

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／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。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為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーフンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付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、日本を含む先進国の公社債に直接投資することがあります。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付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ます。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、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）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第4期（決算日：2019年1月28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「eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）」は、去る1月28日に第4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。

MUFG

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。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			合成ベンチマーク		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			
(設定日)	円	円		%		%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	—	—	—	10,000	—	—	—	1
1期(2016年1月26日)	10,141	0	1.4	10,163	1.6	96.9	0.0	537	
2期(2017年1月26日)	10,150	0	0.1	10,223	0.6	97.7	—	167	
3期(2018年1月26日)	10,188	0	0.4	10,309	0.8	98.5	0.1	153	
4期(2019年1月28日)	10,246	0	0.6	10,417	1.1	98.3	0.1	259	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI 総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		合 成 ベ ン チ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2018年1月26日	10,188	—	10,309	—	98.5	0.1
1月末	10,165	△0.2	10,286	△0.2	98.0	0.1
2月末	10,162	△0.3	10,288	△0.2	96.5	0.2
3月末	10,235	0.5	10,367	0.6	98.6	0.2
4月末	10,179	△0.1	10,314	0.1	99.4	0.2
5月末	10,181	△0.1	10,322	0.1	97.4	0.2
6月末	10,197	0.1	10,341	0.3	100.0	0.2
7月末	10,160	△0.3	10,308	△0.0	99.0	0.1
8月末	10,137	△0.5	10,287	△0.2	98.1	0.2
9月末	10,088	△1.0	10,242	△0.7	99.5	0.1
10月末	10,079	△1.1	10,237	△0.7	97.8	0.2
11月末	10,113	△0.7	10,274	△0.3	98.6	0.2
12月末	10,216	0.3	10,384	0.7	97.8	0.0
(期 末) 2019年1月28日	10,246	0.6	10,417	1.1	98.3	0.1

(注) 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4期：2018年1月27日～2019年1月28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4期首	10,188円
第4期末	10,246円
既払分配金	0円
騰落率	0.6%

※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0.6%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 (1.1%) を0.5%下回りました。

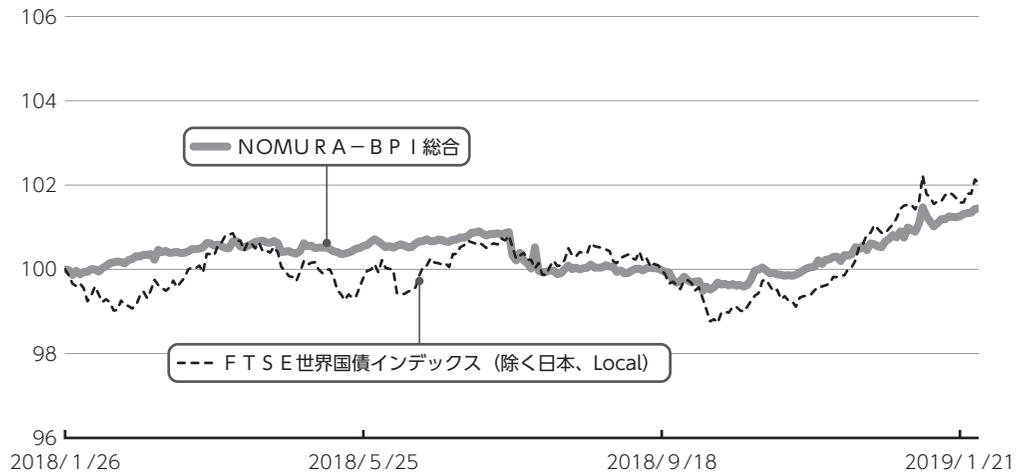
▶ 基準価額の主な変動要因**上昇要因**

内外債券市況の上昇が、基準価額の上昇要因となりました。

第4期：2018年1月27日～2019年1月28日

▶ 投資環境について

市況の推移（期首を100として指数化）



▶ 国内債券市況

国内債券市況は、日本銀行による金融緩和策の柔軟化を受けて下落する局面もありましたが、期末にかけ世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから、期を通じて見ると上昇しました。

▶ 外国債券市況

イタリアの政局不安を受けて同国の債券市況が下落した一方で、米国の利上げ休止観測などを背景に、多くの国の債券市況が上昇したことから、先進国の債券市況は、期首との比較では上昇しました。

- (注) NOMURA-BPI 総合とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- (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。

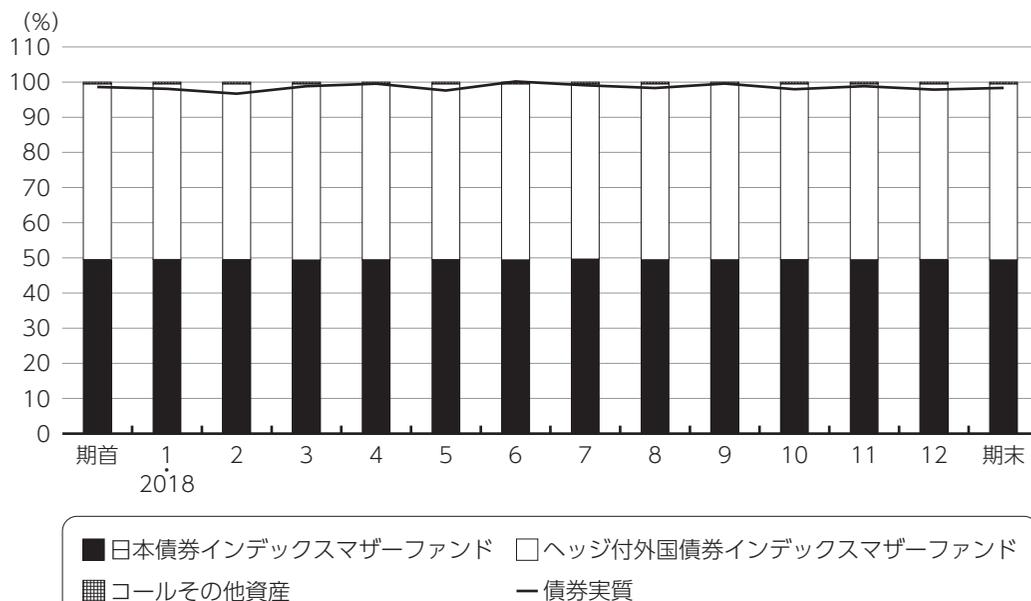
▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)

日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
当期の資産配分の推移は以下の通りです。

(ご参考)

■ 資産別組入比率の推移 (月末ベース)



▶ 日本債券インデックスマザーファンド

基準価額は期首に比べ1.5%の上昇となりました。

資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

（ご参考）

■ 利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2018年1月26日）		期末（2019年1月28日）	
最終利回り	0.2%	最終利回り	0.1%
直接利回り	0.9%	直接利回り	0.8%
デュレーション	8.9年	デュレーション	9.1年

- ・ 数値は債券現物部分で計算しております。
- ・ 最終利回りは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・ 直接利回りは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・ 利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・ デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・ デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

基準価額は期首に比べ0.6%の上昇となりました。

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。

組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

（ご参考）

■ 利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2018年1月26日）		期末（2019年1月28日）	
最終利回り	1.6%	最終利回り	1.8%
直接利回り	2.4%	直接利回り	2.5%
デュレーション	7.0年	デュレーション	7.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

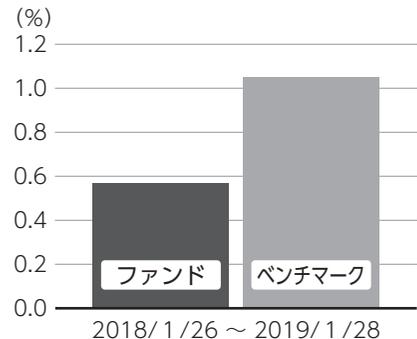
▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

基準価額の騰落率は0.6%の上昇となり、ベンチマークの1.1%の上昇を0.5%下回りました。差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

日本債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.5%程度

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）



▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークは1.4%の上昇となったため、カイ離は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*

※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

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークは0.6%の上昇となったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因

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。

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4期
	2018年1月27日～2019年1月28日
当期分配金 (対基準価額比率)	- (-%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	449

(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。）

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。

組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

▶ ヘッジ付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。

組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1万口当たりの費用明細

（2018年1月27日～2019年1月28日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	44	0.435	(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 ）	(19)	(0.190)	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 ）	(19)	(0.190)	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 ）	(6)	(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) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(c) そ の 他 費 用	1	0.010	(c) 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 ）	(1)	(0.006)	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	45	0.445	
期中の平均基準価額は、10,156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。

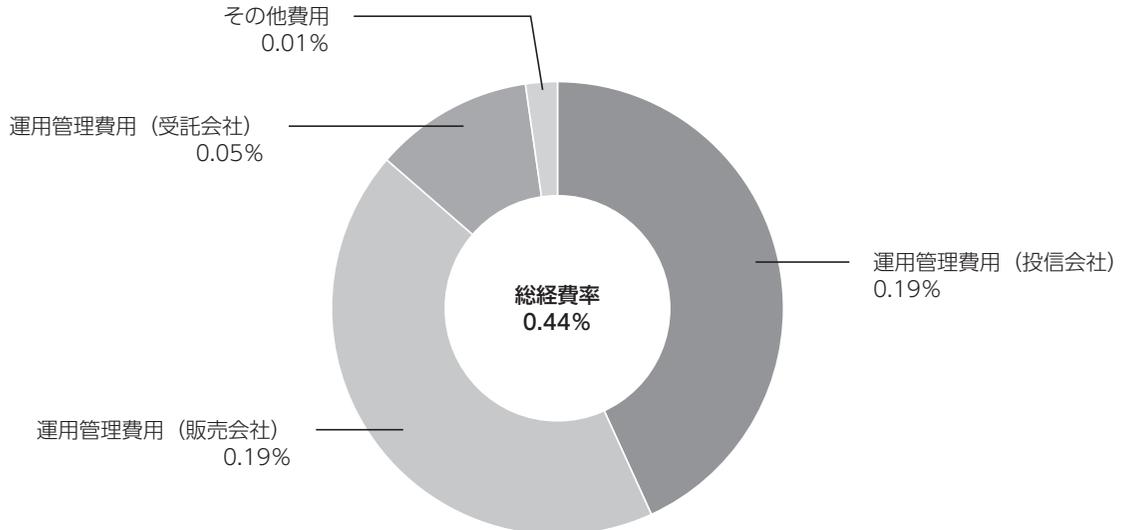
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.44%**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

(2018年1月27日～2019年1月28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
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	81,034	101,992	39,693	49,737
日本債券インデックスマザーファンド	75,397	100,198	37,390	49,556

○利害関係人との取引状況等

(2018年1月27日～2019年1月28日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

該当事項はございません。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 339,412	百万円 93,876	% 27.7	百万円 206,175	百万円 38,868	% 18.9

平均保有割合 0.0%

※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。

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

< ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,544,348	百万円 608,133	% 23.9	百万円 2,591,275	百万円 618,156	% 23.9
為替直物取引	76,217	13,580	17.8	29,203	4,604	15.8

平均保有割合 0.0%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

< 日本債券インデックスマザーファンド >

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 719	百万円 803	百万円 1,442

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,900

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、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2019年1月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	60,833	102,174	129,822
日本債券インデックスマザーファンド	57,598	95,606	128,217

○投資信託財産の構成

(2019年1月28日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	129,822	50.0
日本債券インデックスマザーファンド	128,217	49.4
コール・ローン等、その他	1,765	0.6
投資信託財産総額	259,804	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(224,573,323千円)の投資信託財産総額(227,433,801千円)に対する比率は98.7%です。

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

1 アメリカドル=109.35円	1 カナダドル=82.73円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=124.76円
1 イギリスポンド=144.35円	1 スウェーデンクローネ=12.09円	1 ノルウェークローネ=12.84円	1 デンマーククローネ=16.71円
1 ポーランドズロチ=29.08円	1 オーストラリアドル=78.56円	1 シンガポールドル=80.85円	1 南アフリカランド=8.04円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年1月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	259,804,978
コール・ローン等	1,764,510
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	129,822,843
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	128,217,625
(B) 負債	480,915
未払解約金	11,850
未払信託報酬	464,934
未払利息	3
その他未払費用	4,128
(C) 純資産総額(A-B)	259,324,063
元本	253,106,128
次期繰越損益金	6,217,935
(D) 受益権総口数	253,106,128口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,246円

<注記事項>

- ①期首元本額 150,924,525円
 期中追加設定元本額 215,119,621円
 期中一部解約元本額 112,938,018円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0246円です。

②分配金の計算過程

項 目	2018年1月27日～ 2019年1月28日
費用控除後の配当等収益額	2,443,922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	7,312,536円
分配準備積立金額	1,609,158円
当ファンドの分配対象収益額	11,365,616円
1万口当たり収益分配対象額	449円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2018年1月27日～2019年1月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 554
受取利息	1
支払利息	△ 555
(B) 有価証券売買損益	2,591,897
売買益	2,998,295
売買損	△ 406,398
(C) 信託報酬等	△ 845,710
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,745,633
(E) 前期繰越損益金	△1,079,752
(F) 追加信託差損益金	5,552,054
(配当等相当額)	(7,079,961)
(売買損益相当額)	(△1,527,907)
(G) 計(D+E+F)	6,217,935
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,217,935
追加信託差損益金	5,552,054
(配当等相当額)	(7,312,536)
(売買損益相当額)	(△1,760,482)
分配準備積立金	4,053,080
繰越損益金	△3,387,199

- (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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

- ①商品性として無手数料とするため、販売手数料に係る記載の削除および記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年4月26日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年4月26日)
- ③本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。
- ④2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

日本債券インデックスマザーファンド

《第17期》決算日2018年5月14日

[計算期間：2017年5月13日～2018年5月14日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月14日に第17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17期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	NOMURA-BPI総合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NOMURA-BPI総合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。
主要運用対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社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は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	債先物比率	純資産総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2	457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3	544,273

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2017年5月12日	13,180	—	378.85	—	99.3	0.2
5月末	13,204	0.2	379.55	0.2	99.3	0.2
6月末	13,167	△0.1	378.57	△0.1	99.5	0.3
7月末	13,170	△0.1	378.55	△0.1	100.2	0.1
8月末	13,240	0.5	380.58	0.5	99.6	0.4
9月末	13,193	0.1	379.27	0.1	99.4	0.2
10月末	13,193	0.1	379.27	0.1	99.4	0.3
11月末	13,228	0.4	380.26	0.4	99.0	0.4
12月末	13,236	0.4	380.51	0.4	99.6	0.2
2018年1月末	13,215	0.3	379.85	0.3	99.4	0.3
2月末	13,265	0.6	381.29	0.6	97.5	0.4
3月末	13,286	0.8	381.91	0.8	99.6	0.4
4月末	13,276	0.7	381.64	0.7	99.3	0.4
(期 末) 2018年5月14日	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%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(0.8%)とほぼ同程度となりました。

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

・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市場は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

・ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●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0.8%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。

・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

・年限構成、種別構成、デュレーション(平均回収期間や金利感応度)、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。

・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、 0.0% 程度となりました。

◎今後の運用方針

・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持します。

・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

○1万口当たりの費用明細

(2017年5月13日～2018年5月14日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,222円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年5月13日～2018年5月14日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	303,108,641	234,242,516
	地方債証券	15,154,496	10,205,885
	特殊債券	22,011,187	15,106,140
	社債券	10,673,329	(8,130,265) (100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 15,973	百万円 15,079	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 350,947	百万円 82,945	% 23.6	百万円 267,684	百万円 61,470	% 23.0

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 319	百万円 502	百万円 1,547

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,000

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モルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2018年5月14日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	408,788,000 (100,000)	444,023,378 (100,145)	81.6 (0.0)	— (—)	51.7 (—)	19.2 (—)	10.6 (0.0)
地方債証券	28,747,780 (28,747,780)	30,287,806 (30,287,806)	5.6 (5.6)	— (—)	3.9 (3.9)	1.2 (1.2)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	32,520,095 (32,520,095)	34,739,428 (34,739,428)	6.4 (6.4)	— (—)	4.5 (4.5)	1.5 (1.5)	0.4 (0.4)
金融債券	3,400,000 (3,400,000)	3,404,958 (3,404,958)	0.6 (0.6)	— (—)	0.0 (0.0)	0.4 (0.4)	0.2 (0.2)
普通社債券	22,683,000 (22,683,000)	23,349,438 (23,349,438)	4.3 (4.3)	0.1 (0.1)	1.9 (1.9)	1.8 (1.8)	0.6 (0.6)
合 計	496,138,875 (87,450,875)	535,805,011 (91,881,777)	98.4 (16.9)	0.1 (0.1)	62.0 (10.3)	24.1 (4.9)	12.3 (1.7)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第377回利付国債 (2年)	0.1	1,500,000	1,503,900	2019/6/15
第378回利付国債 (2年)	0.1	1,500,000	1,504,200	2019/7/15
第381回利付国債 (2年)	0.1	3,500,000	3,511,935	2019/10/15
第382回利付国債 (2年)	0.1	1,400,000	1,405,054	2019/11/15
第383回利付国債 (2年)	0.1	4,190,000	4,205,963	2019/12/15
第384回利付国債 (2年)	0.1	2,450,000	2,459,849	2020/1/15
第385回利付国債 (2年)	0.1	6,050,000	6,075,531	2020/2/15
第386回利付国債 (2年)	0.1	6,350,000	6,378,003	2020/3/15
第387回利付国債 (2年)	0.1	1,500,000	1,506,915	2020/4/15
第118回利付国債 (5年)	0.2	2,260,000	2,268,452	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	450,000	451,188	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,500,000	2,511,325	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	1,580,000	1,585,008	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	3,270,000	3,282,033	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,560,000	1,566,489	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	2,430,000	2,441,493	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	4,400,000	4,423,320	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	2,960,000	2,977,345	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	2,770,000	2,787,783	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	2,550,000	2,567,824	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	2,750,000	2,770,350	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	3,150,000	3,174,475	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	3,110,000	3,135,222	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	4,250,000	4,285,827	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	4,620,000	4,661,349	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	6,010,000	6,066,914	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	3,980,000	4,019,720	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	475,000	684,498	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	680,000	948,382	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	583,000	817,109	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	1,008,000	1,419,374	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	1,045,000	1,414,794	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,070,000	1,419,740	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,100,000	1,393,249	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,140,000	1,338,451	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,870,000	1,592,548	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	1,980,000	1,994,335	2057/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	2,072,000	2,109,378	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,250,000	2,288,115	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,373,429	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,192,791	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,258,000	3,332,934	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	3,688,000	3,792,444	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,652,600	2020/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,415,343	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	3,700,000	3,795,756	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,486,000	1,525,408	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,100,000	2,145,780	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	6,860,000	7,097,081	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,089,838	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	3,390,000	3,508,616	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,853,000	1,929,362	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	1,780,000	1,847,818	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,757,000	1,829,107	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	1,930,000	2,002,703	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	5,519,000	5,761,394	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	1,980,000	2,059,794	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,622,818	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,170,000	1,215,641	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,744,278	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	2,800,000	2,904,300	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,835,000	3,984,948	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	730,000	756,812	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,540,000	2,645,029	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	3,700,000	3,826,133	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	7,710,000	8,063,503	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,930,000	3,069,350	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,060,000	1,099,018	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	5,490,000	5,699,992	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	4,180,000	4,345,653	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,280,000	4,454,238	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,370,000	3,490,275	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	4,080,000	4,229,980	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,340,000	1,371,503	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,030,000	3,123,657	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,560,000	4,704,506	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	3,570,000	3,685,775	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	3,220,000	3,302,174	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,450,000	3,483,879	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	3,360,000	3,391,315	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,630,000	2,653,065	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	5,090,000	5,131,534	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,640,000	2,659,800	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	3,450,000	3,475,047	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	3,250,000	3,272,717	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	3,590,000	3,612,293	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,820,000	1,829,809	2028/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	99,029	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	123,931	2030/2/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第3回利付国債(30年)	2.3	117,000	147,031	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	127,000	169,912	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	108,000	136,000	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	169,000	218,366	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	164,000	210,515	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	142,000	173,088	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	116,000	134,884	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	185,000	207,212	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	137,000	165,539	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	220,000	279,136	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	205,000	257,318	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	493,000	650,104	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	346,000	462,539	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	302,000	404,607	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	327,000	433,866	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	427,000	560,352	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	303,000	398,641	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	495,000	668,532	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	379,000	499,866	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	570,000	772,606	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	554,000	752,248	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	411,000	559,029	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	742,000	983,506	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	884,000	1,189,678	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	860,000	1,175,912	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	911,000	1,248,971	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,050,000	1,425,070	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,196,000	1,605,450	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,278,000	1,695,484	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,639,000	2,215,682	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,794,000	2,320,987	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,606,000	2,152,553	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,089,000	2,718,603	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,829,000	2,385,564	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,047,000	2,629,146	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,295,000	1,638,097	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,280,000	1,648,371	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	920,000	1,164,195	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	1,070,000	1,329,710	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,050,000	1,305,517	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,180,000	1,467,920	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,120,000	1,395,553	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,340,000	1,605,588	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,350,000	1,617,840	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,720,000	2,103,732	2045/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,380,000	1,620,340	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,480,000	1,737,712	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	1,540,000	1,575,882	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,550,000	1,386,506	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	1,510,000	1,425,062	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	1,380,000	1,335,964	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	1,370,000	1,396,167	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	1,300,000	1,323,426	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	1,360,000	1,383,011	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	1,560,000	1,584,648	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	1,260,000	1,278,471	2048/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	77,038	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	503,366	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	120,255	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	223,324	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	547,795	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	213,232	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	229,994	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	520,075	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	260,655	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	487,901	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	159,846	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	637,845	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	304,331	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	484,785	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	487,917	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	353,317	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	552,720	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	958,737	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	485,540	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	182,132	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	607,141	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	703,929	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	363,152	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	659,473	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	226,636	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	239,410	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	466,621	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	57,261	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	362,987	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	402,489	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	766,159	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	480,005	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	773,602	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	571,634	2026/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	608,894	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	528,507	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	954,918	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	483,636	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,302,620	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	558,118	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,432,000	1,689,888	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	390,000	458,394	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	615,000	728,283	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	1,017,000	1,227,590	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	320,000	380,448	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	343,000	412,594	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	470,000	560,977	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,345,000	1,610,731	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,060,000	1,283,925	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	705,282	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	530,000	654,815	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	640,000	784,294	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	361,611	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,233,404	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	891,000	1,086,583	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	567,000	687,742	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	800,000	953,536	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	800,000	956,048	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	976,000	1,187,362	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	711,000	875,368	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,140,000	1,391,028	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,782,000	2,180,758	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,251,764	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	954,000	1,181,691	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	546,000	678,252	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,860,000	2,288,823	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	776,000	948,279	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	790,812	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	1,010,000	1,186,133	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,169,000	1,417,926	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	912,608	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,448,000	1,797,170	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	800,000	982,408	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	934,000	1,173,104	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	640,000	787,737	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	840,000	1,023,338	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,274,000	1,555,401	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	650,000	785,252	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,012,000	1,224,934	2031/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第131回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,053,694	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	1,207,000	1,446,698	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	1,340,000	1,624,937	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	885,000	1,075,053	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	600,000	720,288	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	800,000	949,616	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	762,000	916,213	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	750,000	881,272	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	380,000	451,706	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	2,127,000	2,561,354	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	1,550,000	1,867,889	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	1,090,000	1,329,843	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	1,410,000	1,681,284	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	1,100,000	1,295,899	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	2,560,000	3,093,299	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	2,180,000	2,635,598	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	2,690,000	3,213,527	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	2,190,000	2,583,630	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	2,570,000	3,034,270	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	2,440,000	2,845,015	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	2,590,000	2,937,681	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	2,390,000	2,708,849	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	2,910,000	3,345,190	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	2,110,000	2,389,680	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	2,530,000	2,779,584	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	2,180,000	2,169,143	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	2,390,000	2,290,002	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	2,420,000	2,440,497	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	1,950,000	1,996,761	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	2,340,000	2,433,155	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	1,990,000	2,029,999	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	2,190,000	2,228,631	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	2,080,000	2,113,342	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	1,800,000	1,791,900	2038/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,145	2018/11/15
小	計		408,788,000	444,023,378	
地方債証券					
第1回東京都公募公債 (20年)		1.54	20,000	21,538	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	10,000	13,389	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)		2.23	80,000	102,886	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)		2.01	100,000	118,606	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)		2.09	80,000	96,297	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)		2.19	80,000	97,443	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)		1.92	120,000	143,124	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)		1.98	70,000	84,667	2031/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	116,677	2033/3/18
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	50,881	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	102,162	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	102,510	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	102,528	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	102,203	2020/6/19
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	103,839	2021/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	176,686	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	103,051	2022/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	100,000	103,799	2023/12/20
第752回東京都公募公債	0.126	100,000	100,233	2025/12/19
第754回東京都公募公債	0.06	120,000	119,578	2026/3/19
第755回東京都公募公債	0.06	300,000	298,947	2026/3/19
第758回東京都公募公債	0.03	300,000	297,855	2026/6/19
第765回東京都公募公債	0.21	300,000	301,701	2027/3/19
第768回東京都公募公債	0.185	200,000	200,626	2027/6/18
第769回東京都公募公債	0.21	200,000	201,076	2027/6/18
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	102,245	2019/12/25
平成21年度第14回北海道公募公債	1.52	100,000	102,664	2020/2/26
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	102,286	2020/10/29
平成25年度第4回北海道公募公債	0.85	100,000	104,085	2023/6/28
平成25年度第7回北海道公募公債	0.8	150,000	155,869	2023/8/30
平成25年度第9回北海道公募公債	0.7	300,000	310,374	2023/10/31
平成27年度第1回北海道公募公債	0.43	100,000	102,246	2025/4/30
平成27年度第9回北海道公募公債	0.486	200,000	205,338	2025/10/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,655	2026/2/26
第29回1号宮城県公募公債	0.68	100,000	103,396	2023/10/25
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	80,000	90,902	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	80,000	111,036	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債 (20年)	2.11	100,000	114,255	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	114,008	2034/9/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	142,909	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	115,720	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	55,672	2019/9/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	102,550	2020/3/20
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	103,256	2022/6/20
第226回神奈川県公募公債	0.195	300,000	300,783	2027/3/19
第228回神奈川県公募公債	0.205	200,000	200,626	2027/6/18
第5回大阪府公募公債 (20年)	2.16	100,000	121,473	2030/5/28
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	200,000	235,548	2033/9/27
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	102,014	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	73,307	2019/11/27
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	71,633	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,370	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	103,695	2021/7/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	57,972	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,056	2022/3/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	110,314	2023/9/27
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	206,880	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	400,000	411,404	2024/9/27
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	102,794	2024/10/30
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	112,729	2025/2/26
第418回大阪府公募公債	0.22	100,000	100,349	2027/3/30
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,425	2019/12/24
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	145,230	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	233,792	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	103,053	2023/3/22
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	108,244	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債 (18年)	1.26	200,000	222,702	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	52,734	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,263	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,753	2028/5/26
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	108,638	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債 (20年)	1.64	300,000	349,713	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	117,518	2032/11/19
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	102,295	2019/11/20
平成27年度第6回兵庫県公募公債	0.56	200,000	206,336	2025/8/18
第3回静岡県公募公債 (15年)	1.368	100,000	111,001	2027/10/29
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	53,946	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	104,501	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	102,512	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	102,347	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	102,671	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	104,585	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	134,546	2023/10/24
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	124,788	2025/5/21
平成27年度第5回静岡県公募公債	0.578	100,000	103,407	2025/6/20
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	103,442	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	103,321	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	103,440	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	103,567	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	103,346	2022/11/30
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)	1.314	300,000	332,055	2027/12/13
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	103,102	2024/8/26
平成26年度第12回愛知県公募公債	0.515	100,000	102,758	2024/10/25
平成27年度第5回愛知県公募公債	0.544	100,000	103,138	2025/5/27
平成27年度第18回愛知県公募公債	0.22	100,000	100,730	2026/2/16
平成28年度第1回愛知県公募公債	0.08	100,000	99,609	2026/4/28
平成28年度第8回愛知県公募公債	0.065	108,000	107,293	2026/8/26
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	100,000	100,810	2027/2/12

銘柄	利	当期末		
		率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円	
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	27,640	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	103,504	2021/5/27
平成27年度第1回広島県公募公債	0.549	100,000	103,173	2025/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,696	2025/11/25
平成29年度第3回広島県公募公債	0.15	100,000	99,722	2027/9/27
第4回埼玉県公募公債(20年)	2.18	200,000	237,138	2027/9/21
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	100,000	102,052	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	103,946	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	103,724	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	103,405	2022/10/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,634	2025/1/28
平成27年度第6回埼玉県公募公債	0.505	200,000	205,782	2025/9/29
平成29年度第6回埼玉県公募公債	0.15	100,000	99,722	2027/9/27
平成29年度第8回埼玉県公募公債	0.245	200,000	201,046	2028/1/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	94,930	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	103,606	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	102,517	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	102,460	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,446	2020/10/28
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	1.491	100,000	111,308	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	100,000	102,342	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債	0.654	100,000	103,526	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,635	2025/12/25
第2回千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	117,496	2026/9/18
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	80,000	94,737	2030/10/11
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	82,656	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,744	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	20,800	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	103,508	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	84,707	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	100,000	103,363	2023/11/24
平成28年度第5回千葉県公募公債	0.15	100,000	99,914	2026/12/25
平成28年度第8回千葉県公募公債	0.22	200,000	200,960	2027/3/25
平成29年度第1回千葉県公募公債	0.175	120,000	120,052	2027/5/25
平成29年度第3回千葉県公募公債	0.22	100,000	100,406	2027/7/23
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	23,386	2019/7/29
平成28年度第2回新潟県公募公債	0.18	100,000	100,171	2027/1/29
第15回群馬県公募公債	0.08	200,000	198,734	2026/11/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債	0.06	100,000	99,247	2026/10/30
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	103,679	2022/10/31
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	101,795	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,192	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	130,000	132,415	2019/9/25
第79回共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	203,794	2019/10/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	111,781	2019/12/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	30,773	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	103,480	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	103,743	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,325	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	103,323	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	207,370	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	176,800	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	103,440	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,143	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,416	2022/9/22
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,152	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,105	2023/3/24
第126回共同発行市場公募地方債	0.81	210,000	218,542	2023/9/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,396	2023/10/25
第129回共同発行市場公募地方債	0.71	200,000	207,276	2023/12/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,977	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	206,950	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	207,110	2024/6/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,458	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,396	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	205,184	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	102,146	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,392	2025/5/23
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	308,769	2025/9/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,673	2025/12/25
第163回共同発行市場公募地方債	0.06	500,000	496,245	2026/10/23
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	300,513	2027/1/25
第172回共同発行市場公募地方債	0.225	200,000	200,904	2027/7/23
第178回共同発行市場公募地方債	0.23	200,000	200,760	2028/1/25
平成24年度第2回堺市公募公債	0.715	200,000	206,246	2022/12/19
平成25年度第1回長崎県公募公債	0.81	200,000	208,144	2023/9/27
平成23年度第1回滋賀県公募公債	1.02	100,000	103,490	2021/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債	0.65	100,000	103,261	2023/11/29
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,700	2022/10/26
平成28年度第1回熊本市公募公債	0.08	100,000	99,366	2026/11/30
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	56,674	2020/12/24
平成26年度第1回新潟市公募公債	0.456	100,000	102,441	2024/12/25
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	39,561	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	167,409	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	226,274	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	122,843	2028/9/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	127,951	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,340	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,252	2024/9/27
第1回名古屋市長公募公債(12年)	1.033	100,000	106,617	2025/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第1回名古屋市政公債(20年)	1.99	200,000	221,556	2023/12/20
第9回名古屋市政公債(20年)	2.07	400,000	477,404	2028/12/20
第10回名古屋市政公債(20年)	2.26	80,000	97,606	2029/8/17
第477回名古屋市政公債	1.034	100,000	103,595	2021/12/20
第1回京都市公債(20年)	2.14	200,000	227,064	2024/12/20
第5回京都市公債(20年)	2.36	50,000	59,355	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公債	1.049	100,000	103,325	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公債	0.801	100,000	103,395	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公債(20年)	2.54	120,000	143,248	2026/6/19
平成22年度第4回神戸市公債	1.895	100,000	119,040	2030/9/13
平成22年度第9回神戸市公債(20年)	2.09	80,000	97,393	2031/1/24
平成29年度第6回神戸市公債	0.23	300,000	301,107	2027/10/15
第7回横浜市公債(20年)	2.06	200,000	229,398	2025/12/19
第17回横浜市公債(20年)	2.07	80,000	95,283	2028/12/20
第20回横浜市公債(20年)	2.1	80,000	96,338	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公債	0.81	100,000	103,668	2023/2/20
第25回横浜市公債(20年)	1.72	100,000	118,097	2032/7/16
平成27年度第2回横浜市公債	0.568	200,000	206,662	2025/6/16
第27回横浜市公債(20年)	1.599	60,000	70,044	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公債	1.36	112,000	114,014	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公債(30年)	2.277	80,000	104,593	2040/9/20
平成27年度第9回札幌市公債	0.19	100,000	100,564	2025/12/19
第3回川崎市公債(15年)	1.82	100,000	104,660	2020/12/21
第44回川崎市公債(5年)	0.162	130,400	130,761	2020/6/19
第82回川崎市公債	1.52	100,000	102,016	2019/9/20
第17回北九州市公債(20年)	1.529	100,000	115,941	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公債	0.728	300,000	311,223	2023/12/26
平成22年度第9回福岡市公債	1.32	106,500	110,428	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公債	1.0	100,000	103,331	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公債	0.8	200,000	206,822	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公債	0.68	50,000	51,697	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公債(20年)	1.371	100,000	113,512	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公債	0.72	100,000	103,698	2023/12/27
平成22年度第2回千葉市公債	0.92	100,000	102,171	2020/10/22
平成22年度第1回三重県公債	1.056	87,050	89,323	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公債	1.021	98,410	101,847	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公債	0.46	100,000	102,085	2023/4/26
平成27年度第4回福井県公債	0.085	200,000	199,296	2026/4/27
平成26年度第1回徳島県公債	0.495	100,000	102,667	2024/11/28
平成26年度第1回岡山市公債	0.33	100,000	101,602	2025/1/30
平成28年度第1回岡山市公債	0.18	100,000	100,171	2027/1/29
平成28年度第1回秋田県公債	0.205	100,000	100,349	2027/3/25
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	199,616	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000	120,899	2028/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	102,764	2024/3/19
小 計			28,747,780	30,287,806	
特殊債券(除く金融債)					
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	241,196	2029/5/31
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	101,736	2019/7/31
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	179,000	182,286	2019/9/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	120,990	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	121,088	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	139,000	141,773	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	210,000	214,798	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	132,141	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	50,000	51,228	2020/3/19
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	300,000	308,418	2020/4/30
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	121,629	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	444,000	456,578	2020/6/30
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	141,000	144,529	2020/7/31
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	102,453	2020/9/30
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	300,000	306,876	2020/10/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	400,000	409,484	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	71,000	73,293	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	121,192	2031/1/31
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	400,000	415,736	2021/4/30
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	94,122	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	660,000	683,839	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	126,124	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	103,548	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	238,676	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	140,949	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	115,933	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	109,000	112,877	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.977	100,000	103,967	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	118,770	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	247,538	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	12,000	12,456	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.819	301,000	312,070	2022/9/30
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.805	100,000	103,755	2022/11/30
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	103,309	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	114,437	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	157,195	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	104,601	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	223,000	233,746	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.801	100,000	104,336	2023/9/29
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	200,000	207,472	2024/2/29
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	222,000	230,209	2024/3/29
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	103,785	2024/6/28

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	103,541	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	114,712	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	103,251	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	102,847	2024/12/27
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	101,876	2025/1/31
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.45	100,000	102,813	2025/3/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.391	200,000	204,802	2025/4/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	200,000	206,240	2025/6/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.557	200,000	207,288	2025/7/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	130,000	132,594	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,620	2026/2/27
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	200,000	200,258	2027/1/29
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,367	2027/8/31
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	103,539	2020/7/15
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.576	300,000	306,063	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	25,415	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	200,000	203,848	2019/8/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.46	400,000	407,344	2022/2/25
第4回政府保証公営企業債券(15年)	2.0	100,000	107,985	2022/4/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	300,000	327,792	2022/7/15
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	102,245	2020/1/20
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	149,000	152,742	2020/2/14
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	102,435	2020/3/13
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	102,460	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	102,408	2020/9/14
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.15	200,000	201,066	2021/5/28
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	31,128	2021/3/12
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	103,780	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,738	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,019	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	103,769	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	103,496	2022/8/15
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,562	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,114	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	166,113	2023/12/18
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,518	2024/7/16
第80回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.32	100,000	101,989	2026/1/19
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.005	203,000	201,554	2026/10/16
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	104,000	104,362	2027/3/15
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	114,000	114,300	2027/4/16
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	200,000	200,358	2027/6/14
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	400,000	401,460	2027/8/13
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.09	100,000	99,768	2027/9/17
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	106,226	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	125,200	2019/9/17

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,973	2023/2/24
第27回政府保証日本政策金融公庫債券	0.372	200,000	201,018	2019/8/19
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,743	2025/9/16
第211回政府保証預金保険機構債券	0.1	100,000	100,428	2021/10/19
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	102,523	2020/2/17
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	400,000	413,220	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,764	2023/12/18
第39回政府保証日本政策投資銀行	0.145	106,000	106,369	2027/3/15
第41回政府保証日本政策投資銀行	0.09	100,000	99,768	2027/9/15
第78回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.225	200,000	200,436	2027/4/13
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	20,000	23,558	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	133,443	2032/5/20
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.52	100,000	118,832	2026/6/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	600,000	707,388	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	44,624	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	145,891	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	187,216	2047/3/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	119,766	2027/10/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	364,680	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	230,000	262,561	2025/3/21
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	150,000	184,090	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	60,542	2030/5/10
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	59,874	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	117,330	2032/6/18
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	124,709	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	101,811	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	60,710	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	81,325	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,929	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	109,364	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	110,785	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	56,998	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	121,122	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	102,631	2020/6/26
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	98,155	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	102,667	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	94,960	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	119,037	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	51,638	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	103,398	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	234,084	2032/6/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	350,901	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	75,422	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	59,333	2033/1/28
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.035	300,000	310,431	2021/11/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
F 77回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.519	200,000	222,440	2026/10/20
第77回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	0.491	100,000	102,590	2025/10/28
F 89回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.602	300,000	338,433	2027/8/20
F 123回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.6	100,000	114,606	2030/3/19
F 124回地方公共団体金融機構債券	1.418	200,000	221,774	2027/6/4
F 131回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.546	100,000	114,742	2031/7/30
F 147回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.291	150,000	164,370	2027/3/19
F 197回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.052	500,000	539,305	2027/10/29
F 226回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.096	100,000	108,545	2029/2/28
第10回日本政策金融公庫 (財投機関債)	2.167	80,000	96,974	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫 (財投機関債)	1.911	80,000	95,019	2030/10/29
第78回都市再生債券 (財投機関債)	1.34	400,000	443,372	2028/3/17
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	16,988	17,857	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	17,039	18,020	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	18,268	19,331	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	17,388	18,506	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	17,922	18,988	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	14,955	15,523	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	15,603	16,491	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	17,790	18,768	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	18,031	19,035	2038/11/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	2.46	200,000	240,494	2027/6/18
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	15,721	16,610	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	11,612	11,808	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	18,994	20,010	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	11,238	11,406	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	16,484	17,450	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	19,347	20,607	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	24,318	24,760	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	16,966	17,963	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	20,173	21,380	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	12,750	13,037	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	20,188	20,759	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	22,726	23,485	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	23,047	23,862	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	69,732	71,934	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	14,450	14,946	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	15,134	15,852	2039/7/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	57,330	62,307	2044/6/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	15,194	15,656	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	33,914	35,167	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	18,326	19,037	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	35,235	37,657	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	37,347	39,724	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	38,138	40,448	2045/5/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	17,703	18,501	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	40,769	42,971	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	17,064	17,800	2041/2/10
第39回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.15	300,000	361,308	2029/9/20
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	42,994	44,949	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	18,583	19,608	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	16,806	17,788	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	49,219	52,145	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	48,601	51,875	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	41,406	44,067	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	37,593	40,129	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	116,718	124,638	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	38,153	40,519	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	38,742	41,008	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	16,639	17,580	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	41,958	44,444	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	44,867	47,333	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	46,819	49,362	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	51,286	54,035	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	153,033	161,362	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	52,254	55,120	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	54,651	57,396	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	56,287	58,840	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.13	50,000	60,796	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	55,639	57,881	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	58,392	60,844	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	53,915	56,473	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	59,837	63,047	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	97,055	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	365,883	382,797	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	33,792	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	54,821	57,044	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	118,700	123,546	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	58,765	61,176	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	61,511	63,956	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	124,142	128,902	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	126,774	131,727	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	119,063	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	67,506	69,912	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	203,562	209,917	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	138,346	142,435	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	70,001	71,667	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	146,784	149,029	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	246,279	253,261	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	246,705	255,065	2050/7/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	165,564	170,964	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	119,668	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	221,674	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	427,765	441,487	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.472	600,000	668,190	2027/6/18
第111回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.404	100,000	110,708	2027/6/18
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	282,213	283,234	2051/12/10
第117回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.438	100,000	111,257	2027/9/17
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	286,368	288,741	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	169,893	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	118,688	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	586,272	588,376	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	98,657	99,011	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	99,020	99,654	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	99,479	99,799	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	199,702	199,941	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	200,000	200,062	2053/5/10
第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.484	200,000	204,942	2025/12/19
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.24	1,100,000	1,103,333	2027/3/19
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	56,720	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	84,266	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,181	2021/12/20
第39回東日本高速道路		0.03	300,000	299,622	2021/12/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	51,691	2021/9/17
第27回西日本高速道路		0.58	200,000	205,766	2025/9/2
第29回西日本高速道路		0.31	400,000	403,508	2026/2/12
第30回西日本高速道路		0.17	300,000	299,184	2026/5/22
小	計		32,520,095	34,739,428	
金融債券					
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,151	2019/10/25
い第775号商工債券		0.2	600,000	600,966	2019/12/27
い第776号商工債券		0.17	100,000	100,119	2020/1/27
い第781号商工債券		0.24	100,000	100,254	2020/6/26
い第769号農林債券		0.3	100,000	100,291	2019/6/27
い第774号農林債券		0.24	100,000	100,307	2019/11/27
第304回信中金債		0.225	200,000	200,690	2020/3/27
第310回信中金債		0.225	200,000	200,756	2020/9/25
第311回信中金債		0.225	200,000	200,784	2020/10/27
第315回信中金債		0.075	200,000	200,054	2021/2/26
第322回信中金債		0.03	400,000	399,116	2021/9/27
第325回信中金債		0.04	100,000	99,801	2021/12/27
第327回信中金債		0.06	200,000	199,732	2022/2/25
第332回信中金債		0.09	300,000	299,685	2022/7/27
第336回信中金債		0.1	200,000	199,864	2022/11/25
第338回信中金債		0.11	200,000	199,952	2023/1/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
第11号商工債券 (10年)		0.66	100,000	102,436	2024/9/20
小 計			3,400,000	3,404,958	
普通社債券					
第534回東京電力		2.055	100,000	102,738	2019/10/29
第559回東京電力		1.377	60,000	61,050	2019/10/29
第563回東京電力		1.39	100,000	102,354	2020/5/28
第567回東京電力		1.958	100,000	112,502	2030/7/29
第568回東京電力		1.155	100,000	102,088	2020/9/8
第490回中部電力		1.444	70,000	71,184	2019/7/25
第499回中部電力		1.194	50,000	52,553	2023/6/23
第500回中部電力		0.875	100,000	103,711	2024/5/24
第518回中部電力		0.19	200,000	199,998	2023/1/25
第496回関西電力		0.908	100,000	103,836	2025/2/25
第499回関西電力		0.68	200,000	204,792	2026/1/23
第508回関西電力		0.455	200,000	200,600	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	100,000	100,618	2027/7/23
第512回関西電力		0.32	200,000	199,936	2024/10/25
第381回中国電力		0.953	100,000	104,089	2024/4/25
第382回中国電力		0.517	100,000	101,277	2021/5/25
第385回中国電力		0.728	100,000	103,051	2025/7/25
第402回中国電力		0.25	200,000	199,682	2024/10/25
第304回北陸電力		0.989	100,000	104,141	2023/10/25
第307回北陸電力		1.055	100,000	105,738	2026/6/25
第310回北陸電力		0.748	200,000	206,314	2025/6/25
第322回北陸電力		0.38	200,000	200,086	2027/6/25
第481回東北電力		0.803	200,000	206,868	2025/7/25
第490回東北電力		0.22	100,000	99,999	2023/2/24
第494回東北電力		0.425	100,000	100,307	2027/6/25
第245回四国電力		2.0	100,000	105,881	2021/6/25
第253回四国電力		1.0	100,000	104,071	2023/6/23
第371回九州電力		1.43	100,000	105,616	2022/12/22
第429回九州電力		0.909	200,000	207,480	2024/9/25
第430回九州電力		0.54	100,000	101,406	2021/10/25
第437回九州電力		0.685	100,000	102,548	2026/1/23
第310回北海道電力		1.286	50,000	51,507	2020/12/25
第316回北海道電力		1.164	400,000	408,984	2020/6/25
第319回北海道電力		0.514	200,000	201,266	2019/9/25
第19回沖縄電力		1.452	80,000	82,180	2020/4/24
第347回東京交通債券		2.05	100,000	111,053	2024/3/8
第38回関西国際空港		1.112	50,000	51,872	2021/12/20
第18回成田国際空港		0.556	100,000	102,769	2025/10/30
第7回大和ハウス工業		0.06	200,000	199,500	2021/6/18
第7回明治ホールディングス		0.22	100,000	99,897	2024/9/13
第10回アサヒグループホールディングス		0.17	100,000	100,098	2022/6/13
第11回アサヒグループホールディングス		0.23	100,000	100,112	2024/6/13

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第24回味の素	0.19	100,000	100,028	2024/3/8
第6回J. フロント リテイリング	0.435	200,000	200,768	2027/8/4
第4回トヨタ紡織	0.21	300,000	299,577	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	200,000	200,038	2023/3/8
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	303,387	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,060	2024/7/19
第21回三菱ケミカルホールディングス	0.12	100,000	99,966	2021/6/9
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	99,840	2028/3/23
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,259	2022/12/2
第4回富士フイルムホールディングス	0.005	500,000	499,125	2020/3/3
第9回資生堂	0.001	100,000	99,823	2019/12/17
第23回ジェイ エフ イー ホールディングス	0.09	300,000	299,208	2022/5/23
第1回リクルートホールディングス	0.09	300,000	299,703	2022/3/9
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	103,259	2021/9/17
第5回日本電産	0.001	300,000	299,580	2019/11/25
第15回パナソニック	0.19	300,000	300,540	2021/9/17
第12回デンソー	0.01	100,000	99,664	2021/9/17
第18回デンソー	0.315	200,000	199,806	2028/3/17
第29回三菱重工業	0.662	300,000	307,290	2024/9/3
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	100,172	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,360	2019/8/7
第7回J A三井リース	0.2	200,000	199,648	2022/9/15
第9回J A三井リース	0.22	100,000	100,089	2023/1/26
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,256	2019/8/5
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,105	2021/8/2
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.25	200,000	200,258	2022/10/31
第13回アイシン精機	0.827	100,000	103,562	2023/9/20
第20回ニコン	0.652	100,000	101,696	2022/3/14
第78回三菱商事	1.155	100,000	103,695	2022/3/9
第67回クレディセゾン	0.06	200,000	199,934	2021/4/30
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	104,804	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.2	100,000	114,344	2026/10/30
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.56	100,000	103,732	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.46	100,000	121,636	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行	2.22	200,000	218,660	2022/10/27
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.78	100,000	118,194	2026/4/27
第8回三井住友信託銀行 (社債間限定同順位特約付)	0.234	500,000	501,140	2019/7/22
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.341	100,000	114,966	2026/6/15
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	102,989	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	103,729	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	227,756	2026/6/1
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	115,541	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	117,799	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	113,689	2026/9/11
第11回芙蓉総合リース	0.21	100,000	99,820	2021/5/7

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第13回芙蓉総合リース	0.2	200,000	200,104	2022/2/3
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	99,777	2022/10/18
第22回東京センチュリーリース	0.06	100,000	99,968	2021/4/13
第23回東京センチュリーリース	0.2	100,000	99,971	2023/4/13
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	201,398	2021/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	298,800	2021/3/19
第77回トヨタファイナンス	0.145	200,000	199,814	2024/7/25
第23回リコーリース	0.05	200,000	199,290	2021/9/24
第30回リコーリース	0.16	200,000	200,140	2022/1/21
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	102,837	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,394	2021/6/18
第62回日立キャピタル	0.001	300,000	299,508	2019/9/20
第188回オリックス	0.15	100,000	99,827	2022/2/25
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	100,638	2022/1/21
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,844	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	199,296	2021/7/23
第48回三菱UFJリース	0.15	100,000	99,868	2022/1/26
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	112,681	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	200,000	200,244	2022/8/10
第58回三井不動産	0.1	300,000	299,916	2023/2/24
第105回三菱地所	1.178	100,000	103,819	2022/3/23
第116回三菱地所	0.643	100,000	102,479	2024/9/19
第120回三菱地所	0.24	100,000	99,541	2027/6/18
第125回三菱地所	0.19	300,000	299,256	2025/3/14
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,140	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	101,828	2024/9/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,029	2027/9/17
第38回京王電鉄	0.295	100,000	99,937	2027/11/29
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	108,626	2022/2/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,018	2022/12/20
第39回東日本旅客鉄道	2.05	500,000	566,560	2025/6/20
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	112,081	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	125,040	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	133,445	2022/3/25
第9回東海旅客鉄道	1.74	100,000	107,179	2022/9/20
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	104,835	2022/12/20
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,256	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	121,453	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	118,101	2045/3/6
第8回東京地下鉄	2.31	200,000	239,092	2027/12/20
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	103,940	2021/12/9
第16回三菱倉庫	0.21	200,000	199,720	2024/12/6
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	102,542	2020/9/10
第8回関西高速鉄道	0.861	200,000	206,808	2023/8/30
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,451	2023/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第21回KDDI	0.669	100,000	102,005	2024/9/20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,829	2023/9/20
第38回電源開発	0.978	100,000	104,016	2023/12/20
第39回電源開発	0.929	100,000	103,768	2024/2/20
第40回電源開発	0.889	200,000	207,352	2024/6/20
第4回東京電力パワーグリッド	0.69	100,000	101,057	2024/6/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,426	2027/8/31
第7回東京電力パワーグリッド	0.46	100,000	100,390	2022/10/24
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	200,000	200,428	2028/4/19
第23回東京ガス	1.01	200,000	209,124	2023/6/9
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	101,182	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,054	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	200,000	202,682	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	200,000	209,204	2025/10/15
第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	100,430	2018/12/13
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.55	100,000	100,537	2019/7/10
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	104,982	2020/11/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,224	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,211	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	300,000	300,762	2019/5/2
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	104,310	2021/1/28
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,271	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,456	2020/5/22
小 計		22,683,000	23,349,438	
合 計		496,138,875	535,805,011	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	
		百万円	百万円
		1,809	—

○投資信託財産の構成

(2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	535,805,011	97.8
コール・ローン等、その他	12,055,504	2.2
投資信託財産総額	547,860,515	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	547,859,511,078
コール・ローン等	5,042,435,444
公社債(評価額)	535,805,011,235
未収入金	5,769,189,640
未収利息	1,116,487,095
前払費用	122,047,664
差入委託証拠金	4,340,000
(B) 負債	3,585,675,107
未払解約金	3,585,668,566
未払利息	6,541
(C) 純資産総額(A-B)	544,273,835,971
元本	409,751,145,196
次期繰越損益金	134,522,690,775
(D) 受益権総口数	409,751,145,196口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,283円

<注記事項>

- ①期首元本額 346,837,954,485円
 期中追加設定元本額 281,379,480,290円
 期中一部解約元本額 218,466,289,579円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,283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)

ファンド・マネジャー(国内債券)	92,344,972,614円
eMAXIS 国内債券インデックス	10,228,758,948円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,277,999,627円
eMAXIS バランス(波乗り型)	319,063,837円
コアバランス	2,614,245円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	98,910,299円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	53,477,598円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	29,455,843円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	1,115,900,070円
国内債券セレクション(ラップ向け)	2,360,720,038円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	990,687,117円
つみたて8資産均等バランス	104,175,310円
つみたて4資産均等バランス	22,724,603円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,235,739円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	506,925円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	47,243円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	3,961,943円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	2,758,495円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	1,951,529円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	9,641,759,053円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,327,947,204円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,589,582,590円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	951,376,615円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	8,598,910,038円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	309,198,880円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	341,308,020円

○損益の状況 (2017年5月13日~2018年5月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,312,236,077
受取利息	4,315,372,251
支払利息	△ 3,136,174
(B) 有価証券売買損益	△ 710,478,843
売買益	2,004,455,090
売買損	△ 2,714,933,933
(C) 先物取引等取引損益	11,487,520
取引益	20,756,360
取引損	△ 9,268,840
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,613,244,754
(E) 前期繰越損益金	110,279,766,379
(F) 追加信託差損益金	90,981,888,848
(G) 解約差損益金	△ 70,352,209,206
(H) 計(D+E+F+G)	134,522,690,775
次期繰越損益金(H)	134,522,690,775

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引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 債券バランス (2資産均等型)	67,724,560円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	163,735,048円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	242,487,266円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	171,968,867円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	345,986,862円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	40,212,937円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	9,660,235円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	117,368,629円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	13,439,522,607円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	1,549,611,819円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	5,794,747,777円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	183,095,542,105円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	762,835,368円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型 (適格機関投資家限定)	69,300,121円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	31,260,927円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定)	332,506,421円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	117,071,148円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,292,932,149円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	3,757,737,914円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	13,238,391,136円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,484,249,970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)	1,249,247,920円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	122,247,459円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	23,987,554,035円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	259,317,356円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	1,942,177,943円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	25,125,134円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	41,242,427円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	31,421,175円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	22,394,761円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	176,818,011円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	344,182,091円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	127,434,054円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	288,750,447円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,463,521,944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)	1,892,868,301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)	3,685,325,273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)	2,021,052,400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)	1,224,606,176円
合計	409,751,145,196円

【お知らせ】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2019年1月28日

[計算期間：2018年1月27日～2019年1月28日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月28日に第10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10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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
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	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、円ヘッジ・円ベース)		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
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△ 0.8	378.81	△ 0.8	96.9	—	92,179
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657

(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		F T S E 世界国債インデックス (倫(日、円)ヘッジ(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1月26日	円 12,633	% —	382.76	% —	98.5	—
1月末	12,582	△0.4	381.24	△0.4	97.5	—
2月末	12,535	△0.8	379.88	△0.8	96.4	—
3月末	12,706	0.6	385.14	0.6	98.7	—
4月末	12,585	△0.4	381.47	△0.3	100.4	—
5月末	12,572	△0.5	381.19	△0.4	96.6	—
6月末	12,614	△0.2	382.43	△0.1	100.1	—
7月末	12,556	△0.6	380.68	△0.5	99.5	—
8月末	12,574	△0.5	381.23	△0.4	98.6	—
9月末	12,491	△1.1	378.76	△1.0	101.4	—
10月末	12,458	△1.4	377.76	△1.3	97.3	—
11月末	12,499	△1.1	378.89	△1.0	99.4	—
12月末	12,672	0.3	384.13	0.4	97.0	—
(期 末) 2019年1月28日	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—

(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

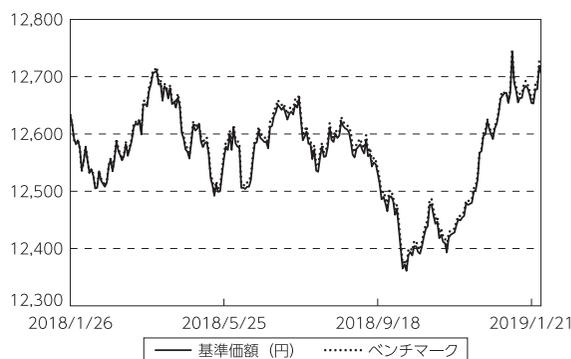
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.6%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(0.6%)と同程度となりました。

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

◎債券市況

- ・イタリアの政局不安を受けて同国の債券市況が下落した一方で、米国の利上げ休止観測などを背景に、多くの国の債券市況が上昇したことから、先進国の債券市況は、期首との比較では上昇しました。

●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、円ヘッジ・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。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

- 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0.6%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ポートフォリオ要因

（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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年1月27日～2019年1月28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)	1	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)	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、12,565円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2018年1月27日～2019年1月28日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 484,528	千アメリカドル 232,974
	カナダ	千カナダドル 21,362	千カナダドル 11,909
	メキシコ	千メキシコペソ 123,954	千メキシコペソ 43,755
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 49,889	31,648
	イタリア	国債証券 69,817	37,240
	フランス	国債証券 73,188	31,971
	オランダ	国債証券 11,157	4,838
	スペイン	国債証券 42,072	18,887
	ベルギー	国債証券 15,064	6,319
国	オーストリア	国債証券 9,818	5,182
	フィンランド	国債証券 3,933	1,054
	アイルランド	国債証券 4,596	1,841
	イギリス	千イギリスポンド 42,527	千イギリスポンド 22,685
	スイス	千スイスフラン 438	千スイスフラン 3,135
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,735	千スウェーデンクローネ 10,358
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 12,700	千ノルウェークローネ 10,731
	デンマーク	千デンマーククローネ 24,673	千デンマーククローネ 12,173
	ポーランド	千ポーランドズロチ 16,558	千ポーランドズロチ 6,731
	オーストラリア	千オーストラリアドル 20,504	千オーストラリアドル 7,822
	シンガポール	千シンガポールドル 4,929	千シンガポールドル 3,777
	南アフリカ	千南アフリカランド 51,991	千南アフリカランド 2,865

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2018年1月27日～2019年1月28日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	2,544,348	608,133	23.9	2,591,275	618,156	23.9
為替直物取引	76,217	13,580	17.8	29,203	4,604	15.8

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

(2019年1月28日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	末		
		評 価 額				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 946,310	千アメリカドル 942,863	千円 103,102,138	% 45.5	% —	% 19.1	% 18.3	% 8.1
カナダ	千カナダドル 50,250	千カナダドル 54,146	4,479,549	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 312,500	千メキシコペソ 304,508	1,753,966	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	100,310	118,740	14,814,076	6.5	—	3.9	1.8	0.8
イタリア	146,470	159,491	19,898,113	8.8	—	5.1	2.9	0.7
フランス	154,440	180,557	22,526,353	9.9	—	6.5	2.6	0.8
オランダ	31,150	36,897	4,603,363	2.0	—	1.3	0.5	0.2
スペイン	88,270	102,946	12,843,593	5.7	—	3.8	1.2	0.7
ベルギー	36,100	43,266	5,397,912	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	22,010	26,194	3,267,963	1.4	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	10,690	11,480	1,432,331	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	12,180	13,545	1,689,935	0.7	—	0.5	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 85,690	千イギリスポンド 104,690	15,112,016	6.7	—	5.1	1.0	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 62,050	千スウェーデンクローネ 69,381	838,816	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 38,900	千ノルウェークローネ 40,234	516,606	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 57,250	千デンマーククローネ 72,660	1,214,162	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 45,450	千ポーランドズロチ 47,466	1,380,334	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 55,200	千オーストラリアドル 59,918	4,707,199	2.1	—	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 13,820	千シンガポールドル 14,303	1,156,406	0.5	—	0.3	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 182,650	千南アフリカランド 165,939	1,334,150	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	222,068,990	98.0	—	53.0	31.7	13.3

(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					
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,775	194,177	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	3,400	3,338	365,022	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,007	328,868	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,461	1,690,687	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,507	274,248	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,697	294,985	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	674	73,716	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,900	1,874	204,989	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	4,500	4,434	484,924	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	5,400	5,249	574,066	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	2,990	327,014	2021/10/31
	1.375 T-NOTE 200115	1.375	16,200	16,012	1,750,918	2020/1/15
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	3,600	3,556	388,877	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200215	1.375	2,700	2,665	291,496	2020/2/15
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,579	172,663	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	9,100	8,972	981,091	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	4,100	4,037	441,469	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,600	1,574	172,130	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,274	139,400	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	15,200	14,891	1,628,358	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	4,200	4,111	449,546	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,561	170,763	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	7,000	6,814	745,177	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,431	265,857	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	3,892	425,673	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	3,700	3,506	383,448	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	6,627	724,725	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	4,500	4,436	485,135	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	4,700	4,632	506,536	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,900	2,852	311,974	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	775	84,780	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	10,000	9,580	1,047,624	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,412	701,164	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	6,450	5,927	648,166	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,586	173,435	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	11,500	11,378	1,244,212	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	5,500	5,424	593,155	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,300	1,280	140,067	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,473	161,116	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,129	888,974	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	10,350	9,993	1,092,779	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,545	825,134	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,707	514,759	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,411	701,106	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	12,600	11,752	1,285,130	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	8,560	936,070	2026/5/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日		
		利率	額面金額	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	1.75	T-NOTE 201031	1.75	3,600	3,546	387,785	2020/10/31
		1.75	T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,673	182,990	2020/12/31
		1.75	T-NOTE 211130	1.75	6,600	6,450	705,358	2021/11/30
		1.75	T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,440	1,360,337	2022/2/28
		1.75	T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,365	149,262	2022/3/31
		1.75	T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,021	330,377	2022/4/30
		1.75	T-NOTE 220515	1.75	9,200	8,960	979,808	2022/5/15
		1.75	T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,699	404,589	2022/5/31
		1.75	T-NOTE 220930	1.75	4,900	4,758	520,368	2022/9/30
		1.75	T-NOTE 230515	1.75	2,400	2,318	253,480	2023/5/15
		1.875	T-NOTE 200630	1.875	3,250	3,216	351,680	2020/6/30
		1.875	T-NOTE 201215	1.875	6,000	5,920	647,360	2020/12/15
		1.875	T-NOTE 211130	1.875	2,700	2,647	289,547	2021/11/30
		1.875	T-NOTE 220131	1.875	2,000	1,959	214,240	2022/1/31
		1.875	T-NOTE 220228	1.875	2,500	2,448	267,693	2022/2/28
		1.875	T-NOTE 220430	1.875	4,000	3,912	427,797	2022/4/30
		1.875	T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,617	395,523	2022/5/31
		1.875	T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,659	400,195	2022/8/31
		1.875	T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,141	671,574	2022/10/31
		2.0	T-NOTE 200930	2.0	7,500	7,424	811,859	2020/9/30
		2.0	T-NOTE 201130	2.0	350	346	37,850	2020/11/30
		2.0	T-NOTE 210115	2.0	5,200	5,139	562,023	2021/1/15
		2.0	T-NOTE 210228	2.0	1,800	1,778	194,431	2021/2/28
		2.0	T-NOTE 210831	2.0	1,000	985	107,722	2021/8/31
		2.0	T-NOTE 211031	2.0	3,800	3,741	409,134	2021/10/31
		2.0	T-NOTE 211231	2.0	10,000	9,842	1,076,243	2021/12/31
		2.0	T-NOTE 220215	2.0	2,900	2,851	311,813	2022/2/15
		2.0	T-NOTE 221130	2.0	8,200	8,026	877,685	2022/11/30
		2.0	T-NOTE 230215	2.0	13,900	13,588	1,485,884	2023/2/15
		2.0	T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,426	265,301	2024/4/30
		2.0	T-NOTE 240531	2.0	2,700	2,618	286,364	2024/5/31
		2.0	T-NOTE 250215	2.0	15,000	14,463	1,581,559	2025/2/15
		2.0	T-NOTE 250815	2.0	12,300	11,814	1,291,940	2025/8/15
		2.0	T-NOTE 261115	2.0	7,300	6,941	759,090	2026/11/15
		2.125	T-NOTE 200831	2.125	1,000	992	108,504	2020/8/31
		2.125	T-NOTE 210131	2.125	700	693	75,821	2021/1/31
		2.125	T-NOTE 210815	2.125	6,400	6,325	691,720	2021/8/15
		2.125	T-NOTE 210930	2.125	1,000	988	108,068	2021/9/30
		2.125	T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,653	399,537	2021/12/31
		2.125	T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,257	684,228	2022/6/30
		2.125	T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,536	824,102	2023/11/30
		2.125	T-NOTE 240229	2.125	2,700	2,639	288,625	2024/2/29
		2.125	T-NOTE 240331	2.125	5,600	5,471	598,294	2024/3/31
		2.125	T-NOTE 241130	2.125	3,500	3,404	372,259	2024/11/30
		2.125	T-NOTE 250515	2.125	7,650	7,416	811,039	2025/5/15
		2.25	T-BOND 460815	2.25	2,850	2,417	264,316	2046/8/15
		2.25	T-NOTE 210215	2.25	15,000	14,893	1,628,652	2021/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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	2.25	1,800	1,786	195,399	2021/3/31
		2.25	1,600	1,587	173,634	2021/4/30
		2.25	700	694	75,911	2021/7/31
		2.25	300	295	32,287	2023/12/31
		2.25	4,150	4,082	446,463	2024/1/31
		2.25	12,000	11,754	1,285,340	2024/11/15
		2.25	4,100	4,014	438,983	2024/12/31
		2.25	5,000	4,834	528,681	2027/2/15
		2.25	5,000	4,820	527,101	2027/8/15
		2.375	700	696	76,216	2020/12/31
		2.375	14,000	13,938	1,524,142	2021/3/15
		2.375	11,200	11,060	1,209,411	2024/8/15
		2.375	9,800	9,558	1,045,174	2027/5/15
		2.5	5,050	4,543	496,780	2045/2/15
		2.5	3,500	3,137	343,077	2046/2/15
		2.5	5,250	4,700	514,032	2046/5/15
		2.5	2,600	2,595	283,854	2020/6/30
		2.5	10,950	10,908	1,192,798	2023/8/15
		2.5	9,100	9,050	989,720	2024/5/15
		2.625	3,700	3,699	404,579	2020/7/31
		2.625	1,400	1,399	153,084	2020/8/15
		2.625	7,000	7,000	765,479	2020/8/31
		2.625	5,100	5,100	557,706	2020/11/15
		2.625	15,500	15,507	1,695,785	2021/5/15
		2.625	3,000	3,002	328,370	2021/6/15
		2.625	5,600	5,609	613,364	2023/6/30
		2.625	19,800	19,781	2,163,100	2025/3/31
		2.75	7,250	6,897	754,201	2042/8/15
		2.75	2,000	1,900	207,833	2042/11/15
		2.75	6,100	5,727	626,335	2047/11/15
		2.75	18,000	18,071	1,976,065	2021/8/15
		2.75	2,000	2,013	220,135	2023/4/30
		2.75	6,000	6,041	660,661	2023/5/31
		2.75	4,800	4,834	528,652	2023/11/15
		2.75	3,000	3,021	330,407	2024/2/15
		2.75	4,500	4,526	494,996	2025/6/30
		2.75	5,500	5,504	601,894	2028/2/15
		2.875	7,400	7,179	785,040	2043/5/15
		2.875	2,500	2,418	264,511	2045/8/15
		2.875	6,600	6,373	696,957	2046/11/15
		2.875	3,000	3,013	329,498	2020/10/31
		2.875	11,500	11,584	1,266,809	2021/10/15
		2.875	8,000	8,062	881,668	2021/11/15
		2.875	7,000	7,088	775,077	2023/10/31
		2.875	22,200	22,489	2,459,242	2025/4/30
		2.875	7,400	7,477	817,661	2028/5/15
		2.875	4,400	4,446	486,176	2028/8/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末				償還年月日
			額面金額	評価額		千円	
				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			
	国債証券						
	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,122	560,116	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	10,350	10,258	1,121,781	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	4,500	4,457	487,461	2045/5/15	
	3 T-BOND 451115	3.0	3,050	3,021	330,442	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	5,350	5,294	578,989	2047/2/15	
	3 T-BOND 480215	3.0	6,700	6,610	722,857	2048/2/15	
	3 T-BOND 480815	3.0	7,200	7,104	776,924	2048/8/15	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	4,900	4,984	545,024	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	5,650	5,747	628,494	2042/2/15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	3,649	399,042	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	6,600	6,689	731,520	2044/8/15	
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,300	3,336	364,830	2048/5/15	
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,315	143,837	2021/5/15	
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	2,000	2,063	225,688	2028/11/15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,700	3,913	427,922	2044/5/15	
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,200	3,395	371,297	2048/11/15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,500	2,527	276,375	2020/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,400	2,640	288,745	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,900	5,394	589,940	2044/2/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	3,130	3,162	345,835	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,200	2,244	245,456	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,120	122,531	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	4,600	5,162	564,510	2043/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	99,795	2040/8/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	960	105,037	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 380215	4.375	2,040	2,484	271,644	2038/2/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,350	1,644	179,857	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,501	273,501	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,344	147,039	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,460	1,788	195,535	2036/2/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,600	3,274	358,030	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	4,050	5,196	568,185	2041/2/15	
	5 T-BOND 370515	5.0	1,000	1,305	142,735	2037/5/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	1,900	2,311	252,734	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,580	1,994	218,071	2031/2/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,425	265,276	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	17,050	21,534	2,354,846	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,500	2,888	315,833	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,300	1,733	189,565	2030/5/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,488	162,784	2021/11/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	6,600	7,206	788,045	2020/8/15	
小	計				103,102,138		
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	1,200	1,150	95,176	2022/3/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	3,050	2,997	247,953	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,900	1,856	153,595	2021/3/1	
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	145	12,060	2021/9/1	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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 CAN GOVT 220901	1.0	1,800	1,744	144,361	2022/9/1	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,390	115,048	2027/6/1	
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	5,300	5,279	436,807	2020/3/1	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,197	264,516	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	850	824	68,240	2026/6/1	
		1.75 CAN GOVT 200501	1.75	1,600	1,597	132,190	2020/5/1	
		1.75 CAN GOVT 200801	1.75	2,000	1,996	165,178	2020/8/1	
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	1,000	994	82,268	2023/3/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,503	124,399	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	500	478	39,547	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	2,850	2,906	240,453	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,100	2,163	179,002	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	3,000	3,083	255,121	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,550	1,739	143,888	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	650	761	62,978	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,100	3,197	264,508	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,250	1,276	105,645	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	2,050	2,585	213,912	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,650	2,171	179,649	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,300	1,856	153,557	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	2,350	3,166	261,959	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,250	1,814	150,111	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,265	187,416	2027/6/1	
小計						4,479,549		
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	46,750	50,506	290,916	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	10,089	58,116	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	18,417	106,082	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	39,950	38,511	221,823	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	33,261	191,584	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	29,750	28,153	162,166	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	19,300	18,103	104,277	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	9,975	57,457	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	19,100	17,259	99,414	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	33,300	33,204	191,255	2020/6/11	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	9,500	9,420	54,264	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	10,100	9,335	53,775	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	10,400	10,423	60,038	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	18,200	17,845	102,791	2038/11/18	
小計						1,753,966		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	3,350	3,369	420,352	2026/8/15
			0 OBL 200417	—	1,700	1,712	213,670	2020/4/17
			0 OBL 210409	—	2,800	2,836	353,824	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	3,500	3,552	443,265	2021/10/8
			0 OBL 220408	—	800	813	101,470	2022/4/8
			0 OBL 231013	—	1,500	1,525	190,338	2023/10/13

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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	0.25 BUND 270215	0.25	3,600	3,680	459,139	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	2,000	2,020	252,112	2028/8/15
		0.25 OBL 201016	0.25	3,250	3,297	411,455	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	3,650	3,811	475,564	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,950	3,081	384,415	2026/2/15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,250	3,373	420,823	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	1,600	1,714	213,893	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,700	2,910	363,111	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,100	2,359	294,430	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	2,800	3,002	374,612	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	6,800	7,339	915,736	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	3,700	4,007	499,986	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,900	3,179	396,703	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,750	2,964	369,805	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,156	269,076	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,400	2,580	321,990	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	998	124,608	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	732	91,352	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	250	268	33,495	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	4,300	4,561	569,137	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	3,150	4,455	555,806	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,780	2,557	319,074	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	3,850	4,050	505,286	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	400	414	51,742	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,968	245,552	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	3,400	5,321	663,903	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	3,000	4,787	597,295	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	720	1,227	153,175	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	3,019	376,756	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,050	3,373	420,882	2034/7/4
4.75 BUND 400704	4.75	1,710	3,140	391,828	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	2,050	3,318	414,038	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	1,700	2,550	318,176	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,327	165,630	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	950	1,574	196,471	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	2,450	3,799	474,079	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	1,700	1,682	209,920	2021/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	396	49,429	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,950	1,946	242,847	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	5,000	5,029	627,532	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	289	36,118	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,106	138,104	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,700	2,662	332,131	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,214	151,545	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	4,850	4,907	612,263	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	4,250	4,295	535,967	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,762	219,936	2024/11/15

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	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,580	1,537	191,788	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,100	2,026	252,788	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,650	1,438	179,494	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,100	2,116	264,032	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,700	2,693	336,016	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	5,450	5,260	656,246	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,050	1,023	127,641	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	2,600	2,699	336,740	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,500	1,482	185,000	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,200	1,069	133,479	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,350	2,206	275,241	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,000	3,112	388,284	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,100	1,128	140,768	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,250	2,001	249,759	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	600	608	75,972	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	750	640	79,891	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,900	2,771	345,830	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,050	255,803	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,300	1,294	161,469	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,500	2,671	333,303	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	7,450	7,978	995,438	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,300	2,472	308,484	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,314	288,782	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	3,350	3,547	442,635	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,250	2,501	312,071	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,180	147,242	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,300	2,401	299,570	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	2,934	366,108	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,700	1,931	240,937	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	4,800	5,540	691,289	2026/3/1
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,600	1,763	219,957	2021/9/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,430	3,927	489,964	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	712	88,922	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	2,987	372,668	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,096	511,093	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	7,150	8,406	1,048,810	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	3,575	446,050	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,940	2,400	299,465	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,600	3,204	399,765	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,900	6,044	754,142	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	5,300	6,123	763,978	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,450	3,201	399,366	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,820	5,041	628,981	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,050	4,024	502,083	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	745	92,966	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,950	5,306	661,985	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 0. A. T 200225	-	1,500	1,508	188,209	2020/2/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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	0 O.A.T 200525	—	2,950	2,970	370,656	2020/5/25
		0 O.A.T 210225	—	7,900	7,977	995,260	2021/2/25
		0 O.A.T 210525	—	4,800	4,851	605,256	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	3,400	3,438	429,042	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	—	4,900	4,943	616,786	2023/3/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	4,050	4,106	512,340	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	5,200	5,175	645,707	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	4,100	4,206	524,818	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,300	2,343	292,427	2026/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	1,850	1,886	235,375	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	1,000	1,014	126,573	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	2,000	2,114	263,810	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	3,700	3,884	484,624	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	5,150	5,231	652,693	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	3,850	4,153	518,209	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	4,400	4,776	595,965	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,400	2,644	329,880	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	1,370	1,489	185,873	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,000	999	124,697	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	3,350	3,717	463,811	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	4,600	5,040	628,872	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	14,200	15,954	1,990,493	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	3,900	4,105	512,210	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	4,850	5,785	721,770	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	5,600	6,727	839,325	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,329	415,369	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	4,050	4,461	556,613	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	2,850	3,988	497,601	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,100	2,205	275,097	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	4,500	5,574	695,439	2026/4/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,200	1,314	163,943	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,680	4,010	500,409	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,620	2,666	332,685	2055/4/25
4 O.A.T 600425	4.0	1,700	2,871	358,239	2060/4/25		
4.25 O.A.T 231025	4.25	3,700	4,480	558,933	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	4,300	6,975	870,290	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	3,100	4,840	603,882	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	5,100	7,593	947,418	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	4,100	6,694	835,213	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	4,470	6,235	777,933	2025/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,650	2,265	282,584	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	900	913	113,937	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	2,600	2,622	327,193	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,550	2,600	324,492	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	900	929	116,012	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,600	2,722	339,661	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,650	1,719	214,585	2028/7/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,950	2,131	265,921	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,200	2,463	307,295	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,750	1,915	238,953	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,700	2,142	267,318	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,000	2,960	369,320	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,462	307,283	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,400	1,484	185,213	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,350	1,574	196,480	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,500	2,458	306,775	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,950	3,057	381,411	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,500	2,211	275,866	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	526	65,641	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,950	1,980	247,082	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,500	1,524	190,210	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	2,800	2,866	357,618	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	2,100	2,145	267,662	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,900	1,955	243,980	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	5,200	5,291	660,143	2020/1/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	100	101	12,664	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,450	4,581	571,560	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,450	3,578	446,463	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,300	2,442	304,776	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	4,800	5,176	645,769	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,150	2,260	282,018	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,900	4,267	532,398	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,000	2,151	268,413	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,450	1,538	191,922	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,900	3,270	407,977	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,070	2,303	287,445	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,200	1,440	179,716	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,850	2,174	271,317	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,530	2,666	332,678	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,430	3,274	408,581	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,550	4,239	528,873	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,056	256,529	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,650	3,853	480,793	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,929	365,477	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	2,000	2,180	271,999	2020/10/31
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,050	3,042	379,600	2040/7/30		
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,803	474,483	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,700	2,650	330,704	2044/10/31		
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	3,250	3,939	491,546	2023/1/31		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,600	4,062	506,861	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,550	3,836	478,700	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,750	3,241	404,443	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,200	1,638	204,410	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,100	4,478	558,768	2029/1/31		

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	
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	400	405	50,616	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,704	337,406	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,383	172,643	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,500	1,522	189,945	2028/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,750	1,835	228,939	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,210	151,055	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	255	31,822	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,300	1,292	161,304	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,400	1,527	190,571	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	430	457	57,093	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,663	207,521	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	600	663	82,834	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,900	3,305	412,452	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,010	126,091	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	2,050	2,196	274,094	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,250	1,847	230,442	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,500	1,709	213,325	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,500	2,066	257,838	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	2,100	2,365	295,065	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,103	262,486	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,850	2,836	353,920	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,273	158,853	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,390	3,739	466,483	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,700	3,888	485,101	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	600	605	75,572	2023/7/15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	900	914	114,109	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	950	988	123,281	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,450	1,494	186,441	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,200	1,291	161,106	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	650	688	85,902	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	242	30,215	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,100	1,208	150,775	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,700	1,858	231,909	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	290	348	43,536	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,050	1,277	159,436	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	850	1,222	152,541	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	2,750	3,144	392,367	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,769	220,724	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	750	847	105,780	2022/4/20
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,161	144,908	2062/1/26		
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,370	1,458	181,990	2020/7/15		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,550	2,374	296,283	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,870	233,320	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	950	1,424	177,758	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	505	63,127	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	656	81,847	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	1,300	1,318	164,534	2020/9/15

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			
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	717	89,575	2026/4/15		
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	500	507	63,345	2027/9/15		
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	200	201	25,095	2028/9/15		
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	600	608	75,864	2031/4/15		
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	1,700	1,792	223,593	2025/9/15		
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	600	627	78,245	2034/4/15		
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	591	73,740	2023/4/15		
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	589	73,553	2022/9/15		
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	550	611	76,250	2024/4/15		
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	550	745	93,008	2042/7/4		
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	658	82,195	2028/7/4		
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	600	628	78,438	2020/4/15		
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	217	27,163	2021/4/15		
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	502	62,749	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	1,200	1,239	154,648	2022/3/15		
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	700	709	88,478	2028/5/15		
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,450	1,507	188,025	2026/5/15		
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	600	601	75,072	2033/5/15		
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	650	674	84,176	2037/5/15		
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,077	134,405	2045/2/18		
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,190	1,368	170,695	2030/5/15		
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	1,950	2,281	284,682	2024/3/18		
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	933	116,461	2023/3/20		
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	626	78,127	2020/4/18		
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	750	820	102,382	2020/10/18		
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,300	1,705	212,777	2025/3/13		
		小 計						86,473,643	
		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	3,380	3,339	482,031	2022/7/22			
	1.25 GILT 270722	1.25	1,880	1,885	272,202	2027/7/22			
	1.5 GILT 210122	1.5	4,100	4,155	599,862	2021/1/22			
	1.5 GILT 260722	1.5	5,300	5,447	786,377	2026/7/22			
	1.5 GILT 470722	1.5	2,900	2,713	391,698	2047/7/22			
	1.625 GILT 711022	1.625	2,250	2,222	320,836	2071/10/22			
	1.75 GILT 220907	1.75	3,350	3,453	498,582	2022/9/7			
	1.75 GILT 370907	1.75	1,970	1,979	285,742	2037/9/7			
	1.75 GILT 570722	1.75	2,450	2,484	358,686	2057/7/22			
	2 GILT 200722	2.0	2,850	2,900	418,687	2020/7/22			
	2 GILT 250907	2.0	4,100	4,349	627,877	2025/9/7			
	2.25 GILT 230907	2.25	3,650	3,866	558,110	2023/9/7			
	2.5 GILT 650722	2.5	1,150	1,454	209,989	2065/7/22			
	2.75 GILT 240907	2.75	1,700	1,862	268,794	2024/9/7			
	3.25 GILT 440122	3.25	4,200	5,428	783,616	2044/1/22			
	3.5 GILT 450122	3.5	1,850	2,504	361,472	2045/1/22			
	3.5 GILT 680722	3.5	2,250	3,619	522,537	2068/7/22			
	3.75 GILT 200907	3.75	1,900	1,989	287,128	2020/9/7			
	3.75 GILT 210907	3.75	1,650	1,774	256,206	2021/9/7			

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	3.75 GILT 520722	3.75	870	1,315	189,830	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	1,250	1,371	197,979	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	1,050	1,767	255,201	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	850	1,067	154,071	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,000	2,662	384,336	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,350	3,256	470,008	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,000	1,437	207,484	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	890	1,294	186,850	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,692	244,276	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	800	1,270	183,439	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	4,480	7,585	1,094,985	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	2,150	3,009	434,363	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	3,950	6,048	873,079	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,800	2,456	354,536	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	2,000	3,026	436,935	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,350	2,901	418,896	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,920	2,756	397,962	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	2,000	2,336	337,337	2021/6/7
小	計					15,112,016	
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	5,600	5,771	69,778	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,500	4,575	55,323	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,495	78,532	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,688	153,406	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,700	10,009	121,009	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	11,550	12,997	157,138	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,100	7,324	88,558	2039/3/30
		5 SWD GOVT 201201	5.0	8,650	9,517	115,070	2020/12/1
小	計					838,816	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,400	4,379	56,231	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	4,800	4,868	62,515	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,281	54,970	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,449	95,648	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	3,050	3,119	40,054	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,950	5,337	68,536	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	10,200	10,798	138,649	2021/5/25
小	計					516,606	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	0.25	2,200	2,233	37,315	2020/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,700	6,916	115,574	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,800	147,057	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	15,400	17,331	289,602	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,607	177,258	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,200	26,771	447,354	2039/11/15
小	計					1,214,162	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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			
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	1.5 POLAND 200425	1.5	2,250	2,256	65,615	2020/4/25	
	1.75 POLAND 210725	1.75	5,750	5,786	168,262	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	750	759	22,084	2021/4/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	5,400	5,485	159,513	2022/4/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	800	817	23,770	2023/1/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,472	100,968	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	4,500	4,426	128,718	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,681	107,051	2028/4/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,850	2,985	86,810	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,502	130,946	2023/10/25	
	5.25 POLAND 201025	5.25	2,000	2,133	62,055	2020/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	5,900	6,555	190,621	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,838	82,553	2022/9/23	
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,766	51,361	2029/4/25	
小計					1,380,334		
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	2,600	2,597	204,044	2020/11/21	
	2 AUST GOVT 211221	2.0	2,950	2,973	233,617	2021/12/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	3,800	3,816	299,809	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	800	820	64,473	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,506	196,926	2024/4/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,773	217,870	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	3,750	3,928	308,610	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,350	1,418	111,402	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,000	1,039	81,629	2035/6/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,600	1,691	132,898	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	5,950	6,400	502,794	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,300	2,517	197,766	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,300	1,435	112,810	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,250	1,475	115,907	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,250	3,729	293,017	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,950	3,041	238,975	2020/4/15	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,400	3,023	237,524	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,500	4,192	329,379	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,994	235,254	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	3,900	4,248	333,782	2021/5/15	
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,293	258,703	2022/7/15	
小計					4,707,199		
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	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	150	147	11,891	2021/10/1	
	1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	650	644	52,132	2022/4/1	
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	500	500	40,433	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	549	44,400	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	1,150	1,156	93,498	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	650	625	50,571	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	1,000	1,015	82,111	2025/6/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,400	1,440	116,500	2023/7/1	

銘柄	当期末				償還年月日	
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
国債証券	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	1,000	1,021	82,547	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	650	663	53,665	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	476	38,529	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	844	68,302	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	650	681	55,064	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	1,200	1,245	100,716	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	500	509	41,212	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	900	1,000	80,860	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	1,620	1,780	143,969	2027/3/1
小計					1,156,406	
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	25,900	28,469	228,893	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,405	27,379	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	22,900	16,248	130,639	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,800	5,764	46,347	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	18,000	14,989	120,517	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	3,300	3,329	26,768	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,200	8,169	65,681	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	15,200	13,939	112,074	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,800	7,107	57,145	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	22,250	20,061	161,290	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	11,100	10,050	80,807	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	23,200	20,998	168,826	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	6,100	5,738	46,137	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	8,200	7,666	61,640	2040/1/31
小計					1,334,150	
合計					222,068,990	

(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1月28日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円	%
	222,068,990	97.6
コール・ローン等、その他	5,364,811	2.4
投資信託財産総額	227,433,801	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (224,573,323千円) の投資信託財産総額 (227,433,801千円) に対する比率は98.7%です。

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

1 アメリカドル=109.35円	1 カナダドル=82.73円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=124.76円
1 イギリスポンド=144.35円	1 スウェーデンクローネ=12.09円	1 ノルウェークローネ=12.84円	1 デンマーククローネ=16.71円
1 ポーランドズロチ=29.08円	1 オーストラリアドル=78.56円	1 シンガポールドル=80.85円	1 南アフリカランド=8.04円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年1月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	450,657,524,848
コール・ローン等	1,065,145,975
公社債(評価額)	222,068,990,913
未収入金	225,546,939,692
未収利息	1,849,785,126
前払費用	126,663,142
(B) 負債	224,000,078,045
未払金	223,971,306,600
未払解約金	28,769,706
未払利息	1,025
その他未払費用	714
(C) 純資産総額(A-B)	226,657,446,803
元本	178,385,096,188
次期繰越損益金	48,272,350,615
(D) 受益権総口数	178,385,096,188口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,706円

<注記事項>

- ①期首元本額 145,275,272,507円
期中追加設定元本額 50,821,549,084円
期中一部解約元本額 17,711,725,403円
また、1口当たり純資産額は、期末1.2706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)

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	57,531,695円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	6,037,311,019円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	6,203,831,017円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	2,384,631,393円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,159,798,190円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	4,083,920,481円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	102,174,440円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	116,397,259,422円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	12,094,914,056円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	91,147,652円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	98,140,358円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	8,106,536,191円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2,962,293,262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)	980,877,774円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,776,230,084円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	133,519,388円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	138,397,042円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,576,582,724円
合計	178,385,096,188円

【お知らせ】

- ①使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年2月8日)
- ②本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、FTSE債券インデックスの名称に変更しています。

○損益の状況 (2018年1月27日～2019年1月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,176,271,869
受取利息	5,176,745,517
支払利息	△ 473,648
(B) 有価証券売買損益	△ 3,687,479,187
売買益	28,002,105,049
売買損	△31,689,584,236
(C) 保管費用等	△ 23,487,755
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,465,304,927
(E) 前期繰越損益金	38,248,569,527
(F) 追加信託差損益金	13,095,544,260
(G) 解約差損益金	△ 4,537,068,099
(H) 計(D+E+F+G)	48,272,350,615
次期繰越損益金(H)	48,272,350,615

- (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。