

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。	
	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。	
	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。）	

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10期（決算日：2025年1月27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27日に第10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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9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

お客さま専用
フリーダイヤル

0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.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。

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	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 中 率	期 騰 落 中 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
6期(2021年1月26日)	10,706		0	1.0	10,997	1.6	98.6	0.0	188
7期(2022年1月26日)	10,427		0	△2.6	10,764	△2.1	97.9	0.1	188
8期(2023年1月26日)	9,439		0	△9.5	9,790	△9.0	98.0	0.1	190
9期(2024年1月26日)	9,188		0	△2.7	9,568	△2.3	100.3	0.0	204
10期(2025年1月27日)	8,911		0	△3.0	9,326	△2.5	97.6	0.2	194

(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。

○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 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2024年1月26日	9,188	—	9,568	—	100.3	0.0
1 月 末	9,194	0.1	9,575	0.1	100.9	0.0
2 月 末	9,155	△0.4	9,538	△0.3	100.1	0.0
3 月 末	9,174	△0.2	9,562	△0.1	99.0	0.0
4 月 末	9,032	△1.7	9,416	△1.6	100.2	0.2
5 月 末	8,946	△2.6	9,331	△2.5	98.9	0.2
6 月 末	8,998	△2.1	9,388	△1.9	99.8	0.2
7 月 末	9,027	△1.8	9,424	△1.5	95.8	0.2
8 月 末	9,118	△0.8	9,521	△0.5	96.1	0.2
9 月 末	9,161	△0.3	9,568	△0.0	98.3	0.2
10月 末	9,031	△1.7	9,438	△1.4	101.9	0.2
11月 末	9,026	△1.8	9,439	△1.3	97.0	0.2
12月 末	8,950	△2.6	9,362	△2.2	101.0	0.2
(期 末) 2025年1月27日	8,911	△3.0	9,326	△2.5	97.6	0.2

(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。

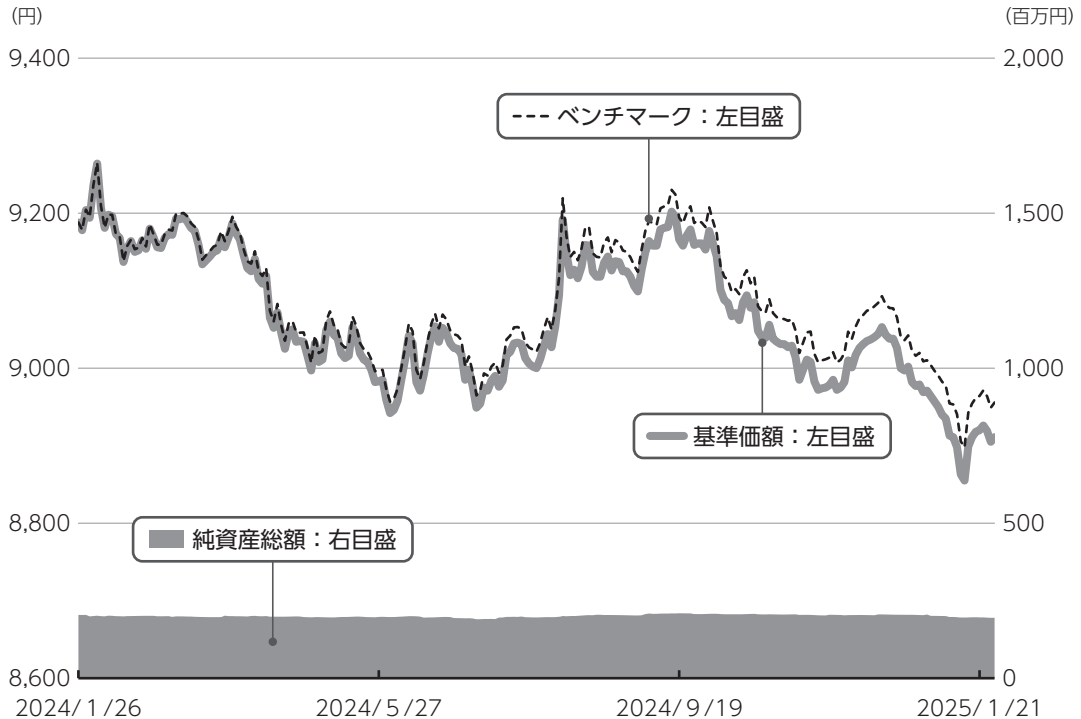
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第10期：2024年1月27日～2025年1月27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10期首	9,188円
第10期末	8,911円
既払分配金	0円
騰落率	－3.0%

※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

基準価額は期間の初めに比べ3.0%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－2.5%）を0.5%下回りました。

> 基準価額の主な変動要因**下落要因**

主に国内債券市況が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	－2.4%	50.0%
日本債券インデックスマザーファンド	－2.8%	49.5%

第10期：2024年1月27日～2025年1月27日

投資環境について

国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

期間の初めにもみ合いで推移した後、日銀のマイナス金利解除などから下落しました。その後、米景気後退懸念などを背景に国内債券市況は反発しましたが、期間の後半には日銀の更なる金融引き締めに対する警戒感や、政策金利の引き上げなどを受けて下落し、期間を通して見ても下落しました。

外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、景気の先行き懸念による利下げ期待や利金が積みあがったことなどから、期間の初め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

▶ 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国内債券、日本を除く先進国債券の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動するよう運用を行いました。

当期間の資産配分は、国内債券およびヘッジ付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%となるように調整を行いました。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

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。

▶ 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、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。

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

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

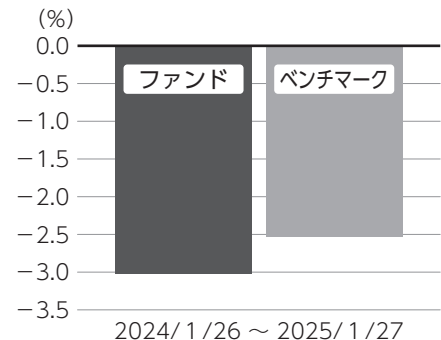
基準価額の騰落率は3.0%の下落となり、ベンチマークの2.5%の下落を0.5%下回りました。

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	△0.1%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第10期 2024年1月27日～2025年1月27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	1,103

（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、期間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

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 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。

2024年1月27日～2025年1月27日

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	40	0.441	(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）	(17)	(0.193)	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）	(18)	(0.193)	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）	(5)	(0.055)	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 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
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(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	41	0.451	

期中の平均基準価額は、9,063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。

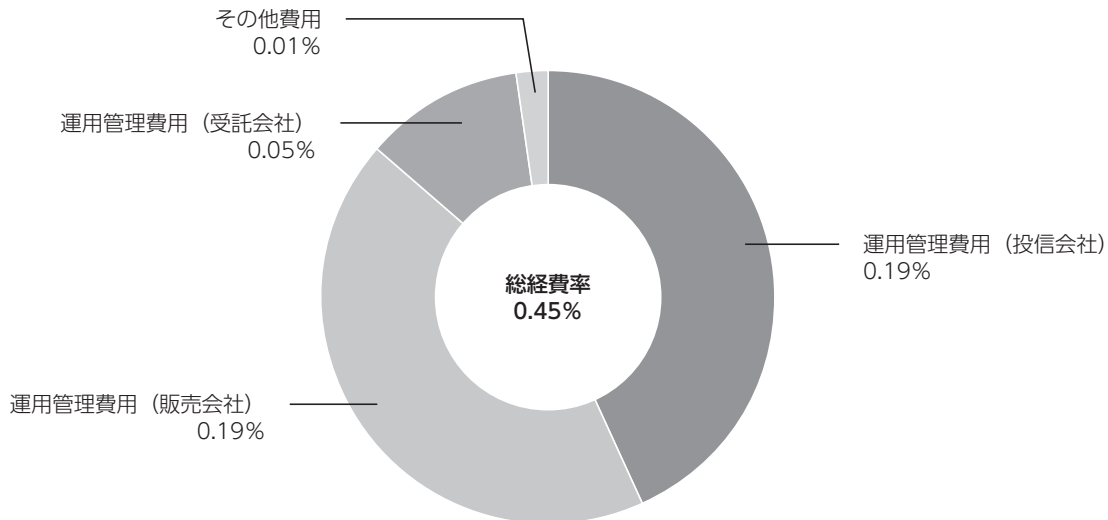
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.45%**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

(2024年1月27日～2025年1月27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	24,558	27,330	26,867	29,789
日本債券インデックスマザーファンド	22,718	28,563	23,822	29,941

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27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。

<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	4,478,077	3,218,881	71.9	4,381,710	3,109,631	71.0
為替直物取引	134,318	101,007	75.2	219,276	184,774	84.3

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。

<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	520,137	112,566	21.6	266,066	75,186	28.3

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みません。

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
	百万円	百万円	百万円
公社債	890	299	2,492

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 18,201

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HCキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2025年1月27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	91,419	89,110	97,415
日本債券インデックスマザーファンド	79,075	77,971	96,560

○投資信託財産の構成

(2025年1月27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	97,415	49.8
日本債券インデックスマザーファンド	96,560	49.3
コール・ローン等、その他	1,733	0.9
投資信託財産総額	195,708	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（271,556,181千円）の投資信託財産総額（279,427,423千円）に対する比率は97.2%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=155.60円	1 カナダドル=108.23円	1 メキシコペソ=7.6222円	1 ユーロ=163.01円
1 イギリスポンド=193.92円	1 スウェーデンクローネ=14.22円	1 ノルウェークローネ=13.84円	1 デンマーククローネ=21.84円
1 ポーランドズロチ=38.6793円	1 オーストラリアドル=97.93円	1 ニュージーランドドル=88.55円	1 シンガポールドル=115.51円
1 マレーシアリンギット=35.4502円	1 中国元=21.471円	1 イスラエルシェケル=43.4097円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2025年1月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	195,708,036
コール・ローン等	1,536,275
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	97,415,469
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	96,560,106
未収入金	196,167
未収利息	19
(B) 負債	766,148
未払解約金	309,562
未払信託報酬	452,561
その他未払費用	4,025
(C) 純資産総額(A－B)	194,941,888
元本	218,774,005
次期繰越損益金	△ 23,832,117
(D) 受益権総口数	218,774,005口
1万口当たり基準価額(C／D)	8,911円

<注記事項>

- ①期首元本額 222,237,551円
期中追加設定元本額 90,781,824円
期中一部解約元本額 94,245,370円
また、1口当たり純資産額は、期末0.8911円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は23,832,117円です。

③分配金の計算過程

項 目	2024年1月27日～ 2025年1月27日
費用控除後の配当等収益額	2,606,828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	17,817,917円
分配準備積立金額	3,720,768円
当ファンドの分配対象収益額	24,145,513円
1万口当たり収益分配対象額	1,103円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*三菱UFJアセットマネジメント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】

東京証券取引所の取引時間の延伸に伴い、申込締切時間の変更を行いました。詳細は、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）から当該ファンドページの日論見書をご覧ください。
(2024年11月5日)

○損益の状況（2024年1月27日～2025年1月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,823
受取利息	1,823
(B) 有価証券売買損益	△ 4,282,049
売買益	842,559
売買損	△ 5,124,608
(C) 信託報酬等	△ 893,834
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 5,174,060
(E) 前期繰越損益金	△12,109,499
(F) 追加信託差損益金	△ 6,548,558
(配当等相当額)	(17,754,319)
(売買損益相当額)	(△24,302,877)
(G) 計(D＋E＋F)	△23,832,117
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	△23,832,117
追加信託差損益金	△ 6,548,558
(配当等相当額)	(17,817,917)
(売買損益相当額)	(△24,366,475)
分配準備積立金	6,327,596
繰越損益金	△23,611,155

- (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。

日本債券インデックスマザーファンド

《第23期》決算日2024年5月13日

[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23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23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 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
19期(2020年5月12日)	13,524	0.2	388.75	0.2	99.6	0.1	630,705
20期(2021年5月12日)	13,462	△0.5	386.93	△0.5	99.5	0.2	314,171
21期(2022年5月12日)	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	0.1	666,754
22期(2023年5月12日)	13,084	△0.8	375.76	△0.9	99.6	0.1	723,477
23期(2024年5月13日)	12,543	△4.1	360.26	△4.1	99.4	0.4	920,650

(注) NOMURA-BPI 総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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) 「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	債 先 物 比
	円	騰 落 率		騰 落 率	率	率
(期 首) 2023年 5 月12日	13,084	% —	375.76	% —	99.6	0.1
5 月末	13,069	△0.1	375.27	△0.1	100.6	0.1
6 月末	13,101	0.1	376.29	0.1	101.0	0.1
7 月末	12,898	△1.4	370.43	△1.4	99.8	0.1
8 月末	12,805	△2.1	367.76	△2.1	99.9	0.1
9 月末	12,714	△2.8	365.13	△2.8	99.7	0.1
10月末	12,512	△4.4	359.31	△4.4	99.2	0.1
11月末	12,776	△2.4	366.88	△2.4	100.3	0.0
12月末	12,829	△1.9	368.38	△2.0	99.7	0.1
2024年 1 月末	12,735	△2.7	365.75	△2.7	101.0	0.1
2 月末	12,775	△2.4	366.90	△2.4	100.5	0.1
3 月末	12,760	△2.5	366.50	△2.5	100.6	0.1
4 月末	12,614	△3.6	362.35	△3.6	99.5	0.4
(期 末) 2024年 5 月13日	12,543	△4.1	360.26	△4.1	99.4	0.4

(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

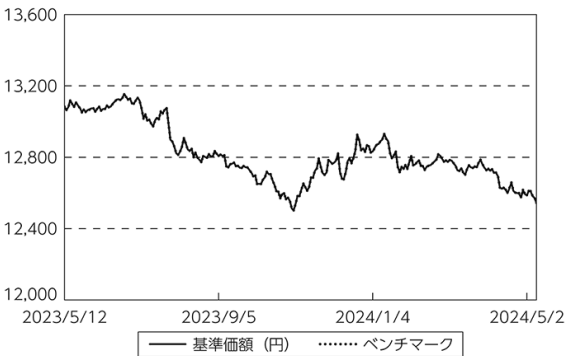
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－4.1%）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。

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・国内債券市況は下落しました。
- ・国内債券市況は、期間の初めはもみ合いで推移し、その後は日銀による度重なる金融政策の柔軟化などから下落しました。期間の後半では欧米中銀の利下げ観測が高まったことなどを背景に国内債券市況は反発する場面もありましたが、期間を通して見ると下落しました。

●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4.1%の下落になったため、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)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 5 月13日～2024年 5 月13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、12,813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

(2023年 5 月13日～2024年 5 月13日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国債証券	384,256,743	177,764,642
	地方債証券	16,956,546	7,211,864 (70,000)
	特殊債券	12,540,611	7,067,950 (783,677)
	社債券	35,789,366	21,005,130 (1,300,000)

(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 6,716	百万円 4,108	百万円 —	百万円 —

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	449,543	94,047	20.9	213,049	39,969	18.8

(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 1,094	百万円 2,699	百万円 2,111

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 18,201

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フィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

○組入資産の明細

(2024年5月13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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	807,394,000 (200,000)	772,173,696 (200,278)	83.9 (0.0)	— (—)	55.3 (—)	19.6 (0.0)	9.0 (—)
地方債証券	48,280,400 (48,280,400)	48,581,318 (48,581,318)	5.3 (5.3)	— (—)	2.1 (2.1)	1.9 (1.9)	1.3 (1.3)
特殊債券 (除く金融債)	34,900,958 (34,900,958)	34,758,179 (34,758,179)	3.8 (3.8)	— (—)	1.9 (1.9)	1.2 (1.2)	0.7 (0.7)
金融債券	2,900,000 (2,900,000)	2,867,778 (2,867,778)	0.3 (0.3)	— (—)	0.0 (0.0)	0.2 (0.2)	0.1 (0.1)
普通社債券	56,900,000 (56,900,000)	56,319,048 (56,319,048)	6.1 (6.1)	0.0 (0.0)	1.3 (1.3)	3.9 (3.9)	0.9 (0.9)
合 計	950,375,358 (143,181,358)	914,700,021 (142,726,602)	99.4 (15.5)	0.0 (0.0)	60.7 (5.4)	26.8 (7.2)	11.9 (2.9)

(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449回利付国債（2年）		0.005	3,720,000	3,714,717	2025/6/1
第450回利付国債（2年）		0.005	1,300,000	1,297,933	2025/7/1
第451回利付国債（2年）		0.005	5,800,000	5,788,690	2025/8/1
第452回利付国債（2年）		0.005	3,100,000	3,092,529	2025/9/1
第453回利付国債（2年）		0.005	4,600,000	4,586,660	2025/10/1
第454回利付国債（2年）		0.1	3,550,000	3,542,971	2025/11/1
第455回利付国債（2年）		0.005	1,550,000	1,544,001	2025/12/1
第456回利付国債（2年）		0.1	5,100,000	5,085,873	2026/1/1
第457回利付国債（2年）		0.1	5,710,000	5,691,385	2026/2/1
第458回利付国債（2年）		0.2	6,400,000	6,388,544	2026/3/1
第144回利付国債（5年）		0.1	6,380,000	6,376,491	2025/6/20
第145回利付国債（5年）		0.1	6,410,000	6,401,731	2025/9/20
第146回利付国債（5年）		0.1	4,450,000	4,438,964	2025/12/20
第147回利付国債（5年）		0.005	5,830,000	5,798,343	2026/3/20
第148回利付国債（5年）		0.005	8,200,000	8,143,502	2026/6/20
第149回利付国債（5年）		0.005	11,570,000	11,479,406	2026/9/20
第150回利付国債（5年）		0.005	1,630,000	1,615,493	2026/12/20
第151回利付国債（5年）		0.005	50,000	49,492	2027/3/20
第152回利付国債（5年）		0.1	5,480,000	5,439,009	2027/3/20
第153回利付国債（5年）		0.005	5,620,000	5,555,370	2027/6/20
第154回利付国債（5年）		0.1	10,230,000	10,130,052	2027/9/20
第155回利付国債（5年）		0.3	2,850,000	2,838,343	2027/12/20
第156回利付国債（5年）		0.2	8,050,000	7,988,498	2027/12/20
第157回利付国債（5年）		0.2	2,020,000	2,002,022	2028/3/20
第158回利付国債（5年）		0.1	8,740,000	8,629,089	2028/3/20
第159回利付国債（5年）		0.1	1,980,000	1,951,686	2028/6/20
第160回利付国債（5年）		0.2	2,850,000	2,820,730	2028/6/20
第161回利付国債（5年）		0.3	3,820,000	3,796,125	2028/6/20
第162回利付国債（5年）		0.3	190,000	188,500	2028/9/20
第163回利付国債（5年）		0.4	13,900,000	13,849,543	2028/9/20
第164回利付国債（5年）		0.2	1,900,000	1,873,077	2028/12/20
第165回利付国債（5年）		0.3	5,600,000	5,545,848	2028/12/20
第166回利付国債（5年）		0.4	2,100,000	2,089,605	2028/12/20
第167回利付国債（5年）		0.4	750,000	745,035	2029/3/20
第1回利付国債（40年）		2.4	2,105,000	2,327,393	2048/3/20
第2回利付国債（40年）		2.2	1,335,000	1,420,586	2049/3/20
第3回利付国債（40年）		2.2	1,668,000	1,770,081	2050/3/20
第4回利付国債（40年）		2.2	1,838,000	1,942,931	2051/3/20
第5回利付国債（40年）		2.0	1,525,000	1,541,531	2052/3/20
第6回利付国債（40年）		1.9	1,230,000	1,209,705	2053/3/20
第7回利付国債（40年）		1.7	1,540,000	1,441,517	2054/3/20
第8回利付国債（40年）		1.4	2,110,000	1,821,541	2055/3/20
第9回利付国債（40年）		0.4	3,630,000	2,262,288	2056/3/20
第10回利付国債（40年）		0.9	3,000,000	2,195,610	2057/3/20

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11回利付国債 (40年)		0.8	3,080,000	2,155,568	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)		0.5	2,570,000	1,584,687	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)		0.5	3,170,000	1,924,094	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)		0.7	3,590,000	2,323,842	2061/3/20
第15回利付国債 (40年)		1.0	4,200,000	2,995,188	2062/3/20
第16回利付国債 (40年)		1.3	4,000,000	3,121,680	2063/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	4,020,000	4,031,014	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	3,470,000	3,479,577	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	3,320,000	3,322,357	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	2,570,000	2,560,542	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	4,870,000	4,846,088	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	4,620,000	4,594,081	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	6,340,000	6,299,107	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	6,130,000	6,084,147	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	5,700,000	5,651,037	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	4,970,000	4,921,443	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	6,090,000	6,021,852	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	6,530,000	6,447,134	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	4,870,000	4,800,359	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	4,110,000	4,042,513	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	4,630,000	4,543,604	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	6,320,000	6,191,514	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	6,040,000	5,908,026	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	8,080,000	7,890,847	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	4,150,000	4,046,291	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	9,440,000	9,186,158	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	9,350,000	9,080,159	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	6,340,000	6,140,353	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)		0.1	9,410,000	9,088,083	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)		0.1	7,240,000	6,971,975	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)		0.1	6,320,000	6,067,516	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)		0.1	9,170,000	8,775,965	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)		0.1	11,820,000	11,275,452	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)		0.2	6,090,000	5,837,325	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)		0.2	8,390,000	8,016,141	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)		0.2	9,730,000	9,265,587	2032/9/20
第369回利付国債 (10年)		0.5	8,320,000	8,106,009	2032/12/20
第370回利付国債 (10年)		0.5	9,000,000	8,744,310	2033/3/20
第371回利付国債 (10年)		0.4	8,410,000	8,076,627	2033/6/20
第372回利付国債 (10年)		0.8	6,820,000	6,769,873	2033/9/20
第373回利付国債 (10年)		0.6	8,880,000	8,629,228	2033/12/20
第374回利付国債 (10年)		0.8	1,550,000	1,531,121	2034/3/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	196,000	219,275	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)		2.4	268,000	295,904	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)		2.3	307,000	338,188	2030/5/20

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 4 回利付国債 (30年)		2. 9	252, 000	288, 550	2030/11/20
第 5 回利付国債 (30年)		2. 2	238, 000	262, 842	2031/ 5 /20
第 6 回利付国債 (30年)		2. 4	339, 000	380, 578	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)		2. 3	339, 000	379, 449	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)		1. 8	302, 000	326, 754	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)		1. 4	206, 000	216, 034	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1. 1	398, 000	407, 022	2033/ 3 /20
第11回利付国債 (30年)		1. 7	237, 000	254, 554	2033/ 6 /20
第12回利付国債 (30年)		2. 1	325, 000	360, 353	2033/ 9 /20
第13回利付国債 (30年)		2. 0	595, 000	654, 583	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2. 4	683, 000	777, 090	2034/ 3 /20
第15回利付国債 (30年)		2. 5	686, 000	787, 630	2034/ 6 /20
第16回利付国債 (30年)		2. 5	547, 000	628, 399	2034/ 9 /20
第17回利付国債 (30年)		2. 4	577, 000	657, 589	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2. 3	687, 000	775, 925	2035/ 3 /20
第19回利付国債 (30年)		2. 3	593, 000	670, 362	2035/ 6 /20
第20回利付国債 (30年)		2. 5	655, 000	754, 789	2035/ 9 /20
第21回利付国債 (30年)		2. 3	529, 000	598, 314	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2. 5	1, 975, 000	2, 277, 984	2036/ 3 /20
第23回利付国債 (30年)		2. 5	194, 000	223, 722	2036/ 6 /20
第24回利付国債 (30年)		2. 5	981, 000	1, 131, 593	2036/ 9 /20
第25回利付国債 (30年)		2. 3	1, 287, 000	1, 455, 519	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2. 4	1, 014, 000	1, 157, 835	2037/ 3 /20
第27回利付国債 (30年)		2. 5	760, 000	876, 226	2037/ 9 /20
第28回利付国債 (30年)		2. 5	2, 926, 000	3, 369, 698	2038/ 3 /20
第29回利付国債 (30年)		2. 4	1, 630, 000	1, 853, 603	2038/ 9 /20
第30回利付国債 (30年)		2. 3	1, 721, 000	1, 931, 598	2039/ 3 /20
第31回利付国債 (30年)		2. 2	2, 223, 000	2, 458, 593	2039/ 9 /20
第32回利付国債 (30年)		2. 3	1, 989, 000	2, 222, 627	2040/ 3 /20
第33回利付国債 (30年)		2. 0	1, 227, 000	1, 315, 331	2040/ 9 /20
第34回利付国債 (30年)		2. 2	2, 231, 000	2, 447, 630	2041/ 3 /20
第35回利付国債 (30年)		2. 0	3, 179, 000	3, 383, 854	2041/ 9 /20
第36回利付国債 (30年)		2. 0	2, 579, 000	2, 735, 519	2042/ 3 /20
第37回利付国債 (30年)		1. 9	2, 717, 000	2, 830, 624	2042/ 9 /20
第38回利付国債 (30年)		1. 8	1, 590, 000	1, 625, 457	2043/ 3 /20
第39回利付国債 (30年)		1. 9	1, 360, 000	1, 410, 401	2043/ 6 /20
第40回利付国債 (30年)		1. 8	1, 720, 000	1, 751, 407	2043/ 9 /20
第41回利付国債 (30年)		1. 7	1, 210, 000	1, 209, 104	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1. 7	1, 820, 000	1, 813, 266	2044/ 3 /20
第43回利付国債 (30年)		1. 7	2, 020, 000	2, 009, 455	2044/ 6 /20
第44回利付国債 (30年)		1. 7	2, 230, 000	2, 214, 925	2044/ 9 /20
第45回利付国債 (30年)		1. 5	1, 940, 000	1, 858, 112	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1. 5	2, 530, 000	2, 418, 578	2045/ 3 /20
第47回利付国債 (30年)		1. 6	2, 890, 000	2, 808, 039	2045/ 6 /20
第48回利付国債 (30年)		1. 4	2, 100, 000	1, 962, 849	2045/ 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49回利付国債 (30年)		1.4	2,360,000	2,201,172	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	2,710,000	2,229,083	2046/ 3 /20
第51回利付国債 (30年)		0.3	2,560,000	1,865,804	2046/ 6 /20
第52回利付国債 (30年)		0.5	2,490,000	1,896,906	2046/ 9 /20
第53回利付国債 (30年)		0.6	2,490,000	1,933,808	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	2,040,000	1,653,481	2047/ 3 /20
第55回利付国債 (30年)		0.8	2,240,000	1,809,539	2047/ 6 /20
第56回利付国債 (30年)		0.8	2,310,000	1,859,850	2047/ 9 /20
第57回利付国債 (30年)		0.8	2,340,000	1,876,212	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	2,140,000	1,708,768	2048/ 3 /20
第59回利付国債 (30年)		0.7	2,410,000	1,871,581	2048/ 6 /20
第60回利付国債 (30年)		0.9	2,200,000	1,787,566	2048/ 9 /20
第61回利付国債 (30年)		0.7	1,940,000	1,494,556	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	1,850,000	1,346,874	2049/ 3 /20
第63回利付国債 (30年)		0.4	2,620,000	1,846,890	2049/ 6 /20
第64回利付国債 (30年)		0.4	2,330,000	1,634,098	2049/ 9 /20
第65回利付国債 (30年)		0.4	1,510,000	1,054,478	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	1,900,000	1,320,120	2050/ 3 /20
第67回利付国債 (30年)		0.6	2,740,000	2,004,803	2050/ 6 /20
第68回利付国債 (30年)		0.6	2,540,000	1,851,228	2050/ 9 /20
第69回利付国債 (30年)		0.7	2,370,000	1,768,968	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	2,340,000	1,740,187	2051/ 3 /20
第71回利付国債 (30年)		0.7	2,610,000	1,933,801	2051/ 6 /20
第72回利付国債 (30年)		0.7	2,410,000	1,778,989	2051/ 9 /20
第73回利付国債 (30年)		0.7	2,130,000	1,566,487	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)		1.0	3,040,000	2,422,576	2052/ 3 /20
第75回利付国債 (30年)		1.3	2,370,000	2,034,929	2052/ 6 /20
第76回利付国債 (30年)		1.4	2,420,000	2,124,590	2052/ 9 /20
第77回利付国債 (30年)		1.6	2,690,000	2,473,966	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)		1.4	3,260,000	2,850,022	2053/ 3 /20
第79回利付国債 (30年)		1.2	2,030,000	1,684,778	2053/ 6 /20
第80回利付国債 (30年)		1.8	2,800,000	2,688,952	2053/ 9 /20
第81回利付国債 (30年)		1.6	2,580,000	2,359,590	2053/12/20
第82回利付国債 (30年)		1.8	1,100,000	1,053,954	2054/ 3 /20
第78回利付国債 (20年)		1.9	310,000	315,964	2025/ 6 /20
第79回利付国債 (20年)		2.0	150,000	153,051	2025/ 6 /20
第80回利付国債 (20年)		2.1	585,000	597,542	2025/ 6 /20
第81回利付国債 (20年)		2.0	250,000	256,090	2025/ 9 /20
第82回利付国債 (20年)		2.1	1,082,000	1,109,818	2025/ 9 /20
第83回利付国債 (20年)		2.1	395,000	406,632	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	880,000	904,508	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	520,000	537,258	2026/ 3 /20
第86回利付国債 (20年)		2.3	1,047,000	1,085,602	2026/ 3 /20
第87回利付国債 (20年)		2.2	420,000	434,712	2026/ 3 /20
第88回利付国債 (20年)		2.3	1,264,000	1,315,963	2026/ 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89回利付国債 (20年)		2.2	340,000	353,266	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	1,270,000	1,325,295	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	548,000	573,142	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	1,282,000	1,340,036	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)		2.0	190,000	198,816	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	875,000	918,067	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)		2.3	1,107,000	1,172,501	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	340,000	358,033	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	573,000	607,425	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	610,000	644,629	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	1,480,000	1,569,066	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	1,030,000	1,099,442	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)		2.4	723,000	777,225	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	520,000	561,059	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	760,000	816,946	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	610,000	650,790	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	920,000	983,967	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	571,000	613,139	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	607,000	650,691	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	1,000,000	1,062,980	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	560,000	596,411	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	876,000	941,244	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)		2.2	861,000	933,108	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	1,050,000	1,132,719	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	922,000	997,613	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)		2.1	1,600,000	1,736,208	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	944,000	1,029,498	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	461,000	504,246	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	1,320,000	1,436,344	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	520,000	564,007	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	400,000	429,136	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)		1.6	780,000	827,369	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)		1.9	1,299,000	1,403,634	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)		1.8	100,000	107,442	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	1,318,000	1,443,091	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	1,240,000	1,349,826	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	1,844,000	2,034,743	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	200,000	217,990	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	440,000	476,687	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	1,974,000	2,140,763	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	280,000	301,753	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	1,862,000	2,008,036	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	420,000	450,000	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	187,000	200,497	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	2,320,000	2,504,208	2031/12/20

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134回利付国債 (20年)		1.8	4,545,000	4,909,645	2032/ 3 /20
第135回利付国債 (20年)		1.7	50,000	53,640	2032/ 3 /20
第136回利付国債 (20年)		1.6	190,000	202,346	2032/ 3 /20
第137回利付国債 (20年)		1.7	4,342,000	4,658,792	2032/ 6 /20
第138回利付国債 (20年)		1.5	160,000	169,163	2032/ 6 /20
第139回利付国債 (20年)		1.6	310,000	330,122	2032/ 6 /20
第140回利付国債 (20年)		1.7	2,817,000	3,023,795	2032/ 9 /20
第141回利付国債 (20年)		1.7	1,120,000	1,202,577	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	3,090,000	3,342,731	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	1,740,000	1,853,500	2033/ 3 /20
第144回利付国債 (20年)		1.5	1,520,000	1,605,940	2033/ 3 /20
第145回利付国債 (20年)		1.7	3,100,000	3,329,617	2033/ 6 /20
第146回利付国債 (20年)		1.7	3,420,000	3,670,275	2033/ 9 /20
第147回利付国債 (20年)		1.6	3,450,000	3,668,316	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	3,360,000	3,539,188	2034/ 3 /20
第149回利付国債 (20年)		1.5	4,180,000	4,397,945	2034/ 6 /20
第150回利付国債 (20年)		1.4	4,800,000	4,996,512	2034/ 9 /20
第151回利付国債 (20年)		1.2	4,480,000	4,565,881	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	3,980,000	4,047,978	2035/ 3 /20
第153回利付国債 (20年)		1.3	3,990,000	4,093,221	2035/ 6 /20
第154回利付国債 (20年)		1.2	4,160,000	4,216,867	2035/ 9 /20
第155回利付国債 (20年)		1.0	4,720,000	4,671,431	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	3,100,000	2,854,542	2036/ 3 /20
第157回利付国債 (20年)		0.2	4,980,000	4,453,763	2036/ 6 /20
第158回利付国債 (20年)		0.5	3,760,000	3,474,954	2036/ 9 /20
第159回利付国債 (20年)		0.6	3,400,000	3,169,718	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	4,430,000	4,164,820	2037/ 3 /20
第161回利付国債 (20年)		0.6	3,720,000	3,438,098	2037/ 6 /20
第162回利付国債 (20年)		0.6	4,580,000	4,212,775	2037/ 9 /20
第163回利付国債 (20年)		0.6	3,550,000	3,251,480	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	3,890,000	3,498,043	2038/ 3 /20
第165回利付国債 (20年)		0.5	3,810,000	3,408,159	2038/ 6 /20
第166回利付国債 (20年)		0.7	4,060,000	3,720,299	2038/ 9 /20
第167回利付国債 (20年)		0.5	3,710,000	3,287,208	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	3,800,000	3,300,376	2039/ 3 /20
第169回利付国債 (20年)		0.3	3,140,000	2,669,471	2039/ 6 /20
第170回利付国債 (20年)		0.3	3,120,000	2,636,306	2039/ 9 /20
第171回利付国債 (20年)		0.3	3,070,000	2,579,721	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	3,790,000	3,221,083	2040/ 3 /20
第173回利付国債 (20年)		0.4	3,550,000	3,000,744	2040/ 6 /20
第174回利付国債 (20年)		0.4	6,120,000	5,144,716	2040/ 9 /20
第175回利付国債 (20年)		0.5	3,620,000	3,079,461	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)		0.5	3,590,000	3,037,678	2041/ 3 /20
第177回利付国債 (20年)		0.4	3,790,000	3,133,041	2041/ 6 /20
第178回利付国債 (20年)		0.5	4,070,000	3,408,665	2041/ 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179回利付国債 (20年)		0.5	3,790,000	3,158,813	2041/12/20
第180回利付国債 (20年)		0.8	3,680,000	3,222,024	2042/ 3 /20
第181回利付国債 (20年)		0.9	4,000,000	3,549,680	2042/ 6 /20
第182回利付国債 (20年)		1.1	3,760,000	3,441,979	2042/ 9 /20
第183回利付国債 (20年)		1.4	3,320,000	3,188,229	2042/12/20
第184回利付国債 (20年)		1.1	4,050,000	3,684,690	2043/ 3 /20
第185回利付国債 (20年)		1.1	4,630,000	4,199,132	2043/ 6 /20
第186回利付国債 (20年)		1.5	3,700,000	3,584,375	2043/ 9 /20
第187回利付国債 (20年)		1.3	3,320,000	3,097,394	2043/12/20
第188回利付国債 (20年)		1.6	730,000	714,918	2044/ 3 /20
第 1 回大韓民国		0.475	100,000	99,995	2026/ 9 /14
第 2 回大韓民国		0.75	100,000	100,283	2028/ 9 /14
小 計			807,394,000	772,173,696	
地方債証券					
第 7 回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	102,535	2025/ 9 /19
第 7 回東京都公募公債 (30年)		2.51	80,000	90,874	2038/ 9 /17
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	110,449	2039/ 9 /20
第12回東京都公募公債 (20年)		2.31	100,000	106,013	2027/ 9 /17
第20回東京都公募公債 (20年)		2.09	80,000	86,053	2029/ 9 /20
第21回東京都公募公債 (20年)		2.19	80,000	86,740	2029/12/20
第28回東京都公募公債 (20年)		1.59	100,000	105,496	2033/ 3 /18
第33回東京都公募公債 (20年)		0.18	100,000	88,139	2036/ 6 /20
第747回東京都公募公債		0.475	500,000	501,310	2025/ 9 /19
第750回東京都公募公債		0.444	200,000	200,314	2025/12/19
第751回東京都公募公債		0.37	500,000	500,195	2025/12/19
第757回東京都公募公債		0.03	150,000	148,734	2026/ 6 /19
第758回東京都公募公債		0.03	150,000	148,734	2026/ 6 /19
第782回東京都公募公債		0.23	100,000	98,734	2028/ 6 /20
第783回東京都公募公債		0.22	400,000	394,776	2028/ 6 /20
第807回東京都公募公債		0.1	200,000	193,144	2030/ 6 /20
第809回東京都公募公債		0.105	100,000	96,326	2030/ 9 /20
平成27年度第 5 回北海道公募公債		0.583	100,000	100,370	2025/ 6 /30
平成30年度第14回北海道公募公債		0.195	100,000	98,134	2028/12/28
令和 3 年度第14回北海道公募公債 (5 年)		0.001	400,000	395,072	2027/ 1 /28
第32回 1 号宮城県公募公債		0.07	200,000	198,468	2026/ 6 /24
第36回 2 号宮城県公募公債		0.135	342,000	329,657	2030/10/28
第 2 回神奈川県公募公債 (30年)		2.87	180,000	212,662	2036/ 6 /20
第 3 回神奈川県公募公債 (20年)		2.11	500,000	510,320	2025/ 6 /20
第 4 回神奈川県公募公債 (30年)		2.62	100,000	115,205	2038/ 3 /19
第19回神奈川県公募公債 (20年)		1.818	100,000	107,335	2032/ 1 /30
第20回神奈川県公募公債 (20年)		1.706	500,000	532,470	2032/ 6 /18
第27回神奈川県公募公債 (20年)		1.398	100,000	102,952	2034/ 9 /20
第226回神奈川県公募公債		0.195	100,000	99,251	2027/ 3 /19
第234回神奈川県公募公債		0.254	100,000	98,830	2028/ 6 /20
第243回神奈川県公募公債		0.075	100,000	96,864	2029/12/20

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256回神奈川県公募公債		0.269	350,000	334,901	2032/3/19
第7回大阪府公募公債（20年）		1.84	220,000	236,277	2031/9/26
第11回大阪府公募公債（20年）		1.693	100,000	106,265	2033/9/27
第179回大阪府公募公債（5年）		0.001	100,000	99,371	2026/1/28
第184回大阪府公募公債（5年）		0.001	120,000	118,900	2026/6/29
第186回大阪府公募公債（5年）		0.001	300,000	297,042	2026/8/28
第191回大阪府公募公債（5年）		0.001	160,000	158,072	2027/1/28
第400回大阪府公募公債		0.531	136,000	136,450	2025/9/29
第407回大阪府公募公債		0.09	200,000	198,738	2026/4/27
第410回大阪府公募公債		0.001	200,000	198,100	2026/7/28
第415回大阪府公募公債		0.142	100,000	99,215	2026/12/25
第417回大阪府公募公債		0.248	300,000	298,278	2027/2/26
第418回大阪府公募公債		0.22	800,000	794,520	2027/3/30
第420回大阪府公募公債		0.17	100,000	99,099	2027/5/28
第426回大阪府公募公債		0.172	100,000	98,855	2027/11/29
第435回大阪府公募公債		0.2	130,000	128,012	2028/8/30
第439回大阪府公募公債		0.193	100,000	98,170	2028/12/27
第455回大阪府公募公債		0.116	148,000	143,259	2030/4/26
第460回大阪府公募公債		0.115	194,000	186,911	2030/9/27
第464回大阪府公募公債		0.072	800,000	765,568	2031/1/28
第465回大阪府公募公債		0.12	500,000	479,640	2031/2/25
第467回大阪府公募公債		0.164	200,000	192,054	2031/4/28
第471回大阪府公募公債		0.083	97,000	92,170	2031/8/29
第483回大阪府公募公債		0.799	200,000	198,016	2033/1/28
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）		1.071	200,000	204,340	2029/4/27
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）		1.455	100,000	103,593	2034/8/10
令和6年度第1回京都府公募公債（5年）		0.482	200,000	198,774	2029/4/16
第1回兵庫県公募公債（15年）		1.66	400,000	410,728	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債（20年）		2.37	300,000	318,633	2027/9/17
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	90,000	99,854	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（12年）		0.73	300,000	301,989	2026/8/6
第5回兵庫県公募公債（12年）		0.687	400,000	402,628	2027/7/7
第5回兵庫県公募公債（15年）		1.31	200,000	206,084	2028/5/26
第6回兵庫県公募公債（15年）		1.35	100,000	103,277	2028/7/14
第9回兵庫県公募公債（15年）		1.02	800,000	815,584	2029/7/13
第9回兵庫県公募公債（20年）		2.25	200,000	217,260	2029/11/19
第27回兵庫県公募公債（20年）		0.387	200,000	181,222	2036/5/12
平成28年度第29回兵庫県公募公債		0.238	100,000	99,403	2027/2/19
令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）		0.661	100,000	97,501	2033/6/20
令和5年度第5回兵庫県公募公債		0.815	100,000	98,538	2033/9/22
令和6年度第1回兵庫県公募公債（5年）		0.541	100,000	99,669	2029/4/23
令和6年度第2回兵庫県公募公債		0.938	200,000	198,416	2034/4/21
第1回静岡県公募公債（15年）		1.514	100,000	102,976	2027/3/19
第6回静岡県公募公債（15年）		1.062	300,000	306,510	2029/6/25
第11回静岡県公募公債（20年）		1.841	550,000	588,885	2030/10/18

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14回静岡県公募公債（20年）		1.736	100,000	106,762	2032/6/18
平成27年度第10回静岡県公募公債		0.461	400,000	400,948	2025/9/19
令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）		0.01	120,000	119,139	2026/3/19
令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）		0.01	120,000	119,139	2026/3/19
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	213,014	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）		2.28	700,000	757,918	2029/6/20
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	500,000	513,485	2026/11/13
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）		1.314	300,000	308,547	2027/12/13
平成27年度第7回愛知県公募公債		0.548	100,000	100,352	2025/7/28
平成27年度第16回愛知県公募公債		0.454	100,000	100,175	2025/12/25
平成29年度第5回愛知県公募公債		0.2	600,000	594,906	2027/6/29
平成30年度第5回愛知県公募公債		0.195	100,000	98,583	2028/6/29
平成30年度第8回愛知県公募公債		0.255	200,000	197,402	2028/8/31
令和3年度第18回愛知県公募公債		0.274	100,000	95,672	2032/3/30
令和5年度第8回愛知県公募公債		0.772	100,000	98,127	2033/9/20
令和6年度第1回愛知県公募公債（5年）		0.477	100,000	99,388	2029/4/12
平成23年度第1回広島県公募公債（20年）		1.83	100,000	107,319	2031/9/22
平成28年度第1回広島県公募公債		0.08	100,000	99,304	2026/5/25
平成28年度第4回広島県公募公債		0.06	100,000	99,046	2026/11/25
平成28年度第1回広島県公募公債（20年）		0.414	100,000	90,311	2036/9/26
平成30年度第4回広島県公募公債		0.259	200,000	197,082	2028/11/22
令和3年度第7回広島県公募公債		0.244	100,000	95,493	2032/3/25
第2回埼玉県公募公債（サステナビリティ）		0.782	100,000	98,320	2033/8/29
第3回埼玉県公募公債		0.875	200,000	198,012	2033/10/18
第4回埼玉県公募公債		0.995	200,000	199,528	2034/5/19
第9回埼玉県公募公債（20年）		2.15	200,000	217,360	2030/5/24
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	107,723	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債（20年）		1.546	200,000	209,246	2034/5/8
第16回埼玉県公募公債（20年）		1.216	100,000	100,405	2035/8/14
平成29年度第1回埼玉県公募公債		0.205	100,000	99,245	2027/4/19
平成29年度第3回埼玉県公募公債		0.175	200,000	198,234	2027/5/24
平成30年度第4回埼玉県公募公債		0.205	100,000	98,627	2028/6/26
令和2年度第1回埼玉県公募公債		0.131	100,000	96,897	2030/4/15
令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）		0.01	110,000	109,159	2026/4/15
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）		2.62	70,000	80,694	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）		2.28	80,000	88,505	2038/9/17
平成21年度第2回福岡県公募公債（20年）		2.23	200,000	217,676	2030/2/22
平成22年度第2回福岡県公募公債（20年）		2.116	800,000	872,256	2031/2/21
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）		1.491	800,000	821,032	2026/11/27
平成27年度第7回福岡県公募公債		0.464	100,000	100,191	2025/12/25
令和2年度第4回福岡県公募公債		0.14	200,000	193,078	2030/9/20
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン）		0.681	100,000	97,754	2033/5/30
令和5年度第3回福岡県公募公債		0.656	100,000	97,502	2033/6/13
第9回千葉県公募公債（20年）		1.84	80,000	85,635	2030/10/11
第13回千葉県公募公債（20年）		1.701	300,000	319,485	2032/10/15

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14回千葉県公募公債（20年）		1.137	100,000	101,642	2033/4/15
平成27年度第3回千葉県公募公債		0.524	200,000	200,632	2025/6/25
平成27年度第6回千葉県公募公債		0.469	500,000	500,995	2025/12/25
平成27年度第9回千葉県公募公債		0.095	200,000	198,868	2026/3/25
平成28年度第3回千葉県公募公債		0.05	400,000	396,644	2026/7/24
平成30年度第6回千葉県公募公債		0.145	100,000	97,896	2029/1/25
令和元年度第6回千葉県公募公債		0.135	100,000	97,112	2030/1/25
令和5年度第7回千葉県公募公債（サステナビリティ）		0.747	100,000	97,912	2033/9/22
令和5年度第8回千葉県公募公債		0.875	100,000	99,004	2033/10/25
令和6年度第1回千葉県公募公債		0.87	300,000	295,641	2034/4/25
平成27年度第2回新潟県公募公債		0.215	100,000	99,679	2026/2/26
令和4年度第1回長野県公募公債		0.299	300,000	287,364	2032/4/23
令和5年度第2回長野県公募公債		0.767	100,000	98,083	2033/9/22
第2回群馬県公募公債（20年）		2.019	100,000	108,620	2031/7/18
第7回群馬県公募公債（20年）		0.313	100,000	89,638	2036/6/13
平成27年度第1回岐阜県公募公債		0.515	300,000	300,930	2025/9/30
令和2年度第2回岐阜県公募公債（5年）		0.02	100,000	99,533	2025/11/25
平成27年度第1回大分県公募公債		0.476	203,400	203,892	2025/10/30
第2回共同発行市場公募地方債（グリーン）		0.893	200,000	197,536	2034/3/24
第148回共同発行市場公募地方債		0.553	500,000	501,780	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債		0.51	200,000	200,614	2025/9/25
第151回共同発行市場公募地方債		0.466	200,000	200,464	2025/10/24
第152回共同発行市場公募地方債		0.496	700,000	701,827	2025/11/25
第153回共同発行市場公募地方債		0.469	200,000	200,398	2025/12/25
第157回共同発行市場公募地方債		0.08	500,000	496,810	2026/4/24
第158回共同発行市場公募地方債		0.08	200,000	198,608	2026/5/25
第159回共同発行市場公募地方債		0.07	500,000	496,165	2026/6/25
第172回共同発行市場公募地方債		0.225	100,000	99,197	2027/7/23
第173回共同発行市場公募地方債		0.215	400,000	396,504	2027/8/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	300,000	296,058	2028/8/25
第193回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	97,478	2029/4/25
第198回共同発行市場公募地方債		0.05	100,000	96,906	2029/9/25
第205回共同発行市場公募地方債		0.135	100,000	96,907	2030/4/25
第206回共同発行市場公募地方債		0.131	100,000	96,818	2030/5/24
第207回共同発行市場公募地方債		0.15	100,000	96,859	2030/6/25
第232回共同発行市場公募地方債		0.364	450,000	432,081	2032/7/23
令和元年度第3回堺市公募公債		0.11	100,000	97,055	2029/12/19
平成27年度第1回長崎県公募公債		0.515	300,000	300,930	2025/9/30
平成27年度第1回佐賀県公募公債		0.476	500,000	501,120	2025/11/28
平成29年度第1回佐賀県公募公債		0.19	100,000	98,917	2027/11/30
平成30年度第1回福島県公募公債		0.264	100,000	98,557	2028/11/30
第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ）		0.795	100,000	98,321	2033/9/29
令和元年度第2回栃木県公募公債		0.09	100,000	96,980	2029/11/29
令和2年度第2回栃木県公募公債		0.135	100,000	96,285	2030/11/27
令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）		0.005	200,000	198,112	2026/7/30

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	
令和５年度第２回奈良県公募公債		0.752	200,000	196,610	2033/６/20
令和６年度第１回奈良県公募公債（５年）		0.575	100,000	99,904	2029/３/19
第５回大阪市公募公債（20年）		2.47	100,000	108,152	2028/9/21
第15回大阪市公募公債（20年）		2.12	100,000	108,995	2031/1/24
令和２年度第３回大阪市公募公債（５年）		0.02	500,000	498,270	2025/9/11
令和６年度第１回大阪市公募公債（５年）		0.58	300,000	299,640	2029/５/22
令和６年度第２回大阪市公募公債		0.995	200,000	199,436	2034/５/22
第１回名古屋市公募公債（30年）		2.53	100,000	114,100	2035/３/20
第９回名古屋市公募公債（20年）		2.07	100,000	106,642	2028/12/20
第９回名古屋市公募公債（30年）		2.095	90,000	94,944	2042/9/19
第28回名古屋市公募公債（５年）		0.01	500,000	497,325	2025/12/19
第33回名古屋市公募公債（５年）		0.58	300,000	299,712	2029/５/18
第491回名古屋市公募公債		0.587	400,000	401,544	2025/６/19
第511回名古屋市公募公債		0.075	100,000	96,633	2030/３/27
第１回京都市公募公債（15年）		0.781	100,000	100,324	2030/12/20
第３回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	102,789	2025/12/19
第５回京都市公募公債（20年）		2.36	50,000	52,468	2026/12/18
令和５年度第７回京都市公募公債（５年）		0.482	100,000	99,371	2029/３/21
平成18年度第３回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	114,833	2026/６/19
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）		2.08	200,000	213,372	2028/12/20
平成22年度第４回神戸市公募公債		1.895	100,000	107,363	2030/9/13
平成23年度第４回神戸市公募公債（20年）		1.913	150,000	161,860	2031/9/12
令和６年度第１回神戸市公募公債（５年）		0.477	300,000	298,086	2029/4/20
第５回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	102,130	2025/6/20
第７回横浜市公募公債（20年）		2.06	450,000	462,334	2025/12/19
第19回横浜市公募公債（20年）		2.2	200,000	216,182	2029/8/31
平成27年度第２回横浜市公募公債		0.568	200,000	200,714	2025/6/16
平成27年度第３回横浜市公募公債		0.524	400,000	401,304	2025/8/18
平成27年度第４回横浜市公募公債		0.486	300,000	300,777	2025/10/20
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	100,000	105,611	2033/5/20
第33回横浜市公募公債（20年）		0.323	100,000	89,971	2036/4/28
第35回横浜市公募公債（20年）		0.443	500,000	452,325	2036/10/28
第54回横浜市公募公債（５年）		0.02	300,000	298,599	2025/11/25
第64回横浜市公募公債（５年）		0.477	800,000	795,104	2029/4/12
平成22年度第８回札幌市公募公債（30年）		2.277	80,000	87,591	2040/9/20
平成23年度第３回札幌市公募公債		1.944	100,000	108,104	2031/7/29
平成23年度第９回札幌市公募公債		1.493	600,000	616,926	2027/2/12
令和２年度第７回札幌市公募公債		0.115	200,000	192,186	2030/12/20
令和３年度第２回札幌市公募公債（５年）		0.01	100,000	99,114	2026/6/19
令和３年度第９回札幌市公募公債（５年）		0.046	500,000	494,870	2026/12/18
第７回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	107,349	2029/7/17
第12回川崎市公募公債（20年）		2.04	100,000	108,680	2031/5/30
第62回川崎市公募公債（５年）		0.005	490,000	485,374	2026/7/30
第３回北九州市公募公債（サステナビリティ）		0.747	100,000	97,912	2033/9/22
第17回北九州市公募公債（20年）		1.529	100,000	104,368	2034/6/20

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	
令和３年度第１回北九州市公募公債（５年）		0.005	200,000	197,974	2026/9/28
2020年度第９回福岡市公募公債（５年）		0.01	200,000	198,920	2025/12/25
2023年度第８回福岡市公募公債		0.831	100,000	98,215	2034/3/15
2024年度第１回福岡市公募公債（５年）		0.482	200,000	198,774	2029/4/16
令和３年度第４回千葉市公募公債		0.135	100,000	94,990	2031/12/24
令和５年度第４回千葉市公募公債（サステナビリティ）		0.782	100,000	98,557	2033/6/20
第21回さいたま市公募公債		0.861	170,000	167,788	2033/12/23
令和５年度第２回鹿児島県公募公債（５年）		0.482	100,000	99,372	2029/3/19
令和２年度第２回徳島県公募公債		0.135	100,000	96,285	2030/11/27
平成28年度第１回山梨県公募公債		0.06	200,000	198,144	2026/10/30
平成30年度第１回山梨県公募公債		0.289	100,000	98,733	2028/10/30
令和２年度第１回山梨県公募公債		0.135	700,000	674,716	2030/10/30
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券		2.34	100,000	106,989	2028/12/20
小 計			48,280,400	48,581,318	
特殊債券(除く金融債)					
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	110,575	2040/2/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	108,988	2040/5/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	103,108	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	107,610	2030/9/30
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	100,000	107,286	2031/10/31
第158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	104,874	2042/2/28
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	106,904	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	100,000	102,043	2042/5/30
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	103,199	2034/8/31
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	101,000	101,306	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	100,000	100,396	2025/7/31
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.386	100,000	100,154	2025/10/31
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.379	200,000	200,206	2025/12/26
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	100,000	99,965	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	200,000	199,250	2026/2/27
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.02	300,000	297,864	2026/4/30
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.02	300,000	297,717	2026/5/29
第348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	98,551	2028/5/31
第437回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.251	1,000,000	990,340	2028/4/28
第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.15	300,000	295,560	2028/6/30
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.484	302,000	302,893	2025/6/13
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.425	400,000	400,928	2025/9/12
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.386	100,000	100,164	2025/10/15
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	150,000	150,205	2025/11/18
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.145	100,000	99,640	2026/2/16
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	674,000	669,760	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	101,296	2026/4/17
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.085	1,300,000	1,289,002	2026/12/14
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.145	100,000	99,211	2027/3/15
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.09	325,000	321,031	2027/9/17

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101回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.17	100,000	99,021	2027/10/15
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	131,000	129,619	2027/11/15
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	223,000	219,840	2028/5/19
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	200,000	196,378	2028/12/15
第4回政府保証新聞西国際空港債券	0.484	904,000	906,730	2025/6/13
第19回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	0.001	500,000	496,000	2026/5/29
第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	0.001	600,000	598,548	2025/6/30
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	100,000	97,100	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	2.23	30,000	31,540	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.99	100,000	118,067	2045/9/20
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	140,000	145,147	2026/3/19
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	300,000	313,041	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	34,782	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	200,000	227,538	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.28	200,000	210,270	2027/4/20
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	110,000	123,539	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	300,000	317,586	2027/7/20
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	200,000	212,190	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)	2.83	100,000	115,711	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	300,000	349,719	2034/6/20
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	150,000	161,187	2032/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.773	100,000	106,504	2032/9/17
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	100,000	93,511	2044/12/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.133	300,000	297,324	2035/3/20
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	96,117	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	100,388	2035/9/20
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	53,997	2029/6/28
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	117,315	2034/3/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.851	100,000	106,862	2030/10/28
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.132	100,000	108,807	2031/1/28
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	87,380	2031/4/28
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	85,625	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	155,391	2026/3/24
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.32	1,000,000	1,055,210	2027/6/18
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	105,810	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	300,000	320,007	2028/4/25
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.702	200,000	212,028	2032/9/28
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	53,334	2033/1/28
第29回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.005	500,000	494,750	2026/7/28
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	100,608	2035/6/28
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.491	300,000	300,570	2025/10/28
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.609	100,000	103,854	2028/1/28
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	73,465	2031/7/30
F134回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	300,000	308,847	2028/3/17
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	100,000	102,761	2027/11/5

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	
F 203回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.063	200,000	203,746	2028/2/28
F 234回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.605	100,000	103,868	2035/4/27
第27回首都高速道路	0.06	100,000	99,418	2025/12/19
第10回日本政策金融公庫 (財投機関債)	2.167	80,000	86,645	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫 (財投機関債)	1.911	80,000	85,681	2030/10/29
第48回福祉医療機構債券 (財投機関債)	0.175	400,000	396,660	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券 (財投機関債)	0.225	100,000	98,496	2028/6/20
第4回中部国際空港 (財投機関債)	0.305	200,000	198,570	2027/2/22
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	28,640	28,273	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	29,986	29,652	2033/1/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	34,682	34,169	2033/4/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	49,638	48,691	2034/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	17,886	18,579	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	17,821	18,472	2044/12/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	18,136	18,789	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	17,608	18,234	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	33,562	34,652	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	34,846	35,925	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	18,987	19,540	2045/7/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	36,766	37,517	2045/9/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	21,889	22,607	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	82,976	86,126	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	51,525	53,230	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	14,851	15,314	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	31,856	32,915	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	32,576	33,570	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	33,780	34,739	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	35,550	36,578	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	38,230	39,224	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	40,358	41,397	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	22,605	23,165	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	22,782	23,364	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	48,388	49,637	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	48,782	49,849	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	49,466	50,303	2047/6/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	27,999	28,373	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	27,417	27,665	2047/8/10
第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.15	190,620	192,348	2047/10/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	91,701	92,437	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	28,709	29,145	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	32,258	32,807	2048/7/10
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	27,156	27,532	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	30,793	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	28,392	28,609	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	32,000	32,158	2049/2/10

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83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	34,607	34,665	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	135,172	135,266	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	70,408	70,430	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	107,095	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	37,773	37,568	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	116,622	115,433	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	41,251	40,431	2050/1/10
第93回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.557	200,000	205,452	2026/12/18
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.81	52,255	51,228	2050/4/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	49,730	48,504	2050/5/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	51,125	50,248	2050/7/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	200,000	214,854	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	100,000	102,626	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	54,287	53,057	2050/12/10
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.54	113,826	108,750	2051/3/10
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	117,662	111,756	2051/4/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	249,524	235,730	2051/6/10
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.23	316,575	296,890	2051/7/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.19	515,288	480,959	2051/8/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	133,334	126,139	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	463,512	439,233	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	139,157	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	206,427	194,518	2052/7/10
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	106,721	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	68,313	64,199	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	70,652	66,173	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	69,151	64,935	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	142,058	133,538	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	141,884	133,044	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	70,629	66,044	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	70,105	65,580	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	214,116	200,491	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	72,003	67,181	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	73,001	68,328	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	146,690	137,562	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	145,478	136,788	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.192	100,000	102,449	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	154,452	141,289	2054/8/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.15	234,405	213,165	2054/9/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	238,764	218,008	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.26	161,718	148,091	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	80,234	73,930	2055/1/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.34	161,584	148,835	2055/2/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.37	83,350	76,817	2055/9/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.713	100,000	100,572	2027/6/18

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162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	168,884	155,354	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		0.514	100,000	100,239	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	85,251	78,400	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	256,449	236,369	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	173,996	160,111	2056/6/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	174,098	160,009	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	176,090	161,004	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	87,636	80,111	2056/9/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		1.129	180,000	177,199	2035/11/20
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	89,716	82,312	2056/12/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.32	178,670	163,145	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	179,176	164,736	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	89,509	82,960	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	180,274	166,529	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	90,265	83,839	2057/5/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	90,762	84,201	2057/6/10
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	183,548	170,112	2057/7/10
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.53	183,272	170,180	2057/8/10
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	185,086	171,376	2057/9/10
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	93,233	88,397	2057/11/10
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	186,570	181,138	2058/1/10
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.09	94,067	91,859	2058/3/10
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	94,834	92,113	2058/4/10
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	378,580	370,520	2058/5/10
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.96	95,563	92,807	2058/6/10
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.94	95,875	92,948	2058/7/10
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		0.075	100,000	98,999	2026/10/20
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.93	194,318	188,078	2058/8/10
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	291,615	284,715	2058/9/10
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	195,046	191,299	2058/10/10
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.18	195,288	193,257	2058/11/10
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	391,924	385,539	2058/12/10
第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.05	296,040	290,048	2059/1/10
第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.0	296,358	288,969	2059/2/10
第202回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	99,456	97,990	2059/3/10
第203回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.14	399,120	394,849	2059/4/10
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		0.24	100,000	99,224	2027/3/19
第204回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	300,000	298,287	2059/5/10
第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）		2.04	50,000	50,963	2025/6/20
第7回国際協力機構債券（財投機関債）		1.991	70,000	75,545	2031/6/13
第83回東日本高速道路		0.05	400,000	396,132	2026/6/19
第111回東日本高速道路		0.607	200,000	199,014	2029/4/25
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	199,494	2026/2/12
第56回西日本高速道路		0.06	900,000	896,301	2025/9/19
第61回西日本高速道路		0.04	700,000	693,084	2026/6/19

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72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）		0.905	100,000	101,129	2029/11/27
小 計			34,900,958	34,758,179	
金融債券					
い第843号商工債券		0.12	200,000	199,330	2025/8/27
い第848号商工債券		0.1	100,000	99,296	2026/1/27
い第850号商工債券		0.1	300,000	297,498	2026/3/27
い第852号商工債券		0.09	100,000	98,962	2026/5/27
い第854号商工債券		0.08	500,000	494,175	2026/7/27
い第857号商工債券		0.09	100,000	98,692	2026/10/27
い第871号商工債券		0.35	200,000	197,280	2027/12/27
い第872号商工債券		0.45	400,000	395,740	2028/1/27
い第885号商工債券		0.65	400,000	396,308	2029/2/27
第376回信金中金債		0.05	100,000	99,183	2026/3/27
第32号商工債券（10年）		0.25	200,000	192,648	2029/12/20
第280号商工債券（3年）		0.22	200,000	198,448	2026/5/27
第2回信金中金債（10年）		0.52	100,000	100,218	2025/9/26
小 計			2,900,000	2,867,778	
普通社債券					
第548回東京電力		2.347	100,000	102,178	2028/9/29
第567回東京電力		1.958	100,000	99,961	2030/7/29
第566回中部電力		1.071	300,000	295,476	2034/4/25
第508回関西電力		0.455	200,000	198,494	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	500,000	496,095	2027/7/23
第511回関西電力		0.41	100,000	98,888	2027/9/17
第518回関西電力		0.44	200,000	197,018	2028/6/20
第524回関西電力		0.514	200,000	196,946	2028/10/25
第400回中国電力		0.34	200,000	197,498	2027/9/24
第409回中国電力		0.4	200,000	196,328	2028/9/25
第446回中国電力		0.7	100,000	97,663	2031/3/25
第448回中国電力		0.92	200,000	194,386	2033/5/25
第322回北陸電力		0.38	100,000	99,007	2027/6/25
第492回東北電力		0.405	300,000	297,480	2027/4/23
第494回東北電力		0.425	200,000	198,290	2027/6/25
第527回東北電力		0.32	400,000	380,752	2031/2/25
第552回東北電力		0.864	400,000	399,992	2028/12/25
第449回九州電力		0.43	300,000	297,612	2027/4/23
第451回九州電力		0.45	300,000	297,678	2027/5/25
第468回九州電力		0.435	100,000	98,349	2028/8/25
第471回九州電力		0.455	300,000	294,507	2028/11/24
第484回九州電力		0.375	400,000	387,736	2029/11/22
第503回九州電力		0.36	600,000	594,012	2027/4/23
第524回九州電力		1.161	300,000	295,251	2034/4/25
第12回新関西国際空港		1.067	100,000	101,526	2029/9/20
第27回新関西国際空港		0.05	100,000	99,193	2026/3/19
第32回成田国際空港		0.22	100,000	97,697	2029/1/29

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第1回国際石油開発帝石	0.08	100,000	99,108	2026/3/16
第48回鹿島建設（サステナビリティ）	0.554	100,000	99,399	2028/3/16
第10回明治ホールディングス（サステナビリティ）	0.05	200,000	198,078	2026/4/23
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,193	2026/3/13
第19回アサヒグループホールディングス	0.28	400,000	398,280	2026/3/6
第21回キリンホールディングス（ソーシャル）	0.29	300,000	296,331	2027/6/7
第22回キリンホールディングス（ソーシャル）	0.673	100,000	99,405	2028/10/26
第9回サントリーホールディングス	0.3	500,000	495,295	2027/6/8
第22回味の素	0.305	100,000	99,660	2026/3/2
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,513	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	400,000	392,564	2028/9/8
第16回日本たばこ産業	0.92	300,000	293,262	2033/4/20
第6回ヒューリック	0.494	400,000	392,372	2028/10/20
第13回ヒューリック	0.569	300,000	299,334	2027/4/16
第14回ヒューリック	0.806	300,000	299,268	2029/4/18
第24回森ヒルズリート投資法人（グリーン）	0.49	300,000	297,567	2026/11/27
第9回クラレ	0.34	100,000	98,993	2027/4/30
第56回住友化学	0.38	200,000	196,866	2027/9/13
第59回住友化学	0.355	200,000	195,640	2028/4/17
第3回三菱ケミカルグループ	0.758	500,000	496,635	2028/12/5
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	98,278	2028/3/23
第12回野村総合研究所	0.624	200,000	197,954	2028/12/7
第6回花王	0.13	200,000	199,126	2025/9/19
第1回アステラス製薬	0.26	400,000	398,664	2025/12/5
第10回テルモ	0.519	300,000	299,328	2027/4/23
第17回Zホールディングス	0.79	100,000	98,879	2027/6/11
第22回Zホールディングス	0.76	200,000	197,216	2027/9/15
第7回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	0.14	100,000	98,653	2026/10/22
第8回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	0.4	100,000	99,581	2026/2/17
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	98,142	2028/2/25
第4回新日本製鐵	0.375	200,000	197,950	2027/5/20
第36回ジェイ エフ イー ホールディングス	0.33	400,000	395,224	2027/6/9
第1回住友生命2023基金	0.705	400,000	393,824	2028/8/8
第14回LIXIL	0.475	200,000	197,676	2027/8/27
第1回日本郵政（グリーン）	0.255	100,000	98,538	2027/9/1
第4回日本郵政	0.603	500,000	496,595	2028/10/24
第9回住友重機械工業	0.736	200,000	199,512	2029/4/18
第30回ダイキン工業	0.459	200,000	195,532	2029/7/27
第22回パナソニック	0.29	100,000	98,021	2027/12/24
第24回パナソニックホールディングス	0.709	300,000	297,531	2028/9/14
第25回パナソニックホールディングス	1.051	800,000	799,296	2030/9/13
第40回ソニーグループ	0.627	600,000	595,866	2029/3/7
第15回デンソー	0.245	300,000	296,532	2027/6/18
第18回デンソー	0.315	300,000	295,629	2028/3/17
第40回三菱重工業	0.31	300,000	295,812	2027/9/8

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14回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス		0.574	500,000	498,670	2027/4/19
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）		0.05	800,000	792,680	2026/3/18
第27回トヨタ自動車（サステナビリティ）		0.219	600,000	572,154	2031/3/18
第31回トヨタ自動車（サステナビリティ）		0.735	200,000	193,180	2033/6/1
第6回ヤマハ発動機		0.569	100,000	99,805	2027/4/23
第1回明治安田生命2019基金		0.29	200,000	199,892	2024/8/2
第7回アシックス		0.792	100,000	99,451	2028/12/14
第63回三井物産		2.37	400,000	419,876	2027/4/23
第40回住友商事		2.261	200,000	216,030	2030/5/27
第51回住友商事		1.241	100,000	101,893	2029/4/23
第53回住友商事		0.33	300,000	296,592	2027/7/26
第55回住友商事		0.33	500,000	491,910	2028/4/13
第61回住友商事		0.644	100,000	99,684	2028/3/1
第44回丸井グループ		0.629	100,000	98,613	2029/1/23
第101回クレディセゾン		0.599	500,000	498,585	2027/4/30
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ		0.724	300,000	299,583	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ		0.535	500,000	486,115	2028/5/31
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付		2.91	200,000	216,478	2029/10/16
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付		1.95	200,000	202,884	2025/11/12
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付		2.16	200,000	203,804	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）		2.46	100,000	106,163	2031/1/20
第88回三菱東京UFJ銀行		2.34	100,000	104,718	2027/4/20
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付		0.545	100,000	97,032	2028/6/12
第18回みずほ銀行（劣後特約付）		2.14	100,000	102,282	2026/9/11
第38回芙蓉総合リース（サステナビリティ）		0.808	400,000	399,168	2028/10/27
第40回芙蓉総合リース（サステナビリティ）		0.707	100,000	99,148	2029/2/28
第7回みずほリース		0.33	500,000	491,590	2028/1/20
第9回みずほリース		0.23	300,000	292,263	2028/9/1
第12回みずほリース		0.34	200,000	195,218	2028/12/15
第21回みずほリース		0.599	300,000	296,913	2028/9/6
第22回みずほリース（サステナビリティ）		0.639	300,000	297,789	2028/6/12
第23回みずほリース		0.693	200,000	198,166	2029/2/28
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス		0.18	1,200,000	1,193,040	2025/12/19
第17回エス・ティ・ティ・ファイナンス		0.28	300,000	295,371	2027/12/20
第18回エス・ティ・ティ・ファイナンス		0.38	1,500,000	1,450,380	2030/9/20
第25回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）		0.648	300,000	295,701	2030/6/20
第26回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）		0.838	200,000	194,154	2033/6/20
第28回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）		0.614	300,000	297,951	2028/9/20
第29回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）		0.86	300,000	298,995	2030/9/20
第30回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）		1.213	200,000	200,158	2033/9/20
第53回日産フィナンシャルサービス		0.58	300,000	295,812	2026/9/18
第56回日産フィナンシャルサービス		0.52	500,000	494,500	2026/6/19
第57回日産フィナンシャルサービス		0.834	400,000	392,188	2028/6/20
第58回日産フィナンシャルサービス		0.7	100,000	99,510	2027/3/19
第30回東京センチュリー		0.29	100,000	98,200	2028/1/27

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第34回東京センチュリー	0.22	300,000	292,461	2028/7/21
第102回トヨタファイナンス	0.414	700,000	697,053	2027/4/9
第103回トヨタファイナンス	0.617	300,000	298,035	2029/4/11
第22回ポケットカード	0.3	100,000	99,378	2025/10/29
第23回ポケットカード	0.2	200,000	196,568	2026/12/3
第24回ポケットカード	0.898	300,000	297,621	2028/11/22
第42回リコーリース	0.39	400,000	395,680	2027/6/1
第209回オリックス	0.39	500,000	494,230	2027/9/1
第220回オリックス	0.723	400,000	397,224	2028/11/29
第222回オリックス	0.677	500,000	495,145	2029/3/7
第34回三井住友ファイナンス&リース	0.43	300,000	299,130	2026/2/2
第2回三菱HCキャピタル	0.19	500,000	492,170	2027/3/1
第40回大和証券グループ本社	0.575	500,000	497,560	2026/11/27
第3回野村ホールディングス	0.28	200,000	197,100	2026/9/4
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	101,798	2025/6/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	101,823	2025/9/24
第83回三井不動産（グリーン）	0.81	200,000	192,456	2033/6/6
第142回三菱地所（サステナビリティ）	0.43	200,000	197,684	2028/5/2
第143回三菱地所	0.9	100,000	96,989	2033/5/2
第111回住友不動産（グリーン）	0.52	100,000	99,058	2028/4/28
第76回東京急行電鉄	1.563	200,000	205,544	2027/6/7
第36回京王電鉄	0.325	200,000	197,786	2027/9/17
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	319,356	2028/4/21
第71回東日本旅客鉄道	1.905	400,000	425,184	2030/9/27
第100回東日本旅客鉄道	1.981	200,000	201,118	2044/1/29
第163回東日本旅客鉄道	0.05	600,000	594,402	2026/4/15
第73回西日本旅客鉄道	0.05	400,000	396,228	2026/4/22
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	107,276	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	105,609	2030/10/25
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	294,591	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	196,836	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	200,000	198,458	2026/2/26
第68回名古屋鉄道（サステナビリティ）	0.375	200,000	196,606	2028/7/13
第71回名古屋鉄道	0.35	400,000	396,928	2027/3/12
第14回日本通運	0.28	200,000	197,534	2027/6/16
第1回横浜高速鉄道	0.62	300,000	299,658	2026/2/25
第20回三菱倉庫	0.759	100,000	98,764	2031/3/14
第31回KDDI（サステナビリティ）	0.43	200,000	197,854	2027/10/27
第9回ソフトバンク	0.48	600,000	585,972	2027/12/3
第13回ソフトバンク	0.52	500,000	465,070	2031/6/3
第16回ソフトバンク	0.52	500,000	462,275	2031/10/10
第21回ソフトバンク	0.82	700,000	688,877	2028/7/12
第22回ソフトバンク	1.0	300,000	292,674	2030/7/12
第49回電源開発	0.4	500,000	495,245	2027/5/20
第50回電源開発	0.415	200,000	198,084	2027/7/20

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57回電源開発		0.355	100,000	98,115	2028/7/20
第59回電源開発		0.414	300,000	294,615	2028/9/20
第64回電源開発		0.405	600,000	586,020	2029/4/20
第67回電源開発		0.24	200,000	192,870	2029/9/20
第86回電源開発		0.93	100,000	97,217	2033/5/20
第87回電源開発（グリーン）		1.106	200,000	196,052	2034/2/20
第89回電源開発（グリーン）		1.121	200,000	196,516	2034/4/20
第6回東京電力パワーグリッド		0.85	100,000	99,879	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド		0.77	300,000	297,444	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド		0.89	100,000	97,867	2030/7/24
第25回東京電力パワーグリッド		1.02	100,000	99,659	2029/4/24
第28回東京電力パワーグリッド		1.01	400,000	397,404	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド		0.98	300,000	297,192	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド		0.68	700,000	697,200	2027/1/27
第35回東京電力パワーグリッド		1.2	100,000	99,887	2030/4/23
第39回東京電力パワーグリッド		1.08	400,000	396,080	2030/7/16
第47回東京電力パワーグリッド		0.68	200,000	190,242	2031/8/29
第49回東京電力パワーグリッド		0.6	400,000	397,044	2027/4/26
第16回 J E R A		0.64	200,000	198,280	2028/4/25
第17回 J E R A		0.9	400,000	396,076	2030/4/25
第21回 J E R A		0.689	200,000	197,888	2028/11/24
第22回 J E R A		0.5	1,000,000	993,540	2027/2/25
第23回 J E R A		1.192	100,000	97,962	2034/2/24
第25回 J E R A		1.054	400,000	398,252	2031/4/25
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）		0.85	400,000	398,732	2027/9/14
第51回大阪ガス		0.785	100,000	96,841	2033/6/2
第13回広島ガス		0.405	200,000	195,776	2028/9/13
第7回ファーストリテイリング		0.405	100,000	98,656	2028/6/6
第19回フランス相互信用連合銀行		0.999	100,000	100,461	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行		0.25	200,000	199,836	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行		0.279	500,000	493,790	2026/10/21
第38回フランス相互信用連合銀行		0.802	300,000	300,549	2025/10/10
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.302	100,000	98,313	2026/12/16
第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.713	200,000	199,126	2026/7/13
第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.914	200,000	197,818	2028/7/13
第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.895	400,000	399,368	2026/12/14
第1回サントアンデル銀行（2019）		0.463	500,000	498,965	2024/12/5
小	計		56,900,000	56,319,048	
合	計		950,375,358	914,700,021	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	未
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 3,311	百万円 —

○投資信託財産の構成 (2024年5月13日現在)

項 目	当 期	未
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	914,700,021	98.4
コール・ローン等、その他	15,187,539	1.6
投資信託財産総額	929,887,560	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	929,887,560,233
コール・ローン等	13,449,202,663
公社債(評価額)	914,700,021,042
未収利息	1,536,128,641
前払費用	140,463,382
差入委託証拠金	61,744,505
(B) 負債	9,237,435,827
未払金	1,894,274,505
未払解約金	7,343,161,322
(C) 純資産総額(A－B)	920,650,124,406
元本	734,007,365,151
次期繰越損益金	186,642,759,255
(D) 受益権総口数	734,007,365,151口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,543円

<注記事項>

- ①期首元本額 552,953,193,068円
 期中追加設定元本額 254,696,851,852円
 期中一部解約元本額 73,642,679,769円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2543円です。

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

MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	175,958,816,366円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	111,916,725,165円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	59,213,449,032円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	42,318,815,867円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	37,533,941,113円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	24,721,245,237円
MUAM グローバルバランス(退職給付信託向け)(適格機関投資家限定)	24,503,259,248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)	23,446,887,158円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	18,930,825,944円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	18,405,294,174円
つみたて8資産均等バランス	12,368,186,970円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	12,165,840,984円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	11,567,969,451円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,994,011,242円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,900,455,072円
三菱UFJ D/C年金バランス(株式40)	7,530,798,013円
三菱UFJ D/C年金バランス(株式15)	7,397,848,968円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	6,668,384,159円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,622,297,618円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,255,315,656円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	5,700,588,088円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	5,626,856,065円
日本債券インデックスファンドS	5,544,171,553円
国内債券セレクション(ラップ向け)	5,237,609,746円

○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,756,517,764
受取利息	5,757,618,467
支払利息	△ 1,100,703
(B) 有価証券売買損益	△ 40,438,972,489
売買益	156,011,016
売買損	△ 40,594,983,505
(C) 先物取引等取引損益	△ 41,129,190
取引益	8,009,430
取引損	△ 49,138,620
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 34,723,583,915
(E) 前期繰越損益金	170,524,354,914
(F) 追加信託差損益金	71,360,783,663
(G) 解約差損益金	△ 20,518,795,407
(H) 計(D+E+F+G)	186,642,759,255
次期繰越損益金(H)	186,642,759,255

- (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。

三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,941,517,546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)	4,885,797,575円
つみたて4資産均等バランス	4,802,081,776円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	4,651,718,360円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,588,038,506円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,406,076,955円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,282,223,340円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	3,294,331,907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)	3,096,184,079円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	3,062,415,892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)	3,011,040,143円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,842,938,302円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	2,634,143,780円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,499,242,039円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,485,992,478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)	2,303,871,049円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,272,430,672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)	2,188,104,377円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,099,476,552円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	2,005,690,169円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,737,524,912円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	1,606,571,779円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	1,573,070,841円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,452,531,530円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	1,238,179,419円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,236,716,237円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	930,801,383円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	616,797,431円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	611,362,804円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	477,769,455円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476,937,873円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	476,919,903円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	469,836,335円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	450,459,048円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429,832,474円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424,729,389円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424,280,144円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421,626,267円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420,955,442円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419,477,595円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413,671,752円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	216,560,403円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	196,485,913円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	140,181,077円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	91,833,237円
eMAXIS バランス (波乗り型)	89,944,163円

eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	77,885,369円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	58,975,151円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	56,719,654円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	47,853,897円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	30,896,965円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	28,612,137円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,848,932円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	19,963,028円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	19,139,611円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	18,511,753円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	14,899,556円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	11,241,175円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9,888,453円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,458,513円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	6,066,272円
国内債券インデックスオープンV (適格機関投資家限定)	5,319,921円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	3,537,687円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,440,927円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,156,260円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,607,512円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	459,872円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	308,807円
合計	734,007,365,151円

【お 知 ら せ】

委託会社の商号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。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10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16期》決算日2025年1月27日

[計算期間：2024年1月27日～2025年1月27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27日に第16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16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、F T S E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		F T S E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
12期(2021年1月26日)	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	250,742
13期(2022年1月26日)	13,500	△ 4.0	410.80	△ 3.9	97.2	—	280,521
14期(2023年1月26日)	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—	230,844
15期(2024年1月26日)	11,199	△ 4.1	341.23	△ 4.1	101.9	—	321,276
16期(2025年1月27日)	10,932	△ 2.4	333.51	△ 2.3	96.8	—	273,873

(注) F T S E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	騰 落 率	F T S E 世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			(係く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2024年 1 月26日	円 11,199	% —	341.23	% —	% 101.9	% —
1 月末	11,226	0.2	342.04	0.2	101.8	—
2 月末	11,104	△0.8	338.30	△0.9	100.8	—
3 月末	11,170	△0.3	340.37	△0.3	98.4	—
4 月末	10,959	△2.1	333.82	△2.2	101.9	—
5 月末	10,932	△2.4	333.17	△2.4	99.1	—
6 月末	11,036	△1.5	336.31	△1.4	100.7	—
7 月末	11,128	△0.6	339.24	△0.6	93.9	—
8 月末	11,230	0.3	342.25	0.3	94.8	—
9 月末	11,313	1.0	344.61	1.0	97.8	—
10月末	11,058	△1.3	337.03	△1.2	104.6	—
11月末	11,130	△0.6	339.46	△0.5	95.4	—
12月末	10,963	△2.1	334.30	△2.0	102.6	—
(期 末) 2025年 1 月27日	10,932	△2.4	333.51	△2.3	96.8	—

(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

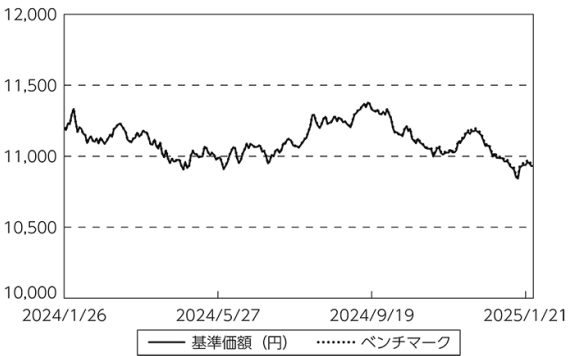
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ2.4%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－2.3%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

●投資環境について

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は上昇しました。
- ・先進国の債券市況は、景気の先行き懸念による利下げ期待や利金が積みあがったことなどから、期間の初め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F T S E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。
- ・期間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2.3%の下落になったため、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)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

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

○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

(2024 年 1 月 27 日～2025 年 1 月 27 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 1	% 0.012	(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)	(0.012)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	1	0.012	
期中の平均基準価額は、11,104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

(2024年1月27日～2025年1月27日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 				

(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

(2024年 1 月27日～2025年 1 月27日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	4,478,077	3,218,881	71.9	4,381,710	3,109,631	71.0
為替直物取引	134,318	101,007	75.2	219,276	184,774	84.3

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

(2025年1月27日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 895,460	千アメリカドル 803,396	千円 125,008,556	% 45.6	% —	% 19.3	% 17.8	% 8.5
カナダ	千カナダドル 49,710	千カナダドル 47,554	5,146,853	1.9	—	1.0	0.5	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 295,130	千メキシコペソ 265,236	2,021,681	0.7	—	0.4	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	96,790	92,186	15,027,280	5.5	—	3.0	1.9	0.6
イタリア	114,840	111,873	18,236,547	6.7	—	3.8	1.9	1.0
フランス	127,930	114,599	18,680,813	6.8	—	3.9	2.3	0.5
オランダ	21,950	20,619	3,361,145	1.2	—	0.7	0.4	0.1
スペイン	72,320	70,187	11,441,215	4.2	—	2.4	1.4	0.3
ベルギー	26,960	24,826	4,047,020	1.5	—	1.0	0.4	0.1
オーストリア	19,640	17,874	2,913,735	1.1	—	0.7	0.3	0.1
フィンランド	9,410	8,402	1,369,764	0.5	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	8,810	7,886	1,285,532	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポルトガル	9,870	9,486	1,546,465	0.6	—	0.3	0.2	0.0
イギリス	千イギリスポンド 83,660	千イギリスポンド 71,979	13,958,354	5.1	—	3.6	1.3	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 31,590	千スウェーデンクローネ 30,977	440,506	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 31,380	千ノルウェークローネ 28,797	398,558	0.1	—	0.1	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 30,020	千デンマーククローネ 28,641	625,529	0.2	—	0.1	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 42,460	千ポーランドズロチ 39,944	1,545,006	0.6	—	0.1	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 37,030	千オーストラリアドル 33,011	3,232,843	1.2	—	0.8	0.3	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 9,130	千ニュージーランドドル 8,153	721,965	0.3	—	0.2	0.1	—
シンガポール	千シンガポールドル 9,400	千シンガポールドル 9,136	1,055,393	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 38,240	千マレーシアリンギット 39,349	1,394,944	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 1,339,000	千中国元 1,428,858	30,679,015	11.2	—	5.0	4.2	2.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 24,670	千イスラエルシェケル 22,290	967,622	0.4	—	0.2	0.2	0.0
合 計	—	—	265,106,355	96.8	—	48.0	34.4	14.4

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	0.375 T-NOTE 270731	0.375	4,000	3,629	564,791	2027/ 7 /31
		0.375 T-NOTE 270930	0.375	4,200	3,787	589,278	2027/ 9 /30
		0.5 T-NOTE 260228	0.5	1,700	1,632	254,058	2026/ 2 /28
		0.5 T-NOTE 270430	0.5	3,800	3,493	543,596	2027/ 4 /30
		0.5 T-NOTE 270531	0.5	3,200	2,932	456,267	2027/ 5 /31
		0.5 T-NOTE 270630	0.5	3,500	3,197	497,575	2027/ 6 /30
		0.5 T-NOTE 270831	0.5	3,850	3,495	543,822	2027/ 8 /31
		0.5 T-NOTE 271031	0.5	3,500	3,156	491,107	2027/10/31
		0.625 T-NOTE 260731	0.625	4,680	4,434	689,977	2026/ 7 /31
		0.625 T-NOTE 270331	0.625	2,700	2,497	388,660	2027/ 3 /31
		0.625 T-NOTE 271130	0.625	5,700	5,142	800,220	2027/11/30
		0.625 T-NOTE 271231	0.625	280	251	39,180	2027/12/31
		0.625 T-NOTE 300815	0.625	6,600	5,365	834,826	2030/ 8 /15
		0.75 T-NOTE 260331	0.75	3,300	3,168	493,081	2026/ 3 /31
		0.75 T-NOTE 260430	0.75	3,300	3,159	491,586	2026/ 4 /30
		0.75 T-NOTE 260531	0.75	6,000	5,728	891,296	2026/ 5 /31
		0.75 T-NOTE 260831	0.75	6,000	5,679	883,656	2026/ 8 /31
		0.75 T-NOTE 280131	0.75	4,200	3,780	588,193	2028/ 1 /31
		0.875 T-NOTE 260930	0.875	5,500	5,201	809,399	2026/ 9 /30
		1 T-NOTE 280731	1.0	5,480	4,885	760,241	2028/ 7 /31
		1.125 T-BOND 400515	1.125	2,520	1,511	235,114	2040/ 5 /15
		1.125 T-BOND 400815	1.125	4,600	2,732	425,122	2040/ 8 /15
		1.125 T-NOTE 261031	1.125	5,100	4,831	751,743	2026/10/31
		1.125 T-NOTE 270228	1.125	1,900	1,782	277,283	2027/ 2 /28
		1.125 T-NOTE 280831	1.125	5,850	5,224	812,940	2028/ 8 /31
		1.125 T-NOTE 310215	1.125	8,100	6,681	1,039,600	2031/ 2 /15
		1.25 T-BOND 500515	1.25	5,100	2,402	373,810	2050/ 5 /15
		1.25 T-NOTE 261130	1.25	5,700	5,398	840,027	2026/11/30
		1.25 T-NOTE 261231	1.25	6,150	5,810	904,140	2026/12/31
		1.25 T-NOTE 280331	1.25	5,590	5,083	791,028	2028/ 3 /31
		1.25 T-NOTE 280430	1.25	6,000	5,440	846,603	2028/ 4 /30
		1.25 T-NOTE 280531	1.25	5,750	5,200	809,214	2028/ 5 /31
		1.25 T-NOTE 280630	1.25	6,300	5,683	884,377	2028/ 6 /30
		1.25 T-NOTE 310815	1.25	1,260	1,028	160,049	2031/ 8 /15
		1.375 T-BOND 401115	1.375	3,700	2,280	354,877	2040/11/15
		1.375 T-BOND 500815	1.375	5,270	2,553	397,273	2050/ 8 /15
		1.375 T-NOTE 260831	1.375	2,200	2,103	327,316	2026/ 8 /31
		1.375 T-NOTE 281031	1.375	5,340	4,788	745,087	2028/10/31
		1.375 T-NOTE 281231	1.375	3,110	2,774	431,696	2028/12/31
		1.375 T-NOTE 311115	1.375	7,470	6,103	949,706	2031/11/15
1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,794	746,089	2026/ 8 /15		
1.5 T-NOTE 270131	1.5	7,200	6,818	1,060,999	2027/ 1 /31		
1.5 T-NOTE 281130	1.5	4,900	4,404	685,362	2028/11/30		
1.625 T-BOND 501115	1.625	5,810	3,012	468,686	2050/11/15		
1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,920	4,788	745,046	2026/ 2 /15		
1.625 T-NOTE 260515	1.625	5,600	5,415	842,666	2026/ 5 /15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,950	1,868	290,702	2026/9/30
		1.625 T-NOTE 261031	1.625	1,600	1,529	237,941	2026/10/31
		1.625 T-NOTE 261130	1.625	7,700	7,343	1,142,636	2026/11/30
		1.625 T-NOTE 310515	1.625	9,780	8,248	1,283,427	2031/5/15
		1.75 T-BOND 410815	1.75	6,640	4,284	666,605	2041/8/15
		1.75 T-NOTE 261231	1.75	1,750	1,670	259,881	2026/12/31
		1.75 T-NOTE 290131	1.75	2,800	2,530	393,694	2029/1/31
		1.875 T-BOND 410215	1.875	4,700	3,138	488,356	2041/2/15
		1.875 T-BOND 510215	1.875	3,300	1,825	284,038	2051/2/15
		1.875 T-BOND 511115	1.875	6,540	3,586	557,983	2051/11/15
		1.875 T-NOTE 260630	1.875	2,700	2,612	406,466	2026/6/30
		1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,700	2,607	405,694	2026/7/31
		1.875 T-NOTE 270228	1.875	5,300	5,047	785,411	2027/2/28
		1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,600	5,075	789,806	2029/2/28
		1.875 T-NOTE 320215	1.875	9,510	7,996	1,244,237	2032/2/15
		2 T-BOND 500215	2.0	3,100	1,790	278,544	2050/2/15
		2 T-BOND 510815	2.0	7,050	4,006	623,478	2051/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	5,000	4,805	747,730	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,400	1,361	211,828	2026/5/31
		2.25 T-BOND 490815	2.25	4,040	2,488	387,254	2049/8/15
		2.25 T-BOND 520215	2.25	6,090	3,668	570,746	2052/2/15
		2.25 T-NOTE 260331	2.25	3,250	3,175	494,183	2026/3/31
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	4,034	627,787	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,800	4,565	710,323	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,200	3,973	618,265	2027/11/15
		2.375 T-BOND 420215	2.375	4,750	3,367	523,981	2042/2/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	4,080	2,579	401,305	2049/11/15
		2.375 T-BOND 510515	2.375	7,050	4,406	685,698	2051/5/15
		2.375 T-NOTE 260430	2.375	2,100	2,052	319,299	2026/4/30
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	5,800	5,559	865,076	2027/5/15
		2.375 T-NOTE 290331	2.375	4,650	4,292	667,974	2029/3/31
		2.375 T-NOTE 290515	2.375	5,140	4,736	736,941	2029/5/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	3,100	2,138	332,771	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	2,570	1,742	271,161	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,000	2,944	458,175	2026/2/28
		2.5 T-NOTE 270331	2.5	4,500	4,337	674,845	2027/3/31
		2.625 T-NOTE 260131	2.625	1,600	1,574	244,960	2026/1/31
		2.625 T-NOTE 270531	2.625	4,900	4,720	734,533	2027/5/31
		2.625 T-NOTE 290215	2.625	6,190	5,786	900,351	2029/2/15
		2.625 T-NOTE 290731	2.625	3,780	3,506	545,548	2029/7/31
2.75 T-BOND 420815	2.75	1,430	1,067	166,150	2042/8/15		
2.75 T-BOND 421115	2.75	2,200	1,635	254,480	2042/11/15		
2.75 T-BOND 470815	2.75	1,540	1,078	167,881	2047/8/15		
2.75 T-BOND 471115	2.75	4,300	3,005	467,650	2047/11/15		
2.75 T-NOTE 270731	2.75	4,510	4,345	676,221	2027/7/31		
2.75 T-NOTE 280215	2.75	1,550	1,480	230,336	2028/2/15		
2.75 T-NOTE 290531	2.75	4,100	3,833	596,442	2029/5/31		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	2.75	9,410	8,336	1,297,157	2032/8/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	4,150	3,126	486,524	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	2,000	1,468	228,464	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	1,720	1,244	193,583	2046/11/15
		2.875 T-BOND 490515	2.875	3,900	2,751	428,189	2049/5/15
		2.875 T-BOND 520515	2.875	4,940	3,431	533,936	2052/5/15
		2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,160	5,860	911,900	2028/8/15
		3 T-BOND 420515	3.0	1,310	1,020	158,832	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,100	1,585	246,748	2044/11/15
		3 T-BOND 451115	3.0	1,040	778	121,070	2045/11/15
		3 T-BOND 470515	3.0	1,550	1,141	177,554	2047/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	3,660	2,674	416,132	2048/2/15
		3 T-BOND 480815	3.0	2,980	2,167	337,188	2048/8/15
		3 T-BOND 490215	3.0	4,750	3,440	535,371	2049/2/15
		3 T-BOND 520815	3.0	5,550	3,956	615,671	2052/8/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	50	40	6,227	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	1,340	1,068	166,208	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,850	1,453	226,183	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	3,040	2,349	365,632	2044/8/15
		3.125 T-BOND 480515	3.125	3,810	2,842	442,311	2048/5/15
		3.25 T-BOND 420515	3.25	4,240	3,431	533,967	2042/5/15
		3.25 T-NOTE 270630	3.25	4,500	4,394	683,843	2027/6/30
		3.25 T-NOTE 290630	3.25	4,100	3,909	608,329	2029/6/30
		3.375 T-BOND 420815	3.375	2,860	2,349	365,547	2042/8/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	3,050	2,460	382,908	2044/5/15
		3.375 T-BOND 481115	3.375	4,320	3,360	522,944	2048/11/15
		3.375 T-NOTE 330515	3.375	9,350	8,579	1,335,032	2033/5/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	700	612	95,236	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 280131	3.5	1,300	1,270	197,637	2028/1/31
		3.5 T-NOTE 280430	3.5	3,900	3,800	591,431	2028/4/30
		3.5 T-NOTE 290930	3.5	5,600	5,383	837,730	2029/9/30
		3.5 T-NOTE 300430	3.5	1,900	1,816	282,590	2030/4/30
		3.625 T-BOND 430815	3.625	2,230	1,880	292,581	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	2,400	2,013	313,295	2044/2/15
		3.625 T-BOND 530515	3.625	5,270	4,257	662,431	2053/5/15
		3.625 T-NOTE 260515	3.625	4,300	4,266	663,826	2026/5/15
		3.625 T-NOTE 280331	3.625	880	861	134,063	2028/3/31
		3.625 T-NOTE 280531	3.625	3,760	3,676	572,017	2028/5/31
		3.625 T-NOTE 300331	3.625	3,590	3,454	537,514	2030/3/31
		3.625 T-NOTE 310930	3.625	10,000	9,489	1,476,528	2031/9/30
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,200	1,049	163,285	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,210	1,892	294,497	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 260415	3.75	3,900	3,876	603,153	2026/4/15
		3.75 T-NOTE 270815	3.75	7,500	7,401	1,151,683	2027/8/15
		3.75 T-NOTE 281231	3.75	4,860	4,748	738,831	2028/12/31
		3.75 T-NOTE 300531	3.75	3,750	3,625	564,103	2030/5/31
		3.75 T-NOTE 300630	3.75	3,150	3,043	473,540	2030/6/30

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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.75 T-NOTE 301231	3.75	3,920	3,771	586,780	2030/12/31
		3.875 T-BOND 400815	3.875	570	510	79,498	2040/8/15
		3.875 T-BOND 430215	3.875	3,760	3,301	513,740	2043/2/15
		3.875 T-BOND 430515	3.875	2,760	2,417	376,226	2043/5/15
		3.875 T-NOTE 271231	3.875	3,500	3,458	538,143	2027/12/31
		3.875 T-NOTE 290930	3.875	3,650	3,565	554,762	2029/9/30
		3.875 T-NOTE 291130	3.875	3,060	2,986	464,632	2029/11/30
		3.875 T-NOTE 291231	3.875	3,350	3,267	508,442	2029/12/31
		3.875 T-NOTE 330815	3.875	8,840	8,398	1,306,836	2033/8/15
		3.875 T-NOTE 340815	3.875	10,450	9,856	1,533,667	2034/8/15
		4 T-BOND 521115	4.0	4,040	3,495	543,956	2052/11/15
		4 T-NOTE 260215	4.0	3,900	3,889	605,242	2026/2/15
		4 T-NOTE 270115	4.0	5,380	5,352	832,926	2027/1/15
		4 T-NOTE 280229	4.0	3,400	3,367	524,018	2028/2/29
		4 T-NOTE 280630	4.0	4,000	3,956	615,556	2028/6/30
		4 T-NOTE 290131	4.0	5,400	5,322	828,177	2029/1/31
		4 T-NOTE 290731	4.0	6,450	6,342	986,879	2029/7/31
		4 T-NOTE 291031	4.0	3,840	3,769	586,557	2029/10/31
		4 T-NOTE 300228	4.0	3,490	3,420	532,183	2030/2/28
		4 T-NOTE 310131	4.0	4,090	3,985	620,108	2031/1/31
		4 T-NOTE 340215	4.0	9,950	9,506	1,479,154	2034/2/15
		4.125 T-NOTE 260615	4.125	1,000	998	155,332	2026/6/15
		4.125 T-NOTE 270930	4.125	4,200	4,182	650,724	2027/9/30
		4.125 T-NOTE 271031	4.125	3,920	3,902	607,200	2027/10/31
		4.125 T-NOTE 280731	4.125	4,070	4,039	628,554	2028/7/31
		4.125 T-NOTE 290331	4.125	8,400	8,310	1,293,178	2029/3/31
		4.125 T-NOTE 300831	4.125	3,260	3,204	498,596	2030/8/31
		4.125 T-NOTE 310331	4.125	5,480	5,370	835,717	2031/3/31
		4.125 T-NOTE 310731	4.125	4,250	4,158	647,079	2031/7/31
		4.125 T-NOTE 321115	4.125	5,970	5,808	903,821	2032/11/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	600	567	88,363	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,410	1,319	205,340	2040/11/15
		4.25 T-BOND 540215	4.25	1,640	1,484	230,936	2054/2/15
		4.25 T-BOND 540815	4.25	6,100	5,526	859,879	2054/8/15
		4.25 T-NOTE 270315	4.25	5,500	5,496	855,281	2027/3/15
		4.25 T-NOTE 290630	4.25	7,000	6,954	1,082,073	2029/6/30
		4.25 T-NOTE 310228	4.25	4,170	4,116	640,475	2031/2/28
		4.25 T-NOTE 310630	4.25	4,400	4,337	674,905	2031/6/30
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,280	1,223	190,431	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,300	1,238	192,699	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,330	1,259	195,961	2041/5/15
		4.375 T-BOND 430815	4.375	4,110	3,849	598,946	2043/8/15
		4.375 T-NOTE 260731	4.375	3,500	3,506	545,536	2026/7/31
		4.375 T-NOTE 261215	4.375	5,500	5,510	857,371	2026/12/15
		4.375 T-NOTE 270715	4.375	700	701	109,130	2027/7/15
		4.375 T-NOTE 280831	4.375	5,140	5,140	799,846	2028/8/31
		4.375 T-NOTE 281130	4.375	4,550	4,548	707,689	2028/11/30

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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	4.375 T-NOTE 301130	4.375	4,500	4,475	696,425	2030/11/30
		4.375 T-NOTE 340515	4.375	9,850	9,674	1,505,359	2034/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	600	598	93,144	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	660	647	100,810	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,067	166,152	2039/8/15
		4.5 T-BOND 440215	4.5	2,890	2,743	426,953	2044/2/15
		4.5 T-NOTE 260715	4.5	3,600	3,612	562,085	2026/7/15
		4.5 T-NOTE 270415	4.5	4,510	4,529	704,812	2027/4/15
		4.5 T-NOTE 270515	4.5	5,500	5,524	859,560	2027/5/15
		4.5 T-NOTE 290531	4.5	6,650	6,673	1,038,438	2029/5/31
		4.5 T-NOTE 331115	4.5	10,100	10,033	1,561,154	2033/11/15
		4.625 T-BOND 440515	4.625	2,400	2,314	360,136	2044/5/15
		4.625 T-NOTE 260228	4.625	6,180	6,203	965,289	2026/2/28
		4.625 T-NOTE 260915	4.625	5,100	5,128	798,023	2026/9/15
		4.625 T-NOTE 261015	4.625	5,240	5,270	820,025	2026/10/15
		4.625 T-NOTE 261115	4.625	1,000	1,006	156,545	2026/11/15
		4.625 T-NOTE 270615	4.625	5,300	5,340	830,913	2027/6/15
		4.625 T-NOTE 280930	4.625	1,400	1,411	219,631	2028/9/30
		4.625 T-NOTE 290430	4.625	6,150	6,202	965,032	2029/4/30
		4.625 T-NOTE 300930	4.625	3,750	3,778	587,933	2030/9/30
		4.625 T-NOTE 310430	4.625	2,590	2,607	405,680	2031/4/30
		4.625 T-NOTE 310531	4.625	5,350	5,383	837,744	2031/5/31
		4.75 T-BOND 410215	4.75	260	257	40,078	2041/2/15
		4.75 T-BOND 431115	4.75	160	157	24,462	2043/11/15
		4.75 T-BOND 531115	4.75	5,220	5,127	797,811	2053/11/15
		4.875 T-NOTE 260430	4.875	6,000	6,043	940,437	2026/4/30
		4.875 T-NOTE 281031	4.875	5,500	5,592	870,224	2028/10/31
		4.875 T-NOTE 301031	4.875	3,350	3,417	531,725	2030/10/31
		5.25 T-BOND 281115	5.25	1,000	1,030	160,286	2028/11/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	910	952	148,249	2031/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	800	838	130,519	2027/11/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	660	715	111,393	2030/5/15
小計						125,008,556	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	0.25	1,200	1,165	126,174	2026/3/1
		0.5 CAN GOVT 301201	0.5	2,120	1,831	198,221	2030/12/1
		1.25 CAN GOVT 270301	1.25	2,770	2,679	290,020	2027/3/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,150	1,129	122,265	2026/6/1
		1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,800	2,542	275,176	2031/6/1
		1.5 CAN GOVT 311201	1.5	3,070	2,760	298,805	2031/12/1
		1.75 CAN GOVT 531201	1.75	990	690	74,705	2053/12/1
		2 CAN GOVT 320601	2.0	150	138	14,997	2032/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	3,560	2,677	289,836	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 291201	2.25	400	387	41,892	2029/12/1
		2.5 CAN GOVT 321201	2.5	1,600	1,523	164,864	2032/12/1
		2.75 CAN GOVT 270901	2.75	1,100	1,096	118,623	2027/9/1
		2.75 CAN GOVT 300301	2.75	1,100	1,086	117,592	2030/3/1

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				
			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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	900	803	86,996	2048/12/ 1
		2.75 CAN GOVT 551201	2.75	1,680	1,467	158,855	2055/12/ 1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	620	543	58,783	2064/12/ 1
		3 CAN GOVT 260401	3.0	1,500	1,501	162,482	2026/ 4 / 1
		3 CAN GOVT 270201	3.0	800	801	86,747	2027/ 2 / 1
		3 CAN GOVT 340601	3.0	2,540	2,487	269,179	2034/ 6 / 1
		3.25 CAN GOVT 261101	3.25	2,000	2,011	217,711	2026/11/ 1
		3.25 CAN GOVT 280901	3.25	600	606	65,655	2028/ 9 / 1
		3.25 CAN GOVT 331201	3.25	1,970	1,972	213,451	2033/12/ 1
		3.25 CAN GOVT 341201	3.25	2,100	2,095	226,795	2034/12/ 1
		3.5 CAN GOVT 280301	3.5	1,390	1,414	153,070	2028/ 3 / 1
		3.5 CAN GOVT 290901	3.5	2,550	2,606	282,115	2029/ 9 / 1
		3.5 CAN GOVT 340301	3.5	1,150	1,173	126,970	2034/ 3 / 1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	730	741	80,203	2045/12/ 1
		4 CAN GOVT 260501	4.0	1,630	1,651	178,713	2026/ 5 / 1
		4 CAN GOVT 290301	4.0	2,120	2,205	238,698	2029/ 3 / 1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	540	582	63,018	2041/ 6 / 1
		4.5 CAN GOVT 260201	4.5	1,070	1,086	117,583	2026/ 2 / 1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	400	467	50,619	2037/ 6 / 1
5.75 CAN GOVT 290601	5.75	600	668	72,402	2029/ 6 / 1		
5.75 CAN GOVT 330601	5.75	810	957	103,620	2033/ 6 / 1		
小 計						5,146,853	
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 361120	10.0	8,000	8,054	61,393	2036/11/20
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	42,380	39,220	298,949	2027/ 3 / 4
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	16,350	15,725	119,865	2026/ 3 / 5
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	24,750	23,739	180,946	2027/ 6 / 3
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	18,000	15,619	119,053	2033/ 5 /26
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	24,000	21,850	166,548	2031/ 5 /29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	21,800	18,832	143,541	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	22,670	17,897	136,415	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 350524	8.0	4,000	3,460	26,373	2035/ 5 /24
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	11,780	9,351	71,279	2047/11/ 7
		8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	27,380	21,458	163,560	2053/ 7 /31
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	8.5	25,710	24,696	188,239	2029/ 3 / 1
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	34,900	33,548	255,716	2029/ 5 /31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	13,410	11,781	89,798	2038/11/18
小 計						2,021,681	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	2,900	2,802	456,781	2026/ 8 /15
		0 BUND 271115	—	2,150	2,020	329,343	2027/11/15
		0 BUND 281115	—	2,680	2,462	401,464	2028/11/15
		0 BUND 300815	—	2,850	2,509	409,110	2030/ 8 /15
		0 BUND 300815	—	1,200	1,057	172,314	2030/ 8 /15
		0 BUND 310815	—	2,820	2,421	394,648	2031/ 8 /15
		0 BUND 310815	—	850	729	118,978	2031/ 8 /15
		0 BUND 320215	—	400	338	55,152	2032/ 2 /15

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0 BUND 350515	—	1,710	1,313	214,139	2035/ 5 /15
		0 BUND 360515	—	1,980	1,473	240,193	2036/ 5 /15
		0 BUND 500815	—	1,520	761	124,119	2050/ 8 /15
		0 BUND 500815	—	170	85	13,906	2050/ 8 /15
		0 OBL 260410	—	700	681	111,112	2026/ 4 /10
		0 OBL 261009	—	2,710	2,609	425,447	2026/10/ 9
		0 OBL 270416	—	2,200	2,094	341,427	2027/ 4 /16
		0.25 BUND 280815	0.25	320	298	48,672	2028/ 8 /15
		0.25 BUND 290215	0.25	2,800	2,584	421,238	2029/ 2 /15
		0.5 BUND 270815	0.5	460	440	71,838	2027/ 8 /15
		1 BUND 380515	1.0	2,420	1,957	319,057	2038/ 5 /15
		1.25 BUND 480815	1.25	3,260	2,410	392,882	2048/ 8 /15
		1.3 OBL 271015	1.3	2,970	2,897	472,347	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,800	1,756	286,308	2027/10/15
		1.7 BUND 320815	1.7	1,450	1,378	224,696	2032/ 8 /15
		1.8 BUND 530815	1.8	2,880	2,329	379,719	2053/ 8 /15
		1.8 BUND 530815	1.8	960	777	126,804	2053/ 8 /15
		2.1 BUND 291115	2.1	1,720	1,699	277,050	2029/11/15
		2.1 OBL 290412	2.1	2,680	2,654	432,772	2029/ 4 /12
		2.2 BUND 340215	2.2	3,130	3,049	497,102	2034/ 2 /15
		2.2 OBL 280413	2.2	2,610	2,603	424,383	2028/ 4 /13
		2.3 BUND 330215	2.3	3,050	3,013	491,185	2033/ 2 /15
		2.3 BUND 330215	2.3	900	889	144,962	2033/ 2 /15
		2.4 BUND 301115	2.4	2,470	2,471	402,841	2030/11/15
		2.4 OBL 281019	2.4	2,710	2,718	443,178	2028/10/19
		2.5 BUND 440704	2.5	2,830	2,707	441,277	2044/ 7 / 4
		2.5 BUND 460815	2.5	2,960	2,823	460,301	2046/ 8 /15
		2.5 BUND 540815	2.5	1,750	1,649	268,934	2054/ 8 /15
		2.5 OBL 291011	2.5	1,700	1,710	278,792	2029/10/11
		2.5 SCHATS 260319	2.5	2,200	2,204	359,312	2026/ 3 /19
		2.6 BUND 330815	2.6	2,820	2,842	463,357	2033/ 8 /15
		2.6 BUND 340815	2.6	2,680	2,691	438,779	2034/ 8 /15
		2.6 BUND 410515	2.6	710	691	112,718	2041/ 5 /15
		2.7 SCHATS 260917	2.7	1,100	1,106	180,440	2026/ 9 /17
3.25 BUND 420704	3.25	190	201	32,902	2042/ 7 / 4		
4 BUND 370104	4.0	830	941	153,413	2037/ 1 / 4		
4.25 BUND 390704	4.25	1,520	1,787	291,345	2039/ 7 / 4		
4.75 BUND 280704	4.75	1,300	1,405	229,158	2028/ 7 / 4		
4.75 BUND 340704	4.75	820	971	158,445	2034/ 7 / 4		
4.75 BUND 400704	4.75	1,610	2,005	326,973	2040/ 7 / 4		
5.5 BUND 310104	5.5	2,040	2,387	389,235	2031/ 1 / 4		
5.625 BUND 280104	5.625	1,850	2,024	329,964	2028/ 1 / 4		
6.25 BUND 300104	6.25	600	706	115,237	2030/ 1 / 4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,850	2,033	331,511	2027/ 7 / 4		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 260401	—	2,200	2,139	348,701	2026/ 4 / 1
		0 ITALY GOVT 260801	—	1,800	1,735	282,913	2026/ 8 / 1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	500	454	74,122	2029/ 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				
			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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,000	1,961	319,742	2026/ 2 / 1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	600	555	90,609	2028/ 7 / 15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,590	2,197	358,224	2031/ 8 / 1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	2,030	1,965	320,466	2027/ 1 / 15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,120	1,851	301,844	2031/ 4 / 1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	2,250	2,155	351,381	2027/ 9 / 15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	630	562	91,698	2030/ 8 / 1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,100	1,807	294,560	2031/12/ 1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	1,270	1,077	175,672	2032/ 6 / 1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,440	1,052	171,572	2037/ 3 / 1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	1,440	1,395	227,516	2027/ 4 / 1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	600	586	95,682	2026/12/ 1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,200	2,025	330,183	2030/ 4 / 1
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,200	958	156,275	2036/ 3 / 1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	50	32	5,361	2045/ 4 / 30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,550	2,522	411,174	2026/ 6 / 1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	1,962	319,944	2030/12/ 1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	2,020	1,816	296,124	2032/ 3 / 1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	600	446	72,794	2041/ 3 / 1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	2,250	2,206	359,679	2028/ 2 / 1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,820	1,796	292,812	2027/ 8 / 1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	2,600	2,587	421,783	2026/ 7 / 15
		2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	850	579	94,429	2052/ 9 / 1
		2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	120	74	12,174	2072/ 3 / 1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,370	1,184	193,016	2036/ 9 / 1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,650	1,532	249,785	2033/ 9 / 1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,480	1,097	178,883	2050/ 9 / 1
		2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	1,750	1,648	268,729	2032/12/ 1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	1,090	1,089	177,552	2027/12/ 1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,960	1,961	319,771	2028/12/ 1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	1,710	1,702	277,569	2029/ 6 / 15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,040	775	126,396	2067/ 3 / 1
		2.95 ITALY GOVT 270215	2.95	1,700	1,711	278,991	2027/ 2 / 15
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,590	1,442	235,167	2038/ 9 / 1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,250	2,259	368,287	2029/ 8 / 1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	950	861	140,366	2040/ 3 / 1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	1,250	1,174	191,514	2038/ 3 / 1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,870	1,651	269,278	2046/ 9 / 1
		3.35 ITALY GOVT 290701	3.35	740	751	122,571	2029/ 7 / 1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,480	1,451	236,550	2035/ 3 / 1
		3.4 ITALY GOVT 280401	3.4	1,620	1,651	269,257	2028/ 4 / 1
		3.45 ITALY GOVT 310715	3.45	1,000	1,011	164,891	2031/ 7 / 15
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,800	1,628	265,426	2048/ 3 / 1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,110	2,163	352,724	2030/ 3 / 1
		3.5 ITALY GOVT 310215	3.5	1,750	1,778	289,905	2031/ 2 / 15
		3.7 ITALY GOVT 300615	3.7	1,500	1,544	251,787	2030/ 6 / 15
		3.8 ITALY GOVT 260415	3.8	950	964	157,209	2026/ 4 / 15

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	3.8 ITALY GOVT 280801	3.8	1,820	1,880	306,465	2028/8/1
		3.85 ITALY GOVT 260915	3.85	1,880	1,918	312,702	2026/9/15
		3.85 ITALY GOVT 291215	3.85	2,100	2,180	355,472	2029/12/15
		3.85 ITALY GOVT 340701	3.85	2,100	2,147	350,138	2034/7/1
		3.85 ITALY GOVT 350201	3.85	1,350	1,375	224,183	2035/2/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,650	1,581	257,792	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 301115	4.0	1,750	1,827	297,919	2030/11/15
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	570	591	96,399	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,560	1,606	261,908	2037/2/1
		4.05 ITALY GOVT 371030	4.05	1,030	1,058	172,531	2037/10/30
		4.1 ITALY GOVT 290201	4.1	2,300	2,404	391,905	2029/2/1
		4.15 ITALY GOVT 391001	4.15	1,320	1,349	220,035	2039/10/1
		4.2 ITALY GOVT 340301	4.2	1,480	1,557	253,948	2034/3/1
		4.3 ITALY GOVT 541001	4.3	950	956	155,856	2054/10/1
		4.4 ITALY GOVT 330501	4.4	1,700	1,820	296,822	2033/5/1
		4.45 ITALY GOVT 430901	4.45	1,530	1,603	261,359	2043/9/1
		4.5 ITALY GOVT 531001	4.5	1,380	1,444	235,545	2053/10/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,530	2,699	440,115	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	800	874	142,504	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,650	2,961	482,709	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	550	615	100,361	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,140	2,392	389,973	2040/9/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	470	546	89,155	2033/2/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,660	2,930	477,656	2027/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 270225	—	4,300	4,087	666,248	2027/2/25
		0 O. A. T 291125	—	4,790	4,190	683,071	2029/11/25
		0 O. A. T 301125	—	4,430	3,749	611,144	2030/11/25
		0 O. A. T 311125	—	5,060	4,131	673,533	2031/11/25
		0 O. A. T 320525	—	2,670	2,138	348,633	2032/5/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	4,250	4,085	666,017	2026/11/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	5,100	4,976	811,272	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	3,030	2,752	448,691	2029/5/25
		0.5 O. A. T 400525	0.5	2,690	1,722	280,778	2040/5/25
		0.5 O. A. T 440625	0.5	1,820	1,037	169,164	2044/6/25
		0.75 O. A. T 280225	0.75	4,400	4,160	678,225	2028/2/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	4,050	3,764	613,681	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	1,070	530	86,454	2052/5/25
		0.75 O. A. T 530525	0.75	3,260	1,574	256,690	2053/5/25
		1 O. A. T 270525	1.0	2,980	2,880	469,595	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	5,000	4,202	685,027	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	4,130	3,307	539,129	2036/5/25
		1.25 O. A. T 380525	1.25	3,110	2,367	385,958	2038/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	4,620	4,236	690,650	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	3,150	2,007	327,194	2050/5/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	250	200	32,729	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	760	450	73,459	2066/5/25
		2 O. A. T 321125	2.0	4,650	4,290	699,448	2032/11/25

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				
			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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	2 O.A.T 480525	2.0	2,410	1,771	288,832	2048/5/25
		2.5 O.A.T 270924	2.5	4,010	4,004	652,827	2027/9/24
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,770	1,739	283,486	2030/5/25
		2.5 O.A.T 430525	2.5	1,980	1,674	273,003	2043/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	4,630	4,653	758,643	2027/10/25
		2.75 O.A.T 290225	2.75	4,430	4,428	721,951	2029/2/25
		2.75 O.A.T 300225	2.75	2,200	2,187	356,659	2030/2/25
		3 O.A.T 330525	3.0	3,850	3,799	619,294	2033/5/25
		3 O.A.T 341125	3.0	3,000	2,923	476,556	2034/11/25
		3 O.A.T 490625	3.0	890	788	128,544	2049/6/25
		3 O.A.T 540525	3.0	2,400	2,055	335,063	2054/5/25
		3.25 O.A.T 550525	3.25	1,530	1,369	223,234	2055/5/25
		3.5 O.A.T 331125	3.5	1,930	1,969	321,125	2033/11/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,410	2,537	413,694	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,710	1,762	287,230	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,960	2,022	329,726	2060/4/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,470	1,629	265,583	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	1,840	2,066	336,936	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	3,940	4,365	711,617	2029/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 270115	—	950	908	148,042	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,280	1,162	189,473	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	900	785	127,999	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	750	636	103,684	2031/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	1,200	824	134,418	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	400	187	30,569	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	960	870	141,897	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	390	379	61,938	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	730	516	84,239	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,750	1,684	274,565	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	700	661	107,855	2028/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	1,200	986	160,811	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 300115	2.5	990	989	161,251	2030/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,420	1,402	228,550	2033/1/15
		2.5 NETH GOVT 330715	2.5	1,090	1,072	174,829	2033/7/15
		2.5 NETH GOVT 340715	2.5	1,040	1,016	165,774	2034/7/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,780	1,728	281,697	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 440115	3.25	940	979	159,668	2044/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,140	1,259	205,308	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	930	1,033	168,507	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,410	1,534	250,060	2028/1/15
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 270131	—	2,520	2,400	391,362	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,550	2,362	385,176	2028/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	1,890	1,684	274,518	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	2,000	1,710	278,877	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,380	2,157	351,706	2029/10/31
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	1,300	1,246	203,127	2027/7/30
		0.8 SPAIN GOVT 290730	0.8	500	460	75,003	2029/7/30

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	870	645	105,276	2037/ 7 /30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	1,710	1,140	185,903	2042/ 7 /30
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	2,630	2,414	393,574	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,530	1,502	244,883	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,570	1,507	245,778	2028/ 7 /30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	650	631	102,939	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,570	1,494	243,623	2029/ 4 /30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	2,550	2,498	407,289	2027/ 4 /30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	2,060	1,808	294,767	2035/ 7 /30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,960	1,336	217,830	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,000	1,917	312,545	2030/ 7 /30
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,890	1,790	291,944	2033/ 7 /30
		2.5 SPAIN GOVT 270531	2.5	2,460	2,459	400,869	2027/ 5 /31
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	2,150	2,085	339,924	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,800	1,517	247,420	2048/10/31
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	1,400	1,407	229,384	2026/ 5 /31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,160	1,027	167,480	2046/10/31
		3.1 SPAIN GOVT 310730	3.1	1,050	1,063	173,285	2031/ 7 /30
		3.15 SPAIN GOVT 330430	3.15	2,120	2,136	348,196	2033/ 4 /30
		3.25 SPAIN GOVT 340430	3.25	1,110	1,118	182,382	2034/ 4 /30
		3.45 SPAIN GOVT 341031	3.45	1,950	1,992	324,724	2034/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	1,640	1,589	259,185	2043/ 7 /30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,460	1,335	217,755	2066/ 7 /30
		3.5 SPAIN GOVT 290531	3.5	2,250	2,323	378,751	2029/ 5 /31
		3.55 SPAIN GOVT 331031	3.55	1,870	1,933	315,131	2033/10/31
		3.9 SPAIN GOVT 390730	3.9	1,320	1,375	224,299	2039/ 7 /30
		4 SPAIN GOVT 541031	4.0	970	996	162,459	2054/10/31
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,120	1,214	197,957	2037/ 1 /31
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,800	2,050	334,258	2041/ 7 /30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,600	1,855	302,403	2040/ 7 /30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,000	2,177	355,028	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	560	676	110,323	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,850	2,195	357,967	2032/ 7 /30
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,450	2,575	419,866	2026/ 7 /30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,100	2,368	386,032	2029/ 1 /31
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	800	748	122,089	2027/10/22
		0 BEL GOVT 311022	—	1,350	1,117	182,240	2031/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,370	1,192	194,370	2030/ 6 /22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	750	480	78,301	2040/ 6 /22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	30	11	1,882	2071/ 6 /22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	940	905	147,533	2027/ 6 /22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,137	348,468	2029/ 6 /22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,900	1,864	303,999	2026/ 6 /22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	400	358	58,365	2031/ 6 /22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	970	852	138,939	2033/ 4 /22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	990	600	97,904	2053/ 6 /22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	610	497	81,077	2037/ 6 /22

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	1.6 BEL GOVT 470622	1.6	690	482	78,618	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	830	702	114,530	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	630	437	71,338	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	700	509	82,988	2057/6/22
		2.7 BEL GOVT 291022	2.7	650	651	106,134	2029/10/22
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	800	746	121,662	2039/4/22
		2.85 BEL GOVT 341022	2.85	1,500	1,467	239,181	2034/10/22
		3 BEL GOVT 330622	3.0	1,020	1,019	166,167	2033/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	790	785	128,124	2034/6/22
		3.3 BEL GOVT 540622	3.3	910	846	137,911	2054/6/22
		3.45 BEL GOVT 430622	3.45	510	505	82,324	2043/6/22
		3.5 BEL GOVT 550622	3.5	670	643	104,822	2055/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	970	998	162,723	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	880	941	153,498	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	920	1,009	164,489	2041/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	670	778	126,836	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,410	1,536	250,492	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 281020	—	1,230	1,121	182,807	2028/10/20
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	450	394	64,300	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,310	1,113	181,514	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	280	171	27,912	2040/10/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	550	398	64,901	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	140	134	21,884	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	550	506	82,644	2029/2/20
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	500	215	35,156	2071/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,500	1,458	237,810	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,150	1,091	178,000	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	280	160	26,101	2051/3/20
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	1,300	1,143	186,407	2032/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	760	556	90,730	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	310	180	29,387	2086/11/2
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	550	426	69,482	2049/5/23
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	500	497	81,134	2026/7/15
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	530	388	63,288	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	950	909	148,312	2034/5/23
		2.9 AUSTRIA GOVT 290523	2.9	500	506	82,570	2029/5/23
		2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2.9	630	631	102,981	2033/2/20
		2.9 AUSTRIA GOVT 340220	2.9	790	788	128,486	2034/2/20
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	780	770	125,651	2044/6/20
		3.15 AUSTRIA GOVT 531020	3.15	550	537	87,542	2053/10/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 390715	3.2	650	651	106,225	2039/7/15
		3.45 AUSTRIA GOVT 301020	3.45	680	707	115,351	2030/10/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	270	301	49,092	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	650	719	117,249	2037/3/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	400	410	66,974	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	980	159,832	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 260915	—	420	404	65,917	2026/9/15

銘柄	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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 300915	—	400	344	56,175	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	500	421	68,650	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	100	72	11,798	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	280	127	20,714	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	390	250	40,770	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	650	635	103,652	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	550	523	85,411	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	660	614	100,121	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	480	436	71,134	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	310	194	31,776	2043/4/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	740	632	103,114	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	450	320	52,246	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	100	90	14,809	2032/9/15
		2.5 FINNISH GOVT 300415	2.5	540	536	87,435	2030/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	280	259	42,228	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	595	97,050	2028/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 380415	2.75	430	411	67,123	2038/4/15
		2.875 FINNISH GOV 290415	2.875	400	404	65,929	2029/4/15
		2.95 FINNISH GOVT 550415	2.95	330	311	50,738	2055/4/15
		3 FINNISH GOVT 330915	3.0	810	815	132,960	2033/9/15
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	700	585	95,476	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	830	790	128,825	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	700	611	99,742	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	400	334	54,571	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	50	38	6,355	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	430	292	47,757	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	450	428	69,902	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	700	688	112,192	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	820	773	126,141	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	230	205	33,526	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	310	224	36,653	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	700	606	98,898	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,080	909	148,335	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	930	921	150,245	2030/5/15
		2.6 IRISH GOVT 341018	2.6	340	333	54,293	2034/10/18
		3 IRISH GOVT 431018	3.0	140	138	22,612	2043/10/18
ポルトガル	国債証券	0.3 PORTUGUESE 311017	0.3	800	685	111,780	2031/10/17
		0.475 PORTUGUESE 301018	0.475	400	356	58,131	2030/10/18
		0.7 PORTUGUESE 271015	0.7	700	671	109,432	2027/10/15
		0.9 PORTUGUESE 351012	0.9	600	483	78,749	2035/10/12
		1 PORTUGUESE 520412	1.0	200	114	18,596	2052/4/12
		1.15 PORTUGUESE 420411	1.15	300	213	34,802	2042/4/11
		1.65 PORTUGUESE 320716	1.65	300	278	45,329	2032/7/16
		1.95 PORTUGUESE 290615	1.95	1,200	1,175	191,679	2029/6/15
		2.125 PORTUGUESE 281017	2.125	800	792	129,232	2028/10/17
		2.25 PORTUGUESE 340418	2.25	600	569	92,791	2034/4/18
		2.875 PORTUGUESE 260721	2.875	600	605	98,686	2026/7/21

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ポルトガル	国債証券	2.875 PORTUGUESE 341020	2.875	500	495	80,805	2034/10/20
		3.5 PORTUGUESE 380618	3.5	400	410	66,943	2038/ 6 /18
		3.625 PORTUGUESE 540612	3.625	270	271	44,293	2054/ 6 /12
		3.875 PORTUGUESE 300215	3.875	700	745	121,546	2030/ 2 /15
		4.1 PORTUGUESE 370415	4.1	500	547	89,170	2037/ 4 /15
		4.1 PORTUGUESE 450215	4.1	600	654	106,679	2045/ 2 /15
		4.125 PORTUGUESE 270414	4.125	400	415	67,811	2027/ 4 /14
小 計						77,909,522	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.25 GILT 310731	0.25	2,210	1,706	330,917	2031/ 7 /31
		0.375 GILT 261022	0.375	2,070	1,942	376,706	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	240	193	37,470	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	2,650	2,292	444,493	2029/ 1 /31
		0.625 GILT 350731	0.625	1,330	888	172,387	2035/ 7 /31
		0.875 GILT 460131	0.875	1,410	651	126,260	2046/ 1 /31
		1 GILT 320131	1.0	2,900	2,310	447,971	2032/ 1 /31
		1.125 GILT 390131	1.125	310	193	37,566	2039/ 1 /31
		1.125 GILT 731022	1.125	80	26	5,214	2073/10/22
		1.25 GILT 270722	1.25	300	279	54,226	2027/ 7 /22
		1.25 GILT 510731	1.25	1,520	675	131,047	2051/ 7 /31
		1.5 GILT 260722	1.5	1,470	1,414	274,329	2026/ 7 /22
		1.5 GILT 530731	1.5	670	309	60,006	2053/ 7 /31
		1.625 GILT 281022	1.625	1,100	1,004	194,842	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	290	120	23,270	2071/10/22
		1.75 GILT 370907	1.75	2,100	1,502	291,417	2037/ 9 / 7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,120	604	117,278	2049/ 1 /22
		1.75 GILT 570722	1.75	1,970	940	182,339	2057/ 7 /22
		2.5 GILT 650722	2.5	1,490	843	163,558	2065/ 7 /22
		3.25 GILT 330131	3.25	2,470	2,258	437,990	2033/ 1 /31
		3.25 GILT 440122	3.25	2,040	1,580	306,527	2044/ 1 /22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,680	1,340	259,984	2045/ 1 /22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,430	1,044	202,484	2068/ 7 /22
		3.75 GILT 270307	3.75	2,440	2,411	467,649	2027/ 3 / 7
		3.75 GILT 380129	3.75	2,680	2,402	465,978	2038/ 1 /29
		3.75 GILT 520722	3.75	1,250	991	192,185	2052/ 7 /22
		3.75 GILT 531022	3.75	2,640	2,078	402,968	2053/10/22
		4 GILT 311022	4.0	1,610	1,569	304,268	2031/10/22
		4 GILT 600122	4.0	1,210	992	192,407	2060/ 1 /22
		4 GILT 631022	4.0	1,270	1,033	200,485	2063/10/22
		4.125 GILT 270129	4.125	3,480	3,467	672,433	2027/ 1 /29
		4.125 GILT 290722	4.125	2,950	2,925	567,363	2029/ 7 /22
		4.25 GILT 271207	4.25	1,060	1,062	206,015	2027/12/ 7
		4.25 GILT 320607	4.25	360	356	69,121	2032/ 6 / 7
		4.25 GILT 340731	4.25	3,020	2,933	568,788	2034/ 7 /31
		4.25 GILT 360307	4.25	410	393	76,260	2036/ 3 / 7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,500	1,395	270,710	2039/ 9 / 7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,360	1,251	242,609	2040/12/ 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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	4.25 GILT 461207	4.25	1,660	1,462	283,630	2046/12/ 7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,370	1,194	231,664	2049/12/ 7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,640	1,410	273,445	2055/12/ 7
		4.375 GILT 540731	4.375	2,140	1,878	364,293	2054/ 7 /31
		4.5 GILT 280607	4.5	3,560	3,579	694,150	2028/ 6 / 7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,390	1,378	267,338	2034/ 9 / 7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,750	1,635	317,183	2042/12/ 7
		4.625 GILT 340131	4.625	3,010	3,013	584,339	2034/ 1 /31
		4.75 GILT 301207	4.75	2,070	2,116	410,496	2030/12/ 7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,600	1,579	306,331	2038/12/ 7
		4.75 GILT 431022	4.75	2,400	2,297	445,604	2043/10/22
		6 GILT 281207	6.0	980	1,043	202,337	2028/12/ 7
小計						13,958,354	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	2,260	1,984	28,219	2031/ 5 /12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	4,000	3,833	54,508	2028/ 5 /12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	7,700	7,214	102,584	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,041	85,911	2026/11/12
		1.75 SWD GOVT 331111	1.75	4,730	4,510	64,142	2033/11/11
		2.25 SWD GOVT 320601	2.25	900	898	12,776	2032/ 6 / 1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,850	6,495	92,363	2039/ 3 /30
		小計					
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,215	44,504	2031/ 9 /17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,400	1,226	16,974	2030/ 8 /19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,775	38,407	2026/ 2 /19
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,075	56,409	2027/ 2 /17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,500	3,189	44,143	2029/ 9 / 6
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,650	2,501	34,620	2028/ 4 /26
		2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	6,800	6,036	83,547	2032/ 5 /18
		3 NORWE GOVT 330815	3.0	4,000	3,737	51,728	2033/ 8 /15
		3.5 NORWE GOVT 421006	3.5	2,130	2,039	28,222	2042/10/ 6
小計						398,558	
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 DMK GOVT 311115	—	4,400	3,808	83,181	2031/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25	4,200	2,344	51,202	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,900	6,618	144,547	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	3,800	3,526	77,018	2029/11/15
		2.25 DMK GOVT 331115	2.25	4,160	4,160	90,872	2033/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,560	8,182	178,707	2039/11/15
小計						625,529	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	4,000	3,678	142,271	2026/10/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	4,400	3,468	134,168	2030/10/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	5,800	5,581	215,905	2026/ 7 /25
		2.5 POLAND 270725	2.5	2,300	2,155	83,358	2027/ 7 /25
		2.75 POLAND 291025	2.75	6,700	5,935	229,567	2029/10/25

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,874	149,865	2027/ 5 /25
		4.75 POLAND 290725	4.75	3,000	2,900	112,201	2029/ 7 /25
		5 POLAND 341025	5.0	3,000	2,791	107,965	2034/10/25
		5.75 POLAND 290425	5.75	860	865	33,488	2029/ 4 /25
		6 POLAND 331025	6.0	4,200	4,222	163,310	2033/10/25
		7.5 POLAND 280725	7.5	4,200	4,470	172,903	2028/ 7 /25
小 計						1,545,006	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	2,020	1,911	187,173	2026/ 9 /21
		1 AUST GOVT 301221	1.0	2,040	1,708	167,279	2030/12/21
		1 AUST GOVT 311121	1.0	2,500	2,024	198,232	2031/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,500	2,025	198,393	2032/ 5 /21
		1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,050	1,742	170,673	2031/ 6 /21
		1.75 AUST GOVT 321121	1.75	470	389	38,170	2032/11/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,760	926	90,744	2051/ 6 /21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,000	1,897	185,845	2028/ 5 /21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,500	1,454	142,448	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	640	613	60,076	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,080	1,965	192,519	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,200	1,026	100,536	2035/ 6 /21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	930	717	70,275	2041/ 5 /21
		3 AUST GOVT 331121	3.0	2,450	2,198	215,280	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	280	207	20,302	2047/ 3 /21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,070	1,040	101,880	2029/ 4 /21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,000	851	83,404	2039/ 6 /21
		3.5 AUST GOVT 341221	3.5	1,780	1,642	160,858	2034/12/21
		3.75 AUST GOVT 340521	3.75	750	710	69,603	2034/ 5 /21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	580	535	52,428	2037/ 4 /21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	950	953	93,357	2026/ 4 /21
		4.25 AUST GOVT 340621	4.25	550	541	53,074	2034/ 6 /21
		4.25 AUST GOVT 351221	4.25	1,200	1,172	114,835	2035/12/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,240	2,260	221,359	2033/ 4 /21
4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,700	1,730	169,492	2027/ 4 /21		
4.75 AUST GOVT 540621	4.75	790	761	74,598	2054/ 6 /21		
小 計						3,232,843	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	0.25	1,400	1,246	110,334	2028/ 5 /15
		1.5 NZ GOVT 310515	1.5	1,000	850	75,349	2031/ 5 /15
		1.75 NZ GOVT 410515	1.75	600	385	34,147	2041/ 5 /15
		2 NZ GOVT 320515	2.0	200	170	15,106	2032/ 5 /15
		2.75 NZ GOVT 370415	2.75	1,100	894	79,215	2037/ 4 /15
		2.75 NZ GOVT 510515	2.75	300	197	17,476	2051/ 5 /15
		3 NZ GOVT 290420	3.0	800	770	68,245	2029/ 4 /20
		3.5 NZ GOVT 330414	3.5	1,350	1,260	111,605	2033/ 4 /14
		4.25 NZ GOVT 340515	4.25	700	683	60,558	2034/ 5 /15
		4.5 NZ GOVT 270415	4.5	800	813	72,018	2027/ 4 /15
		4.5 NZ GOVT 300515	4.5	400	408	36,129	2030/ 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			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	
ニュージーランド			%	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル	千円	
	国債証券	4.5 NZ GOVT 350515	4.5	160	158	14,015	2035/ 5 /15
		5 NZ GOVT 540515	5.0	320	313	27,762	2054/ 5 /15
小 計						721,965	
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	1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	500	462	53,382	2031/ 7 / 1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	740	610	70,561	2050/ 3 / 1
		1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	210	171	19,866	2051/10/ 1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,000	988	114,227	2026/ 6 / 1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	530	495	57,240	2036/ 8 / 1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	340	317	36,712	2039/ 7 / 1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	250	248	28,689	2028/ 5 / 1
		2.625 SINGAPORGOV 320801	2.625	500	489	56,484	2032/ 8 / 1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	500	488	56,368	2042/ 4 / 1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	660	645	74,530	2046/ 3 / 1
		2.875 SINGAPORGOV 270901	2.875	200	200	23,127	2027/ 9 / 1
		2.875 SINGAPORGOV 280801	2.875	800	801	92,528	2028/ 8 / 1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	750	750	86,676	2029/ 7 / 1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	799	92,361	2030/ 9 / 1
		3 SINGAPORGOVT 720801	3.0	450	470	54,292	2072/ 8 / 1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	619	71,593	2033/ 9 / 1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	570	577	66,749	2027/ 3 / 1
小 計						1,055,393	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	2,120	1,989	70,538	2031/ 4 /15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,600	1,602	56,819	2027/ 5 /31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,300	2,314	82,061	2028/ 6 /15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	2,500	2,433	86,264	2040/ 5 /22
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	2,000	2,002	70,985	2034/ 7 / 5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,050	1,051	37,291	2033/ 4 /15
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,500	2,528	89,647	2029/ 8 /15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,700	1,719	60,964	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	2,730	2,758	97,772	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,500	1,512	53,623	2026/ 7 /15
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	1,400	1,382	49,022	2050/ 6 /15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,770	1,816	64,399	2031/ 6 /30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	400	413	14,657	2035/ 5 /31
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	4.457	1,580	1,653	58,634	2053/ 3 /31
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,100	1,142	40,509	2030/ 4 /15
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	4.504	400	414	14,691	2029/ 4 /30
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	2,300	2,439	86,466	2033/11/ 7
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	1,550	1,678	59,499	2042/10/15
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	500	544	19,313	2046/ 3 /15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	2,100	2,266	80,339	2037/ 4 / 7
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	2,900	3,178	112,686	2038/ 6 / 8
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	1,640	1,835	65,082	2048/ 7 / 6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	667	23,672	2043/ 9 /30
小 計						1,394,944	

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	
中国			%	千中国元	千中国元	千円	
	国債証券	1.62 CHINA GOVT 270815	1.62	28,000	28,209	605,695	2027/8/15
		1.67 CHINA GOVT 260615	1.67	20,000	20,100	431,579	2026/6/15
		1.85 CHINA GOVT 270515	1.85	37,000	37,462	804,358	2027/5/15
		1.91 CHINA GOVT 290715	1.91	28,000	28,583	613,709	2029/7/15
		1.99 CHINA GOVT 260315	1.99	33,000	33,270	714,346	2026/3/15
		2.05 CHINA GOVT 290415	2.05	40,000	41,020	880,750	2029/4/15
		2.11 CHINA GOVT 340825	2.11	34,000	35,373	759,503	2034/8/25
		2.12 CHINA GOVT 310625	2.12	42,000	43,413	932,123	2031/6/25
		2.18 CHINA GOVT 260815	2.18	37,000	37,515	805,485	2026/8/15
		2.28 CHINA GOVT 310325	2.28	40,000	41,672	894,758	2031/3/25
		2.3 CHINA GOVT 260515	2.3	22,000	22,289	478,580	2026/5/15
		2.35 CHINA GOVT 340225	2.35	35,000	36,939	793,117	2034/2/25
		2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	21,000	21,439	460,329	2027/1/20
		2.37 CHINA GOVT 290115	2.37	33,000	34,193	734,169	2029/1/15
		2.39 CHINA GOVT 261115	2.39	38,000	38,746	831,936	2026/11/15
		2.4 CHINA GOVT 280715	2.4	25,000	25,821	554,409	2028/7/15
		2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	18,000	18,512	397,473	2027/10/15
		2.46 CHINA GOVT 260215	2.46	36,000	36,426	782,123	2026/2/15
		2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	21,000	21,536	462,411	2027/4/15
		2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	41,000	42,094	903,813	2027/7/25
		2.52 CHINA GOVT 330825	2.52	30,000	32,014	687,374	2033/8/25
		2.54 CHINA GOVT 301225	2.54	28,000	29,532	634,099	2030/12/25
		2.55 CHINA GOVT 281015	2.55	31,000	32,232	692,062	2028/10/15
		2.6 CHINA GOVT 300915	2.6	33,000	34,846	748,195	2030/9/15
		2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	25,000	25,953	557,241	2028/4/15
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	25,000	26,302	564,747	2029/9/25
		2.62 CHINA GOVT 300625	2.62	28,000	29,562	634,740	2030/6/25
		2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	12,000	12,450	267,333	2028/1/15
		2.67 CHINA GOVT 330525	2.67	17,000	18,304	393,009	2033/5/25
		2.67 CHINA GOVT 331125	2.67	31,000	33,487	719,000	2033/11/25
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	17,000	18,037	387,273	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	34,000	34,769	746,533	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	24,000	25,822	554,443	2032/8/15
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	18,000	18,984	407,609	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	15,000	16,163	347,047	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	10,000	10,794	231,765	2032/5/15
		2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	19,000	20,173	433,138	2029/12/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	17,000	17,928	384,949	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	18,000	19,527	419,274	2032/11/15
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	29,000	30,073	645,717	2027/6/4
	2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	13,000	14,220	305,322	2033/2/25	
	2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	14,000	15,193	326,212	2031/11/18	
	2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	11,000	11,234	241,212	2026/5/5	
	2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	34,000	35,851	769,776	2028/10/14	
	3 CHINA GOVT 531015	3.0	15,000	18,512	397,483	2053/10/15	
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	21,000	22,130	475,153	2028/5/13	
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	16,000	17,424	374,118	2031/5/27	

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	
			%	千中国元	千中国元	千円	
中国	国債証券	3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	4,000	4,990	107,152	2052/10/25
		3.19 CHINA GOVT 530415	3.19	11,000	13,929	299,079	2053/4/15
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	13,000	13,749	295,226	2027/12/3
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	14,000	18,020	386,922	2052/4/15
		3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	22,000	28,243	606,408	2050/3/16
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	6,000	7,949	170,677	2051/10/18
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	14,000	19,061	409,264	2051/4/12
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	14,000	19,338	415,211	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	14,000	19,155	411,284	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	13,000	18,270	392,275	2048/10/22
小計					30,679,015		
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 260227	0.5	1,800	1,739	75,530	2026/2/27
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	2,100	1,804	78,329	2030/3/31
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,970	1,617	70,229	2032/4/30
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	3,800	2,746	119,209	2037/5/31
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2.0	2,500	2,426	105,336	2027/3/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	2,000	1,881	81,681	2028/9/28
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	2.8	1,700	1,175	51,049	2052/11/29
		3.75 ISRAEL FIXED 270930	3.75	2,620	2,618	113,672	2027/9/30
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	3.75	2,500	2,539	110,231	2029/2/28
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,270	1,133	49,196	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,710	1,872	81,292	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	700	734	31,864	2026/10/30
		小計					967,622
合計					265,106,355		

(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 (2025年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	265,106,355	94.9
コール・ローン等、その他	14,321,068	5.1
投資信託財産総額	279,427,423	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (271,556,181千円) の投資信託財産総額 (279,427,423千円) に対する比率は97.2%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=155.60円	1 カナダドル=108.23円	1 メキシコペソ=7.6222円	1 ユーロ=163.01円
1 イギリスポンド=193.92円	1 スウェーデンクローネ=14.22円	1 ノルウェークローネ=13.84円	1 デンマーククローネ=21.84円
1 ポーランドズロチ=38.6793円	1 オーストラリアドル=97.93円	1 ニュージーランドドル=88.55円	1 シンガポールドル=115.51円
1 マレーシアリンギット=35.4502円	1 中国元=21.471円	1 イスラエルシェケル=43.4097円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	552,654,334,644
コール・ローン等	3,565,315,164
公社債(評価額)	265,106,355,077
未収入金	281,289,710,727
未収利息	2,389,973,945
前払費用	302,979,731
(B) 負債	278,781,136,513
前受収益	27,665
未払金	273,344,024,675
未払解約金	5,437,084,173
(C) 純資産総額(A-B)	273,873,198,131
元本	250,514,609,108
次期繰越損益金	23,358,589,023
(D) 受益権総口数	250,514,609,108口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,932円

<注記事項>

- ①期首元本額 286,889,148,147円
 期中追加設定元本額 98,987,929,801円
 期中一部解約元本額 135,362,468,840円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0932円です。

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

MUAM 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)	146,811,281,653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)	12,330,561,092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)	12,008,571,278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)	11,774,821,541円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	9,675,052,399円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	9,161,514,425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)	6,859,743,898円
ラップ向けインデックスf 先進国債券(為替ヘッジあり)	6,703,506,595円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	6,049,921,424円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,277,023,576円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,489,826,411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)	2,884,231,357円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,564,311,183円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,546,531,919円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,533,812,026円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,566,949,267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)	1,015,138,980円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	965,770,996円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	696,382,521円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	660,703,777円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	504,804,879円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	379,992,517円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09(適格機関投資家限定)	308,430,826円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)	308,397,167円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03(適格機関投資家限定)	308,379,122円

○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	9,783,631,148
受取利息	9,783,376,053
その他収益金	270,956
支払利息	△ 15,861
(B) 有価証券売買損益	△18,858,378,484
売買益	77,085,216,387
売買損	△95,943,594,871
(C) 保管費用等	△ 43,950,953
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,118,698,289
(E) 前期繰越損益金	34,387,051,362
(F) 追加信託差損益金	11,006,816,475
(G) 解約差損益金	△12,916,580,525
(H) 計(D+E+F+G)	23,358,589,023
次期繰越損益金(H)	23,358,589,023

- (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。

MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	308,378,334円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	308,377,087円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	307,314,873円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	301,089,600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)	295,924,315円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	291,655,171円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	277,720,836円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	275,037,850円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	272,241,941円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	271,402,571円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	271,318,100円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	271,281,132円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	270,807,832円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	247,463,141円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	89,110,382円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	65,803,034円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	3,208,839円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	813,241円
合計	250,514,609,108円