,248	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	343	42,264	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	450	451	55,473	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	376	46,272	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	452	55,648	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	600	603	74,192	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	300	291	35,832	2025/5/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	350	340	41,876	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	483	59,479	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	680	600	73,848	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	401	49,392	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,296	159,381	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	130	126	15,573	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	270	264	32,560	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	150	154	18,994	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	800	795	97,821	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	250	225	27,714	2036/9/1
		2.3 ITALY GOVT 211015	2.3	500	516	63,502	2021/10/15
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	290	275	33,849	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	567	69,768	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	420	430	52,915	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	600	534	65,729	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	490	501	61,714	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	170	145	17,844	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	250	240	29,612	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	270	278	34,244	2029/8/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	400	392	48,307	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	330	342	42,078	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	390	391	48,143	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	650	697	85,774	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	550	581	71,450	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	264	32,570	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,000	1,064	130,848	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	546	67,217	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	200	210	25,876	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	628	77,260	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	800	892	109,797	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	250	278	34,265	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,100	1,237	152,225	2024/3/1
4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	400	459	56,489	2026/3/1		
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	650	706	86,914	2021/9/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	170	192	23,616	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	650	776	95,432	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	545	67,053	2044/9/1		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	719	88,457	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	700	814	100,193	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	710	878	107,983	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	700	871	107,187	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	400	495	60,897	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	700	862	106,118	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	850	104,619	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	770	876	107,810	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	550	720	88,603	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,055	129,845	2031/5/1
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	852	104,863	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	737	90,726	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	394	48,532	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 200525	—	850	854	105,118	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	1,900	1,921	236,331	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	950	964	118,579	2022/5/25
		0 O. A. T 240325	—	250	253	31,202	2024/3/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	500	506	62,257	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	400	408	50,186	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,430	1,490	183,304	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	416	51,181	2026/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	1,200	1,263	155,338	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	1,250	1,311	161,310	2028/11/25
		1 O. A. T 251125	1.0	800	860	105,766	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	1,200	1,291	158,874	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	60	64	7,966	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	860	918	112,913	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,050	1,177	144,812	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,050	1,142	140,449	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,000	1,111	136,741	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	250	286	35,230	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	310	334	41,173	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	880	1,038	127,716	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,100	1,203	148,002	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	850	960	118,108	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	1,000	1,044	128,384	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,300	1,599	196,741	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,000	1,227	150,894	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	950	1,048	128,949	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	700	765	94,115	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	660	971	119,437	2045/5/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,250	1,566	192,604	2026/4/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,150	1,246	153,285	2021/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	890	1,388	170,740	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	390	680	83,663	2055/4/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O. A. T 600425	4.0	410	737	90,641	2060/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	1,590	1,921	236,234	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	850	1,440	177,100	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	680	1,098	135,029	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	850	1,291	158,805	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	900	1,512	185,954	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	650	908	111,758	2025/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	350	474	58,304	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	457	56,221	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	880	897	110,357	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	310	38,169	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	650	683	84,059	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	267	32,893	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	100	107	13,161	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	382	47,087	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	550	618	76,073	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	436	53,633	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	410	533	65,617	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	370	575	70,741	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	379	46,667	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	500	523	64,405	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	231	28,527	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	400	679	83,607	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	390	631	77,640	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	430	639	78,687	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	450	458	56,371	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	600	611	75,226	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	450	460	56,626	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	716	88,101	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	550	560	68,875	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	450	477	58,684	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	910	965	118,759	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	410	433	53,274	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	500	533	65,608	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	650	685	84,323	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	535	65,908	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	550	596	73,297	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	550	608	74,853	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	440	484	59,534	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	740	827	101,782	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	490	554	68,240	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	320	365	44,986	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	686	84,409	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	440	524	64,544	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	260	337	41,562	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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	712	87,612	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	800	833	102,463	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	620	880	108,247	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	599	73,706	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	500	635	78,198	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	580	892	109,791	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	613	75,422	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	550	591	72,754	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	410	642	78,979	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	400	559	68,810	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	320	529	65,154	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	550	664	81,653	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	500	556	68,450	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	550	859	105,700	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	816	100,345	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	680	943	116,007	2026/7/30
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	660	982	120,789	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,371	168,682	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	500	526	64,718	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	300	314	38,668	2028/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	370	388	47,770	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	270	289	35,591	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	360	381	46,913	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	190	219	26,966	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	450	499	61,393	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	120	142	17,497	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	572	70,443	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	100	131	16,164	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	550	582	71,601	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	230	357	43,937	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	400	451	55,566	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	496	61,108	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	389	47,937	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	347	42,790	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	360	575	70,780	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	450	590	72,573	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	610	985	121,207	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	550	804	98,945	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	156	19,193	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	250	257	31,628	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	371	45,657	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	150	158	19,509	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	272	33,531	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	169	20,816	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	60	65	8,006	2086/11/2

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	331	40,820	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	480	526	64,721	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	120	164	20,178	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	140	176	21,728	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	190	287	35,357	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	455	55,955	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	438	53,877	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	280	34,510	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	191	23,496	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	555	68,307	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	403	49,593	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	453	55,788	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,254	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	150	151	18,674	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	200	208	25,676	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	120	124	15,270	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	160	167	20,623	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	213	26,283	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	100	108	13,389	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	110	125	15,427	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	129	15,887	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	250	267	32,923	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	167	20,602	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	169	20,897	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	150	186	22,929	2028/7/4
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	161	19,882	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	110	138	17,083	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	100	101	12,437	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	470	485	59,746	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	250	262	32,273	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	200	212	26,158	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	200	211	26,002	2033/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	150	164	20,264	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	220	252	31,107	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	298	36,683	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	293	36,113	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	174	21,439	2023/3/20
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	50	53	6,628	2020/10/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	593	72,924	2025/3/13		
小 計						19,277,139	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	800	794	111,582	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	900	900	126,335	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	520	532	74,748	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	400	405	56,906	2021/1/22

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		
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	1.5 GILT 260722	1.5	550	574	80,591	2026/7/22
	1.625 GILT 281022	1.625	650	684	96,023	2028/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	430	455	63,884	2071/10/22
	1.75 GILT 220907	1.75	650	672	94,325	2022/9/7
	1.75 GILT 370907	1.75	630	654	91,905	2037/9/7
	2 GILT 200722	2.0	750	761	106,854	2020/7/22
	2 GILT 250907	2.0	570	611	85,852	2025/9/7
	2.25 GILT 230907	2.25	250	265	37,319	2023/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	350	468	65,817	2065/7/22
	2.75 GILT 240907	2.75	350	385	54,133	2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	710	948	133,184	2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	500	699	98,228	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	820	1,394	195,720	2068/7/22
	3.75 GILT 200907	3.75	550	571	80,208	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	550	588	82,608	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	530	834	117,068	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	250	273	38,319	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	210	370	51,992	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	350	445	62,536	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	400	543	76,350	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	850	1,207	169,548	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	330	487	68,416	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	460	688	96,628	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,070	1,702	238,965	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	530	873	122,661	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	310	547	76,864	2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	260	372	52,258	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	400	631	88,626	2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	400	556	78,072	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	190	295	41,442	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	400	494	69,475	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	230	334	46,942	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	250	287	40,346	2021/6/7
小計					3,272,751	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	950	1,011	11,561	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	1,300	1,377	15,745	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,600	1,732	19,796	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,200	2,394	27,366	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,350	1,574	18,001	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	2,600	2,919	33,367	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,200	1,836	20,990	2039/3/30
	5 SWD GOVT 201201	5.0	2,050	2,227	25,461	2020/12/1
小計					172,292	

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	701	8,791	2026/2/19	
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	966	12,124	2025/3/13	
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,015	12,736	2027/2/17	
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	600	605	7,597	2029/9/6	
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,792	22,480	2023/5/24	
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	1,050	1,084	13,602	2028/4/26	
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	950	1,020	12,795	2024/3/14	
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,100	2,201	27,606	2021/5/25	
	小 計					117,734	
デンマーク				千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	0.25	550	557	9,182	2020/11/15	
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,900	2,013	33,164	2027/11/15	
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,600	1,746	28,765	2023/11/15	
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,500	2,848	46,920	2025/11/15	
	3 DMK GOVT 211115	3.0	1,800	1,964	32,361	2021/11/15	
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,350	6,125	100,888	2039/11/15	
小 計					251,283		
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	600	601	17,195	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	950	957	27,354	2021/4/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	700	708	20,250	2022/4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,350	1,339	38,278	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	950	933	26,678	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	400	398	11,377	2028/4/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,150	1,200	34,311	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	1,050	1,132	32,354	2023/10/25	
	5.25 POLAND 201025	5.25	750	788	22,548	2020/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	500	548	15,673	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	800	897	25,657	2022/9/23	
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	629	17,979	2029/4/25	
	POLAND 200725	—	300	294	8,423	2020/7/25	
	小 計					298,084	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	400	402	30,683	2020/11/21	
	2 AUST GOVT 211221	2.0	350	357	27,205	2021/12/21	
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	155	11,833	2022/11/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	700	737	56,154	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	250	270	20,594	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	650	695	52,983	2024/4/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	874	66,606	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	800	878	66,884	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	320	353	26,914	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	222	16,970	2035/6/21	
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	250	274	20,902	2041/5/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	240	275	20,961	2047/3/21	

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
国債証券	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	750	830	63,222	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	750	860	65,491	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	250	19,035	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	353	26,909	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	850	1,006	76,634	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	660	878	66,904	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	744	56,652	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	756	57,614	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	750	816	62,171	2021/5/15	
5.75 AUST GOVT 220715	5.75	950	1,083	82,514	2022/7/15		
小 計					995,845		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	50	50	4,006	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	70	70	5,632	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	220	221	17,731	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	100	96	7,750	2036/8/1	
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	80	83	6,649	2028/5/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	350	361	28,907	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	170	174	13,993	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	152	12,216	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	50	53	4,251	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	120	127	10,204	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	250	262	21,014	2024/9/1	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	230	238	19,117	2022/9/1	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	240	243	19,536	2020/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	120	133	10,710	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	220	17,647	2027/3/1	
	小 計					199,370	
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	349	9,207	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	248	6,562	2023/3/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	292	7,709	2027/5/31	
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	350	351	9,278	2021/11/30	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	98	2,610	2028/6/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	252	6,655	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	301	7,964	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	291	7,700	2033/4/15	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	450	11,881	2027/3/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	150	150	3,965	2027/11/16	
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	600	605	15,961	2026/7/15	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	504	13,310	2025/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	486	12,845	2021/9/30	
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	200	5,283	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	400	406	10,718	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	409	10,791	2024/7/15	

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		
マレーシア	%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
国債証券	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	400	405	10,693	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	200	5,280	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	310	8,178	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	522	13,773	2030/4/15
	4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	211	5,567	2033/11/7
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	300	306	8,090	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	550	579	15,279	2037/4/7
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	369	9,744	2043/9/30
小 計					219,056	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	5,600	6,206	47,541	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,000	2,895	22,176	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,500	2,469	18,914	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,500	1,502	11,507	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,550	2,975	22,791	2031/2/28
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	1,950	1,957	14,996	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,493	19,097	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	2,350	2,152	16,486	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	2,700	2,423	18,566	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,350	3,911	29,958	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,850	4,369	33,469	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	1,150	1,079	8,268	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,950	1,816	13,913	2040/1/31
小 計					277,688	
合 計					50,340,263	

(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

(2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 50,340,263	% 97.1
コール・ローン等、その他	1,514,131	2.9
投資信託財産総額	51,854,394	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(50,987,225千円)の投資信託財産総額(51,854,394千円)に対する比率は98.3%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=110.17円	1 カナダドル=81.98円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=122.97円
1 イギリスポンド=140.36円	1 スウェーデンクローネ=11.43円	1 ノルウェークローネ=12.54円	1 デンマーククローネ=16.47円
1 ボーランドズロチ=28.58円	1 オーストラリアドル=76.14円	1 シンガポールドル=80.07円	1 マレーシアリンギット=26.38円
1 南アフリカランド=7.66円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,929,635,687
コール・ローン等	1,157,841,240
公社債(評価額)	50,340,263,696
未収入金	75,363,083
未収利息	329,021,711
前払費用	27,145,957
(B) 負債	874,090,419
未払金	833,189,073
未払解約金	40,901,150
未払利息	196
(C) 純資産総額(A-B)	51,055,545,268
元本	19,128,732,358
次期繰越損益金	31,926,812,910
(D) 受益権総口数	19,128,732,358口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,691円

<注記事項>

- ①期首元本額 18,401,465,597円
 期中追加設定元本額 4,706,119,840円
 期中一部解約元本額 3,978,853,079円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,6691円です。

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

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	169,925,663円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	325,798,151円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	200,530,467円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,083,502,633円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,480,063,598円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,635,995,431円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,246,580,193円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	507,367,195円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	72,837,943円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	310,674,882円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	18,222,047円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	27,112,304円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	20,110,148円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,093,862,518円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	404,001,088円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,301,939,726円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	2,873,673,984円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	7,089円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	21,341,358円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	2,335,185,940円
合計	19,128,732,358円

○損益の状況 (2018年5月22日~2019年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,180,346,760
受取利息	1,180,656,823
支払利息	△ 310,063
(B) 有価証券売買損益	△ 438,352,781
売買益	1,611,437,632
売買損	△ 2,049,790,413
(C) 保管費用等	△ 12,383,121
(D) 当期損益金(A+B+C)	729,610,858
(E) 前期繰越損益金	30,016,940,706
(F) 追加信託差損益金	7,738,195,065
(G) 解約差損益金	△ 6,557,933,719
(H) 計(D+E+F+G)	31,926,812,910
次期繰越損益金(H)	31,926,812,910

- (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。