

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーファンド	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	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。  
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。  
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）



イーマックス

# eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第8期（決算日：2023年1月26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26日に第8期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			合成ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産額	
		税分配	み金	期騰落	中率	期騰落				中率
	円		円		%		%		百万円	
4期(2019年1月28日)	10,246		0		0.6	10,417	1.1	98.3	0.1	259
5期(2020年1月27日)	10,601		0		3.5	10,827	3.9	97.5	0.0	199
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

(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 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2022年 1月26日	10,427	—	10,764	—	97.9	0.1
1 月 末	10,396	△ 0.3	10,733	△ 0.3	97.8	0.1
2 月 末	10,257	△ 1.6	10,593	△ 1.6	98.5	0.1
3 月 末	10,099	△ 3.1	10,436	△ 3.0	102.1	0.1
4 月 末	9,970	△ 4.4	10,310	△ 4.2	99.7	0.1
5 月 末	9,910	△ 5.0	10,248	△ 4.8	98.4	0.0
6 月 末	9,726	△ 6.7	10,063	△ 6.5	101.2	0.0
7 月 末	9,898	△ 5.1	10,247	△ 4.8	98.1	0.0
8 月 末	9,712	△ 6.9	10,053	△ 6.6	99.9	0.0
9 月 末	9,453	△ 9.3	9,788	△ 9.1	100.1	0.0
10 月 末	9,436	△ 9.5	9,774	△ 9.2	100.5	0.0
11 月 末	9,477	△ 9.1	9,820	△ 8.8	97.1	0.0
12 月 末	9,323	△10.6	9,662	△10.2	96.7	0.1
(期 末) 2023年 1月26日	9,439	△ 9.5	9,790	△ 9.0	98.0	0.1

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第8期：2022年1月27日～2023年1月26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8期首	10,427円
第8期末	9,439円
既払分配金	0円
騰落率	-9.5%

※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9.5%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（-9.0%）を0.5%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****下落要因**

主に外国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	-13.5%	50.1%
日本債券インデックスマザーファンド	-4.6%	49.4%

第8期：2022年1月27日～2023年1月26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。

国内債券市況は、欧米の景気減速懸念の高まりを背景とした利上げペースの見直し期待から反発する局面もありましたが、インフレ率の高止まりを受けた欧米金利の上昇などから下落しました。2022年12月には日銀がイールドカーブコントロール（YCC）を修正、長期金利の許容変動幅を従来の上下0.25%程度から同

0.5%程度への拡大を決定したことなどにより国内債券市況は下落し、期間を通じてみても下落しました。

### 外国債券市況

#### 先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

## 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せん。

### 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）

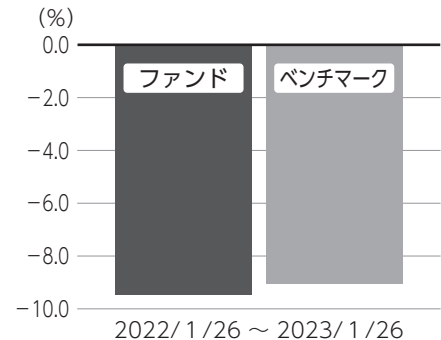
基準価額の騰落率は9.5%の下落となり、ベンチマークの9.0%の下落を0.5%下回りました。

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：**取引要因によるものです。

### ▶ 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：**取引要因によるものです。

**主なマイナス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

## 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8期 2022年1月27日～2023年1月26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	879

(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。

2022年1月27日～2023年1月26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	43	0.440	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(19)	(0.192)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(19)	(0.193)	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	0.011	(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)	(0.007)	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	44	0.451	

期中の平均基準価額は、9,763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。

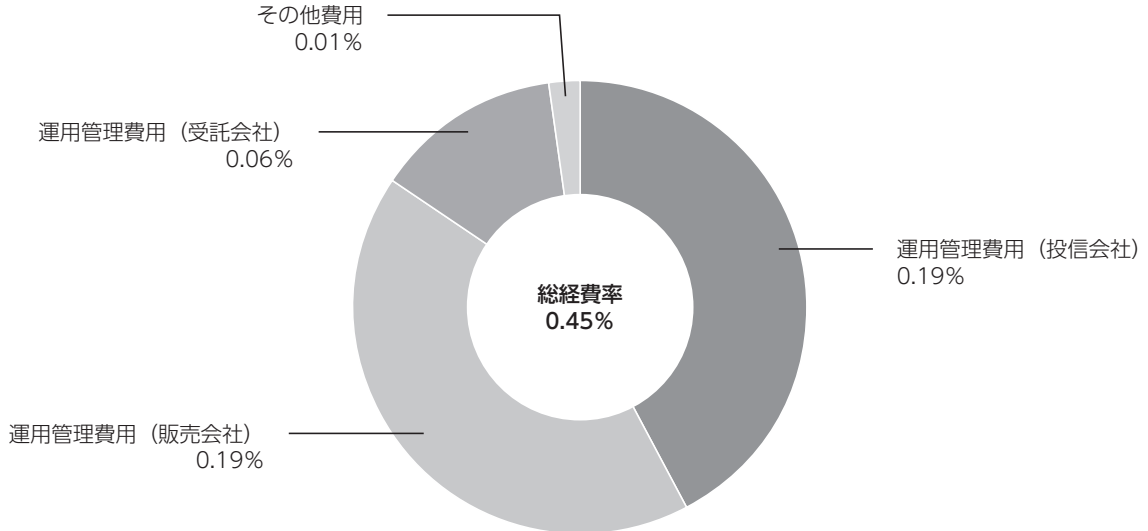
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年1月27日～2023年1月26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	17,325	20,995	5,578	6,777
日本債券インデックスマザーファンド	11,786	15,353	7,798	10,232

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt; eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） &gt;

該当事項はございません。

## &lt;ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	375,138	316,037	84.2	416,856	299,523	71.9

平均保有割合 0.0%

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$ %

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 235	百万円 400	百万円 3,740

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 4,399

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、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2023年1月26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	69,897	81,644	95,361
日本債券インデックスマザーファンド	69,466	73,455	93,986

## ○投資信託財産の構成

(2023年1月26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	95,361	50.0
日本債券インデックスマザーファンド	93,986	49.3
コール・ローン等、その他	1,399	0.7
投資信託財産総額	190,746	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(227,032,959千円)の投資信託財産総額(231,499,166千円)に対する比率は98.1%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=129.27円	1 カナダドル=96.51円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ユーロ=141.09円
1 イギリスポンド=160.40円	1 スウェーデンクローネ=12.67円	1 ノルウェークローネ=13.06円	1 デンマーククローネ=18.96円
1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 オーストラリアドル=91.87円	1 ニュージーランドドル=83.78円	1 シンガポールドル=98.47円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 中国元=19.0141円	1 イスラエルシェケル=38.3249円	

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	190,746,152
コール・ローン等	1,386,371
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	95,361,168
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	93,986,364
未収入金	12,249
(B) 負債	452,670
未払解約金	41,841
未払信託報酬	407,224
その他未払費用	3,605
(C) 純資産総額(A-B)	190,293,482
元本	201,598,101
次期繰越損益金	△ 11,304,619
(D) 受益権総口数	201,598,101口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,439円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 180,749,538円  
 期中追加設定元本額 46,568,899円  
 期中一部解約元本額 25,720,336円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9439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11,304,619円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2022年1月27日～ 2023年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,749,884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	12,874,845円
分配準備積立金額	3,103,395円
当ファンドの分配対象収益額	17,728,124円
1万口当たり収益分配対象額	879円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

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

## ○損益の状況（2022年1月27日～2023年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 257
受取利息	3
支払利息	△ 260
(B) 有価証券売買損益	△16,028,111
売買益	1,391,856
売買損	△17,419,967
(C) 信託報酬等	△ 814,943
(D) 当期損益金(A+B+C)	△16,843,311
(E) 前期繰越損益金	△ 2,880,866
(F) 追加信託差損益金	8,419,558
(配当等相当額)	( 12,847,471)
(売買損益相当額)	(△ 4,427,913)
(G) 計(D+E+F)	△11,304,619
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△11,304,619
追加信託差損益金	8,419,558
(配当等相当額)	( 12,874,845)
(売買損益相当額)	(△ 4,455,287)
分配準備積立金	4,853,279
繰越損益金	△24,577,456

(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21期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第21期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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
	円	騰落率		騰落率			
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8%	381.82	0.8%	98.4%	0.3%	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7%	388.16	1.7%	99.8%	0.1%	608,830
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

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。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 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2021年5月12日	円 13,462	% —	386.93	% —	% 99.5	% 0.2
5月末	13,450	△0.1	386.62	△0.1	99.4	0.3
6月末	13,459	△0.0	386.90	△0.0	99.4	0.4
7月末	13,526	0.5	388.81	0.5	99.3	0.4
8月末	13,515	0.4	388.46	0.4	99.3	0.4
9月末	13,469	0.1	387.12	0.0	99.4	0.4
10月末	13,454	△0.1	386.72	△0.1	99.3	0.4
11月末	13,486	0.2	387.65	0.2	99.2	0.2
12月末	13,456	△0.0	386.84	△0.0	100.5	0.1
2022年1月末	13,361	△0.8	384.06	△0.7	98.6	0.1
2月末	13,294	△1.2	382.13	△1.2	99.4	0.1
3月末	13,257	△1.5	381.04	△1.5	101.1	0.1
4月末	13,224	△1.8	380.12	△1.8	98.9	0.1
(期 末) 2022年5月12日	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

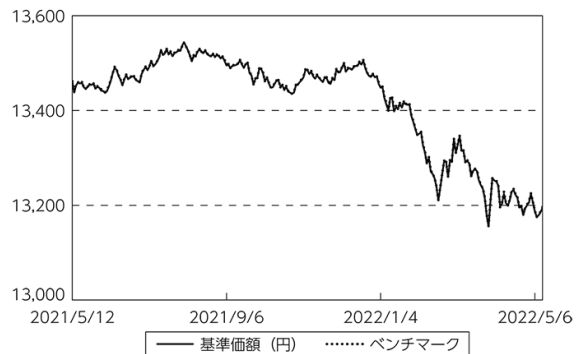
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%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(−2.0%)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。
- ・ 国内債券市況は期の前半から2021年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市況は下落しました。期の終わりにかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

● 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<sup>※</sup>。
- <sup>※</sup>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2.0%の下落になったため、乖離は△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)

- ・ 取引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<sup>※</sup>によるものです。  
<sup>※</sup>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。

○ 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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,413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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	436,809,550	125,988,934
	地方債証券	32,246,481	8,383,812 ( 66,000)
内	特殊債券	22,026,357	7,453,468 ( 610,844)
	社債券	31,022,353	10,161,510 ( 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	債券先物取引	百万円 5,757	百万円 5,911	百万円 -	百万円 -

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 522,104	百万円 72,698	13.9	百万円 151,987	百万円 40,900	26.9

(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 2,357	百万円 403	百万円 4,075

## 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 5,799

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、アコムです。

## ○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	536,355,000	554,662,985	83.2	—	56.6	17.4	9.2
地方債証券	37,976,950	39,181,165	5.9	—	2.4	2.2	1.3
	( 37,976,950)	( 39,181,165)	( 5.9)	( —)	( 2.4)	( 2.2)	( 1.3)
特殊債券 (除く金融債)	29,228,207	30,455,697	4.6	—	2.4	1.6	0.6
	( 29,228,207)	( 30,455,697)	( 4.6)	( —)	( 2.4)	( 1.6)	( 0.6)
金融債券	2,500,000	2,502,066	0.4	—	—	0.3	0.0
	( 2,500,000)	( 2,502,066)	( 0.4)	( —)	( —)	( 0.3)	( 0.0)
普通社債券	37,600,000	37,849,909	5.7	0.0	1.8	3.4	0.5
	( 37,600,000)	( 37,849,909)	( 5.7)	( 0.0)	( 1.8)	( 3.4)	( 0.5)
合 計	643,660,157	664,651,823	99.7	0.0	63.1	24.9	11.7
	(107,305,157)	(109,988,838)	(16.5)	(0.0)	( 6.5)	( 7.5)	( 2.5)

(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
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第425回利付国債(2年)	0.005	1,300,000	1,301,222	2023/6/1
第426回利付国債(2年)	0.005	4,530,000	4,534,348	2023/7/1
第427回利付国債(2年)	0.005	4,860,000	4,864,714	2023/8/1
第428回利付国債(2年)	0.005	2,300,000	2,302,392	2023/9/1
第429回利付国債(2年)	0.005	1,770,000	1,771,964	2023/10/1
第430回利付国債(2年)	0.005	3,000,000	3,003,510	2023/11/1
第431回利付国債(2年)	0.005	550,000	550,682	2023/12/1
第432回利付国債(2年)	0.005	1,600,000	1,601,968	2024/1/1
第433回利付国債(2年)	0.005	850,000	851,020	2024/2/1
第434回利付国債(2年)	0.005	5,300,000	5,306,678	2024/3/1
第136回利付国債(5年)	0.1	2,520,000	2,524,989	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	3,520,000	3,528,342	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	6,250,000	6,267,062	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	2,520,000	2,527,459	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	3,470,000	3,480,930	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	4,040,000	4,053,816	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	310,000	311,171	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	5,060,000	5,080,948	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	7,360,000	7,392,016	2025/6/20
第145回利付国債(5年)	0.1	4,310,000	4,329,524	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	5,760,000	5,787,014	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	540,000	540,518	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	1,750,000	1,751,435	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	6,950,000	6,952,988	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	6,280,000	6,281,444	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	950,000	949,762	2027/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	675,000	903,447	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,035,000	1,340,459	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	718,000	934,182	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,218,000	1,591,597	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,065,000	1,337,501	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,230,000	1,517,844	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,310,000	1,550,240	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,510,000	1,665,530	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,430,000	1,990,753	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,240,000	2,148,764	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,850,000	1,716,115	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	2,040,000	1,698,973	2059/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	2,320,000	1,922,305	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	2,660,000	2,354,339	2061/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	4,690,000	4,735,586	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	3,180,000	3,217,746	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	1,400,000	1,412,824	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,920,000	2,951,419	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,950,000	3,998,308	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,990,000	4,044,623	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,890,000	3,939,986	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	2,460,000	2,494,956	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,620,000	1,634,563	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,330,000	3,372,291	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,020,000	4,074,953	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	3,470,000	3,520,696	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	3,320,000	3,359,541	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,720,000	3,737,186	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	4,870,000	4,892,986	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	4,620,000	4,641,113	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	6,340,000	6,369,164	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	5,180,000	5,202,584	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	5,700,000	5,723,199	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	6,020,000	6,040,889	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	5,490,000	5,505,317	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	6,620,000	6,633,504	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	4,700,000	4,705,687	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	4,150,000	4,151,286	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	5,050,000	5,046,667	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	4,090,000	4,083,047	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	4,580,000	4,567,084	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	6,230,000	6,202,774	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	5,100,000	5,071,287	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	6,050,000	6,010,191	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	7,170,000	7,112,783	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	3,440,000	3,408,902	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	4,130,000	4,088,121	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	5,210,000	5,153,471	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	5,430,000	5,364,622	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	6,480,000	6,396,926	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	6,460,000	6,375,051	2031/12/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	196,000	233,875	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	268,000	313,980	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	307,000	358,447	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	252,000	309,148	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	238,000	279,797	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	339,000	407,932	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	339,000	407,522	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	302,000	349,124	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	206,000	229,525	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	398,000	431,233	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	237,000	272,362	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	325,000	388,391	2033/9/20

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13回利付国債 (30年)	2.0	595,000	705,664	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	683,000	843,293	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	686,000	857,266	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	547,000	685,478	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	577,000	717,632	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	687,000	848,108	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	593,000	733,742	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	655,000	828,869	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	529,000	657,414	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	695,000	883,650	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	194,000	247,235	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	541,000	691,019	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	647,000	809,927	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	1,014,000	1,285,691	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	460,000	592,043	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,026,000	1,324,473	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	530,000	678,150	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,421,000	1,798,971	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	1,923,000	2,408,538	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,309,000	1,663,791	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,317,000	1,609,887	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,791,000	2,253,418	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	2,029,000	2,489,238	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,929,000	2,368,136	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	2,037,000	2,465,931	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,590,000	1,896,170	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,270,000	1,538,909	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	1,640,000	1,956,979	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	780,000	916,063	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	1,600,000	1,880,080	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,400,000	1,645,924	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,470,000	1,729,087	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,530,000	1,736,687	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	2,000,000	2,270,480	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,680,000	1,942,063	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,830,000	2,038,052	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,540,000	1,714,944	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	1,810,000	1,781,438	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,970,000	1,722,233	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	1,850,000	1,693,693	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	1,580,000	1,478,548	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	1,440,000	1,407,888	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	1,410,000	1,376,893	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	1,970,000	1,921,380	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	1,310,000	1,274,774	2047/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第58回利付国債 (30年)	0.8	2,580,000	2,504,870	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	1,440,000	1,361,836	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	1,590,000	1,573,241	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	1,320,000	1,242,001	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	1,370,000	1,222,409	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	1,760,000	1,523,438	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	1,450,000	1,252,350	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	1,330,000	1,148,654	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	1,160,000	1,000,743	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	2,500,000	2,270,650	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	1,520,000	1,379,582	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	1,720,000	1,601,664	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	1,910,000	1,775,727	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	1,860,000	1,726,414	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	1,960,000	1,816,253	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	2,030,000	1,878,013	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	580,000	579,333	2052/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	565,443	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	617,000	629,815	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	821,000	843,011	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	648,000	668,515	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	240,000	247,212	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	82,907	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	1,041,000	1,084,617	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	124,804	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	732,000	769,771	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	360,000	377,060	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	1,079,000	1,133,586	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	520,000	547,736	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	698,000	737,053	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	705,000	748,181	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	410,000	432,771	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	370,000	391,604	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	310,000	328,689	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	150,000	159,510	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	585,000	623,908	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	250,000	267,092	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	1,082,000	1,159,611	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	395,000	425,363	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	880,000	944,477	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	520,000	562,494	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	1,047,000	1,140,633	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	420,000	455,943	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	1,264,000	1,384,155	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	340,000	370,926	2026/6/20



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第90回利付国債 (20年)	2.2	1,270,000	1,392,008	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	548,000	603,035	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,282,000	1,405,982	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	190,000	208,335	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	875,000	963,681	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	1,107,000	1,235,688	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	340,000	376,057	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	573,000	639,319	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	610,000	677,337	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,480,000	1,649,593	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,030,000	1,158,533	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	723,000	821,653	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	520,000	593,460	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	760,000	862,744	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	610,000	685,054	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	920,000	1,036,867	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	571,000	647,142	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	686,438	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	1,000,000	1,117,750	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	560,000	627,956	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	876,000	994,207	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	861,000	986,447	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,050,000	1,195,603	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	922,000	1,052,804	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,600,000	1,832,544	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	944,000	1,088,290	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	461,000	533,510	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,320,000	1,517,392	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	520,000	595,119	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	400,000	451,396	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	780,000	867,773	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,299,000	1,481,093	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	100,000	113,196	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,318,000	1,529,196	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	1,240,000	1,428,219	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	1,844,000	2,162,901	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	200,000	231,112	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	440,000	504,618	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,974,000	2,269,981	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	280,000	319,485	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,862,000	2,130,723	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	476,763	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	187,000	212,832	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	2,320,000	2,662,292	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	2,455,000	2,824,943	2032/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	57,053	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	190,000	214,971	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	5,542,000	6,333,896	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	360,000	404,344	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	310,000	351,242	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,717,000	3,108,411	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,120,000	1,283,139	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	2,170,000	2,508,411	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,840,000	2,091,380	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	940,000	1,058,543	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,890,000	3,321,216	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	2,900,000	3,336,682	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	3,060,000	3,490,450	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,210,000	2,497,786	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	3,190,000	3,609,676	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	2,840,000	3,181,879	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	3,390,000	3,717,677	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,840,000	3,115,792	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	2,520,000	2,797,149	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	3,170,000	3,478,282	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	2,810,000	3,010,043	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	2,910,000	2,881,627	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	3,060,000	2,940,966	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	2,450,000	2,451,641	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	3,020,000	3,059,018	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	2,790,000	2,861,200	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	2,170,000	2,191,222	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	3,260,000	3,285,395	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	2,310,000	2,323,259	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	3,190,000	3,152,932	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	2,570,000	2,534,097	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	3,590,000	3,643,455	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	2,270,000	2,227,301	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	2,720,000	2,618,707	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	1,890,000	1,784,046	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	1,610,000	1,515,010	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	2,150,000	2,016,764	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	2,660,000	2,533,357	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	2,530,000	2,404,157	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	3,550,000	3,363,057	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	2,460,000	2,367,307	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	2,860,000	2,744,170	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	2,470,000	2,321,651	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	3,270,000	3,126,512	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	2,900,000	2,766,600	2041/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第180回利付国債 (20年)		0.8	550,000	553,789	2042/3/20
小 計			536,355,000	554,662,985	
<b>地方債証券</b>					
第1回東京都公募公債 (20年)		1.54	20,000	20,340	2023/6/20
第4回東京都公募公債 (20年)		2.22	200,000	210,298	2024/9/20
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	105,909	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	107,090	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	80,000	102,650	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	125,864	2039/9/20
第20回東京都公募公債 (20年)		2.09	80,000	90,632	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)		2.19	80,000	91,513	2029/12/20
第28回東京都公募公債 (20年)		1.59	100,000	112,670	2033/3/18
第33回東京都公募公債 (20年)		0.18	100,000	94,973	2036/6/20
第722回東京都公募公債		0.8	100,000	100,881	2023/6/20
第724回東京都公募公債		0.7	800,000	807,504	2023/9/20
第728回東京都公募公債		0.65	900,000	909,261	2023/12/20
第729回東京都公募公債		0.69	200,000	202,476	2024/3/19
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	101,190	2024/3/19
第733回東京都公募公債		0.581	700,000	708,120	2024/6/20
第738回東京都公募公債		0.426	100,000	101,007	2024/12/20
第782回東京都公募公債		0.23	100,000	100,362	2028/6/20
第809回東京都公募公債		0.105	100,000	98,363	2030/9/20
第3回東京都公募公債 (20年)		2.26	400,000	416,580	2024/3/19
平成25年度第7回北海道公募公債		0.8	150,000	151,540	2023/8/30
平成26年度第9回北海道公募公債		0.52	100,000	101,198	2024/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債		0.461	100,000	101,118	2024/12/26
平成27年度第5回北海道公募公債		0.583	100,000	101,686	2025/6/30
第29回1号宮城県公募公債		0.68	300,000	302,946	2023/10/25
第36回2号宮城県公募公債		0.135	342,000	337,041	2030/10/28
第2回神奈川県公募公債 (20年)		2.23	680,000	715,176	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)		2.87	180,000	236,201	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債 (30年)		2.62	100,000	129,695	2038/3/19
第27回神奈川県公募公債 (20年)		1.398	100,000	111,097	2034/9/20
第234回神奈川県公募公債		0.254	100,000	100,507	2028/6/20
第243回神奈川県公募公債		0.075	100,000	98,548	2029/12/20
第11回大阪府公募公債 (20年)		1.693	100,000	113,945	2033/9/27
第153回大阪府公募公債 (5年)		0.001	300,000	299,982	2023/8/30
第184回大阪府公募公債 (5年)		0.001	120,000	119,707	2026/6/29
第375回大阪府公募公債		0.835	100,000	101,078	2023/8/29
第376回大阪府公募公債		0.82	106,000	107,182	2023/9/27
第378回大阪府公募公債		0.7	100,000	101,076	2023/11/28
第385回大阪府公募公債		0.65	200,000	202,612	2024/6/27
第388回大阪府公募公債		0.54	200,000	202,374	2024/9/27
第391回大阪府公募公債		0.513	210,000	212,631	2024/12/25
第393回大阪府公募公債		0.468	110,000	111,327	2025/2/26

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426回大阪府公募公債	0.172	100,000	100,148	2027/11/29
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,000	2028/8/30
第439回大阪府公募公債	0.193	100,000	99,824	2028/12/27
第455回大阪府公募公債	0.116	148,000	145,919	2030/4/26
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	190,818	2030/9/27
第464回大阪府公募公債	0.072	800,000	783,152	2031/1/28
第465回大阪府公募公債	0.12	500,000	491,025	2031/2/25
第467回大阪府公募公債	0.164	500,000	492,905	2031/4/28
第471回大阪府公募公債	0.083	497,000	485,708	2031/8/29
平成26年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.071	200,000	211,546	2029/4/27
平成26年度第5回京都府公募公債 (20年)	1.455	100,000	111,728	2034/8/10
第1回兵庫県公募公債 (12年)	1.1	100,000	102,259	2024/6/26
第1回兵庫県公募公債 (15年)	1.66	300,000	320,166	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	90,000	114,241	2040/3/19
第9回兵庫県公募公債 (15年)	1.02	500,000	527,480	2029/7/13
平成25年度第4回兵庫県公募公債	0.82	100,000	101,035	2023/8/18
第27回兵庫県公募公債 (20年)	0.387	200,000	195,640	2036/5/12
令和3年度第8回兵庫県公募公債	0.145	100,000	98,305	2031/10/24
第6回静岡県公募公債 (15年)	1.062	300,000	317,367	2029/6/25
第11回静岡県公募公債 (20年)	1.841	550,000	619,657	2030/10/18
第14回静岡県公募公債 (20年)	1.736	100,000	114,078	2032/6/18
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	290,000	293,210	2023/7/25
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	101,075	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	159,800	161,410	2023/10/24
平成26年度第3回静岡県公募公債	0.679	800,000	810,584	2024/5/27
令和2年度第15回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和2年度第13回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和3年度第7回静岡県公募公債	0.065	100,000	97,701	2031/6/20
平成20年度第8回愛知県公募公債 (20年)	2.04	200,000	223,994	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年)	2.28	700,000	800,296	2029/6/20
平成25年度第16回愛知県公募公債	0.665	700,000	707,154	2023/11/28
平成26年度第7回愛知県公募公債	0.591	600,000	607,374	2024/7/29
平成26年度第15回愛知県公募公債	0.48	200,000	202,294	2024/12/20
平成27年度第7回愛知県公募公債	0.548	100,000	101,615	2025/7/28
平成30年度第5回愛知県公募公債	0.195	100,000	100,121	2028/6/29
平成30年度第8回愛知県公募公債	0.255	200,000	200,872	2028/8/31
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	263,120	2025/3/25
平成28年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.414	100,000	97,984	2036/9/26
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	200,760	2028/11/22
第10回埼玉県公募公債 (20年)	1.94	100,000	113,586	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	200,000	225,442	2034/5/8
第16回埼玉県公募公債 (20年)	1.216	100,000	109,037	2035/8/14
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	100,813	2025/1/28
平成30年度第4回埼玉県公募公債	0.205	100,000	100,181	2028/6/26
令和2年度第1回埼玉県公募公債	0.131	100,000	98,835	2030/4/15

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
令和3年度第2回埼玉県公募公債 (5年)		0.01	110,000	109,805	2026/4/15
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)		2.62	70,000	90,429	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)		2.28	80,000	99,840	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債 (20年)		2.116	800,000	923,832	2031/2/21
平成25年度第9回福岡県公募公債		0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成26年度第8回福岡県公募公債		0.441	200,000	202,128	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債		0.654	100,000	101,313	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債		0.464	100,000	101,481	2025/12/25
令和2年度第4回福岡県公募公債		0.14	200,000	197,296	2030/9/20
第9回千葉県公募公債 (20年)		1.84	80,000	90,140	2030/10/11
平成25年度第1回千葉県公募公債		0.58	82,500	82,952	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債		0.67	100,000	101,014	2023/11/24
平成27年度第3回千葉県公募公債		0.524	200,000	202,990	2025/6/25
平成28年度第3回千葉県公募公債		0.05	400,000	399,824	2026/7/24
令和元年度第6回千葉県公募公債		0.135	100,000	98,945	2030/1/25
平成27年度第2回新潟県公募公債		0.215	100,000	100,606	2026/2/26
平成30年度第3回茨城県公募公債 (5年)		0.03	150,000	150,048	2023/8/25
第2回群馬県公募公債 (20年)		2.019	100,000	115,309	2031/7/18
第7回群馬県公募公債 (20年)		0.313	100,000	96,778	2036/6/13
平成27年度第1回岐阜県公募公債		0.515	300,000	304,725	2025/9/30
令和2年度第2回岐阜県公募公債 (5年)		0.02	100,000	99,897	2025/11/25
平成25年度第1回大分県公募公債		0.68	103,250	104,275	2023/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債		0.476	203,400	206,406	2025/10/30
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	700,000	706,748	2023/6/23
第124回共同発行市場公募地方債		0.91	700,000	707,623	2023/7/25
第125回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	101,049	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	100,975	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債		0.66	300,000	302,997	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	200,000	202,540	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,141	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,184	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	202,590	2024/4/25
第134回共同発行市場公募地方債		0.674	250,000	253,267	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債		0.659	200,000	202,664	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債		0.611	300,000	303,801	2024/7/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	202,360	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	400,000	403,292	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	202,486	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債		0.406	100,000	101,078	2025/4/25
第151回共同発行市場公募地方債		0.466	200,000	202,872	2025/10/24
第158回共同発行市場公募地方債		0.08	200,000	200,200	2026/5/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	300,000	301,119	2028/8/25
第193回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	99,158	2029/4/25
平成30年度第1回福島県公募公債		0.264	100,000	100,414	2028/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債		0.65	100,000	101,000	2023/11/29

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	
令和元年度第2回栃木県公募公債	0.09	100,000	98,706	2029/11/29
令和2年度第2回栃木県公募公債	0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	50,182	2022/10/26
令和3年度第1回熊本県公募公債 (5年)	0.005	200,000	199,532	2026/7/30
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	163,044	2024/1/24
第5回大阪市公募公債 (20年)	2.47	100,000	114,363	2028/9/21
第15回大阪市公募公債 (20年)	2.12	100,000	115,476	2031/1/24
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	101,273	2024/11/28
令和3年度第2回大阪市公募公債	0.16	100,000	98,611	2031/5/21
第1回名古屋市公募公債 (20年)	1.99	200,000	206,390	2023/12/20
第1回名古屋市公募公債 (30年)	2.53	100,000	125,194	2035/3/20
第9回名古屋市公募公債 (20年)	2.07	100,000	112,192	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債 (30年)	2.095	90,000	111,076	2042/9/19
第28回名古屋市公募公債 (5年)	0.01	500,000	499,205	2025/12/19
第491回名古屋市公募公債	0.587	400,000	406,792	2025/6/19
第511回名古屋市公募公債	0.075	100,000	98,419	2030/3/27
第1回京都市公募公債 (15年)	0.781	100,000	103,896	2030/12/20
第3回京都市公募公債 (20年)	2.09	100,000	107,345	2025/12/19
第5回京都市公募公債 (20年)	2.36	50,000	55,265	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年)	2.54	110,000	121,192	2026/6/19
平成20年度第24回神戸市公募公債 (20年)	2.08	200,000	224,516	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	113,011	2030/9/13
第5回横浜市公募公債 (20年)	2.17	100,000	106,612	2025/6/20
第7回横浜市公募公債 (20年)	2.06	450,000	482,566	2025/12/19
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	203,270	2025/6/16
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	400,000	406,264	2025/8/18
平成27年度第4回横浜市公募公債	0.486	300,000	304,503	2025/10/20
第27回横浜市公募公債 (20年)	1.599	100,000	112,895	2033/5/20
第33回横浜市公募公債 (20年)	0.323	100,000	96,996	2036/4/28
第35回横浜市公募公債 (20年)	0.443	500,000	491,475	2036/10/28
第54回横浜市公募公債 (5年)	0.02	300,000	299,691	2025/11/25
平成22年度第8回札幌市公募公債 (30年)	2.277	80,000	100,581	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	114,634	2031/7/29
令和元年度第2回札幌市公募公債 (5年)	0.01	600,000	599,682	2024/6/20
令和2年度第7回札幌市公募公債	0.115	200,000	196,634	2030/12/20
令和3年度第2回札幌市公募公債 (5年)	0.01	100,000	99,795	2026/6/19
第7回川崎市公募公債 (20年)	2.08	100,000	113,023	2029/7/17
第12回川崎市公募公債 (20年)	2.04	100,000	115,236	2031/5/30
第62回川崎市公募公債 (5年)	0.005	490,000	488,853	2026/7/30
第17回北九州市公募公債 (20年)	1.529	100,000	112,451	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,490	2023/10/24
平成30年度第11回福岡市公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,988	2024/3/28
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	101,155	2023/12/27
令和3年度第4回千葉市公募公債	0.135	100,000	98,180	2031/12/24



銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	101,133	2025/4/24
令和2年度第2回徳島県公募公債	0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成28年度第1回山梨県公募公債	0.06	200,000	199,950	2026/10/30
平成30年度第1回山梨県公募公債	0.289	100,000	100,600	2028/10/30
令和2年度第1回山梨県公募公債	0.135	700,000	689,843	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	112,631	2028/12/20
小 計		37,976,950	39,181,165	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
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	126,108	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	124,514	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	117,825	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	113,446	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	113,969	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	121,419	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	114,042	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	118,394	2042/5/30
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	340,000	342,254	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	101,028	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	323,000	326,685	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	308,000	311,517	2023/9/29
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	208,000	210,433	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	101,229	2024/3/29
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	100,000	101,334	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,360	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	124,000	125,640	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	111,151	2034/8/31
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.495	883,000	893,922	2024/11/29
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	101,198	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.45	200,000	202,534	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.509	133,000	135,024	2025/5/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	101,000	102,486	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	101,747	2025/7/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	101,098	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	200,912	2026/2/27
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,099	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,229	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,081	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	465,000	470,347	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	300,000	303,639	2024/3/15
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	315,000	319,095	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	101,391	2024/6/14
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	242,997	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	302,000	306,424	2025/6/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	150,000	151,909	2025/11/18
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	674,000	673,871	2026/3/13

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	102,000	101,959	2026/4/17
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.09	225,000	224,939	2027/9/17
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	90,938	2023/10/20
第232回政府保証預金保険機構債券	0.1	400,000	400,984	2024/12/10
第4回政府保証新関西国際空港債券	0.484	104,000	105,523	2025/6/13
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,230	2023/12/18
第26回政府保証日本政策投資銀行	0.466	100,000	101,193	2024/12/12
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	100,000	98,563	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	33,195	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	140,728	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	152,887	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	329,670	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	41,935	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	274,512	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	221,446	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	149,048	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	335,283	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	223,814	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)	2.83	100,000	126,529	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	300,000	384,714	2034/6/20
第38回道路債券(財投機関債)	2.26	200,000	210,438	2024/9/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	200,000	212,408	2025/3/21
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	172,306	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	113,870	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	100,000	101,018	2023/6/20
第121回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.689	100,000	101,067	2023/12/20
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	111,084	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	322,158	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	121,780	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	109,337	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	57,017	2029/6/28
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	128,443	2034/3/24
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	103,223	2023/12/20
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	104,023	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	104,115	2024/3/22
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	52,698	2024/9/24
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	112,648	2030/10/28
第12回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	300,000	317,034	2025/3/24
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	115,353	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	92,991	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	90,936	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	163,509	2026/3/24
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	113,167	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	112,392	2028/4/25
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	57,173	2033/1/28



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
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	109,627	2035/6/28
F54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.588	200,000	205,744	2024/3/19
第54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.73	200,000	202,180	2023/11/28
第60回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.729	200,000	202,792	2024/5/28
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.491	300,000	304,530	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	108,234	2028/1/28
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.314	100,000	103,570	2025/3/7
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	77,577	2031/7/30
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	100,000	106,631	2027/11/5
F203回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.063	200,000	210,254	2028/2/28
F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.605	100,000	113,446	2035/4/27
第27回首都高速道路	0.06	100,000	99,949	2025/12/19
第24回阪神高速道路	0.04	200,000	199,880	2025/3/19
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	91,487	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	90,517	2030/10/29
第5回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.23	200,000	211,304	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.175	400,000	401,832	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.225	100,000	100,120	2028/6/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	201,806	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	30,735	30,957	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	10,648	10,778	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	34,647	35,354	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	10,742	10,901	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	44,913	44,731	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	47,521	47,360	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,847	2042/8/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	56,412	56,097	2033/4/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,622	10,779	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	11,501	11,721	2038/11/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	22,158	22,498	2042/12/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	76,698	76,224	2034/6/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	10,194	10,264	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	12,268	12,643	2039/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	10,511	10,632	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	23,678	24,237	2043/5/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	21,818	23,148	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	10,105	10,159	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,592	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	21,982	22,213	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	22,280	23,519	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	21,558	22,788	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	41,984	44,170	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	11,097	11,255	2040/12/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	43,200	45,433	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	23,428	24,594	2045/7/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	32,010	32,378	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	45,860	47,656	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	11,443	11,678	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	30,921	31,166	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	26,600	27,990	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	20,956	21,292	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	102,536	108,276	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	64,125	67,436	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	19,240	20,223	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	39,662	41,660	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	40,352	42,305	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	42,464	44,371	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	10,410	10,545	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	44,622	46,679	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	23,530	24,206	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	47,910	50,057	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	49,926	52,163	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	28,330	29,591	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	28,630	29,928	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	61,884	64,772	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	65,142	67,750	2047/6/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	35,803	37,198	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	35,721	36,965	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	114,477	118,613	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	35,047	36,495	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	39,401	41,223	2048/7/10
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	33,841	35,171	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	32,076	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	34,855	36,030	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	38,865	40,185	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	41,130	42,477	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	162,300	167,386	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	83,770	86,442	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	114,042	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	44,974	46,253	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	139,185	142,574	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	48,841	49,683	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	213,592	2026/12/18
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.81	60,922	62,218	2050/4/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	58,033	59,032	2050/5/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	59,540	61,086	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	229,844	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	106,551	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	62,732	64,202	2050/12/10

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106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	130,872	131,362	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	286,276	284,254	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	220,035	216,175	2051/8/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	152,052	151,747	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	530,250	529,825	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	161,475	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	233,616	232,952	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	114,149	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,764	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	79,915	79,385	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,704	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,073	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	160,284	159,455	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,454	79,887	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,383	79,843	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	244,374	243,039	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	81,800	81,204	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,992	82,644	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	166,816	166,385	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	165,850	165,777	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	106,171	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	174,786	170,959	2054/8/10
第149回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.704	200,000	202,472	2024/3/19
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	267,348	261,348	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	180,278	176,827	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,157	88,917	2055/1/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	93,136	92,023	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	103,057	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,534	186,024	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	101,519	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,427	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	287,736	285,215	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	193,034	191,134	2056/6/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	193,626	191,223	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	195,006	192,020	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,462	95,954	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	193,120	2035/11/20
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	98,602	97,544	2056/12/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	197,794	194,898	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	198,310	196,743	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,357	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	199,598	199,168	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,102	2057/5/10
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	99,996	2026/10/20
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	100,748	2027/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
第231回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.06	100,000	100,044	2023/6/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	53,096	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	80,223	2031/6/13
第83回東日本高速道路		0.05	400,000	399,264	2026/6/19
第78回中日本高速道路		0.06	300,000	300,057	2024/5/29
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	201,762	2026/2/12
第56回西日本高速道路		0.06	900,000	899,874	2025/9/19
第61回西日本高速道路		0.04	400,000	399,100	2026/6/19
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	104,539	2029/11/27
小	計		29,228,207	30,455,697	
<b>金融債券</b>					
い第832号商工債券		0.06	100,000	99,905	2024/9/27
い第843号商工債券		0.12	200,000	199,972	2025/8/27
い第848号商工債券		0.1	100,000	99,872	2026/1/27
い第850号商工債券		0.1	300,000	299,421	2026/3/27
い第852号商工債券		0.09	100,000	99,759	2026/5/27
い第854号商工債券		0.08	400,000	398,736	2026/7/27
い第857号商工債券		0.09	100,000	99,665	2026/10/27
い第818号農林債券		0.08	200,000	200,108	2023/7/27
第376回信金中金債		0.05	100,000	99,768	2026/3/27
第11号商工債券(10年)		0.66	300,000	303,987	2024/9/20
第256号商工債券(3年)		0.04	300,000	299,691	2024/5/27
第257号商工債券(3年)		0.04	200,000	199,766	2024/6/27
第2回信金中金債(10年)		0.52	100,000	101,416	2025/9/26
小	計		2,500,000	2,502,066	
<b>普通社債券</b>					
第548回東京電力		2.347	100,000	109,427	2028/9/29
第567回東京電力		1.958	100,000	107,594	2030/7/29
第499回中部電力		1.194	100,000	101,195	2023/6/23
第508回関西電力		0.455	200,000	200,892	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	500,000	502,930	2027/7/23
第511回関西電力		0.41	100,000	100,131	2027/9/17
第518回関西電力		0.44	200,000	200,060	2028/6/20
第524回関西電力		0.514	200,000	200,740	2028/10/25
第532回関西電力		0.18	100,000	99,999	2024/7/25
第543回関西電力		0.001	200,000	199,100	2024/10/25
第381回中国電力		0.953	100,000	101,572	2024/4/25
第385回中国電力		0.728	100,000	101,699	2025/7/25
第393回中国電力		0.26	100,000	99,797	2026/11/25
第400回中国電力		0.34	200,000	199,894	2027/9/24
第409回中国電力		0.4	200,000	199,876	2028/9/25
第304回北陸電力		0.989	100,000	101,239	2023/10/25
第307回北陸電力		1.055	100,000	103,282	2026/6/25
第322回北陸電力		0.38	100,000	100,176	2027/6/25
第485回東北電力		0.25	100,000	99,977	2026/7/24

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494回東北電力	0.425	200,000	200,602	2027/6/25
第529回東北電力	0.07	500,000	496,575	2026/4/24
第449回九州電力	0.43	300,000	301,341	2027/4/23
第468回九州電力	0.435	100,000	99,939	2028/8/25
第471回九州電力	0.455	300,000	299,907	2028/11/24
第484回九州電力	0.375	400,000	395,660	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	400,000	397,760	2026/5/25
第29回沖縄電力	0.001	200,000	199,558	2024/6/25
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	105,596	2029/9/20
第27回新関西国際空港	0.05	100,000	99,846	2026/3/19
第32回成田国際空港	0.22	100,000	99,802	2029/1/29
第1回国際石油開発帝石	0.08	100,000	99,776	2026/3/16
第21回大和ハウス工業	0.001	300,000	299,658	2023/9/15
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	198,800	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	99,549	2026/3/13
第5回サントリー食品インターナショナル	0.001	200,000	199,328	2024/7/8
第22回味の素	0.305	100,000	100,454	2026/3/2
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,856	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	200,000	199,384	2028/9/8
第6回ヒューリック	0.494	400,000	399,068	2028/10/20
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,708	2024/12/20
第9回クラレ	0.34	100,000	100,256	2027/4/30
第16回旭化成	0.001	200,000	199,492	2024/12/9
第42回王子ホールディングス	0.08	300,000	298,809	2026/3/24
第11回イビデン	0.001	200,000	199,484	2024/9/9
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	100,047	2028/3/23
第6回花王	0.13	200,000	199,702	2025/9/19
第19回オリエンタルランド	0.001	300,000	299,301	2024/9/2
第6回ヤフー	0.35	100,000	99,945	2024/12/6
第12回ヤフー	0.37	200,000	198,820	2026/7/31
第19回Zホールディングス	0.35	400,000	397,312	2026/7/28
第5回荒川化学工業 (サステナビリティ)	0.18	100,000	99,606	2026/11/26
第11回ブリヂストン	0.295	300,000	299,961	2027/4/21
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	99,366	2028/2/25
第4回新日本製鐵	0.375	200,000	200,122	2027/5/20
第19回日立製作所	0.16	100,000	99,380	2027/3/12
第22回パナソニック	0.29	100,000	99,384	2027/12/24
第18回デンソー	0.315	300,000	299,226	2028/3/17
第18回J A三井リース	0.16	100,000	99,494	2026/3/12
第10回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.03	100,000	99,498	2024/10/21
第26回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	0.05	800,000	797,848	2026/3/18
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,958	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	200,000	199,726	2024/8/2
第63回三井物産	2.37	400,000	441,048	2027/4/23
第51回住友商事	1.241	100,000	105,178	2029/4/23

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1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	101,228	2024/6/26
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	300,000	302,529	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	500,000	497,910	2028/5/31
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.91	200,000	232,026	2029/10/16
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	200,000	210,282	2025/11/12
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.16	200,000	212,312	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	113,946	2031/1/20
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	110,394	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	98,856	2028/6/12
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	106,469	2026/9/11
第28回芙蓉総合リース	0.14	500,000	496,920	2026/4/21
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	1,200,000	1,200,468	2025/12/19
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	300,000	299,883	2027/12/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	0.001	600,000	598,224	2024/10/28
第34回東京センチュリー	0.22	300,000	295,461	2028/7/21
第65回ホンダファイナンス	0.16	300,000	299,853	2025/9/19
第70回ホンダファイナンス	0.001	200,000	199,550	2024/9/19
第72回ホンダファイナンス	0.03	400,000	399,104	2024/12/19
第95回トヨタファイナンス	0.001	500,000	499,185	2024/4/15
第96回トヨタファイナンス	0.06	800,000	797,808	2026/4/15
第97回トヨタファイナンス	0.001	200,000	199,566	2024/7/22
第31回リコーリース	0.3	100,000	100,239	2025/1/23
第41回リコーリース	0.14	500,000	497,310	2026/4/17
第79回アコム	0.29	300,000	300,117	2025/2/28
第80回アコム	0.28	200,000	199,674	2026/2/26
第81回アコム	0.17	100,000	99,223	2026/9/3
第87回日立キャピタル	0.06	300,000	299,676	2024/1/19
第201回オリックス	0.07	500,000	496,230	2026/4/21
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	300,000	300,300	2023/11/27
第30回三井住友ファイナンス&リース	0.01	200,000	199,748	2023/8/10
第1回三菱HCキャピタル	0.05	900,000	896,877	2024/11/29
第69回三菱UFJリース	0.24	500,000	499,320	2026/7/10
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	106,102	2025/6/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	105,835	2025/9/24
第137回三菱地所	0.05	300,000	300,072	2025/2/7
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000	101,148	2024/9/20
第13回森トラスト総合リート投資法人	0.17	200,000	199,720	2024/2/22
第36回京王電鉄	0.325	200,000	200,292	2027/9/17
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	105,097	2024/6/20
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	336,681	2028/4/21
第100回東日本旅客鉄道	1.981	200,000	238,410	2044/1/29
第102回東日本旅客鉄道	0.63	100,000	101,142	2024/7/25
第163回東日本旅客鉄道	0.05	600,000	597,072	2026/4/15
第174回東日本旅客鉄道	0.001	700,000	697,935	2024/12/17
第73回西日本旅客鉄道	0.05	400,000	398,040	2026/4/22



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42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	113,439	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,367	2030/10/25
第83回東海旅客鉄道	0.001	400,000	399,516	2023/9/19
第2回東京地下鉄	2.36	500,000	523,700	2024/6/20
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	299,466	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	199,610	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	200,000	199,182	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	200,000	198,864	2026/3/23
第8回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	99,820	2024/9/18
第1回横浜高速鉄道	0.62	300,000	303,501	2026/2/25
第9回九州旅客鉄道	0.001	200,000	199,612	2024/12/9
第9回ソフトバンク	0.48	300,000	298,512	2027/12/3
第16回ソフトバンク	0.52	300,000	291,765	2031/10/10
第50回電源開発	0.415	200,000	201,148	2027/7/20
第57回電源開発	0.355	100,000	99,509	2028/7/20
第59回電源開発	0.414	300,000	299,400	2028/9/20
第64回電源開発	0.405	600,000	596,940	2029/4/20
第67回電源開発	0.24	200,000	196,092	2029/9/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,299	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	300,000	301,596	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	100,000	2030/7/24
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	200,922	2025/9/12
第25回東京電力パワーグリッド	1.02	100,000	101,609	2029/4/24
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	400,000	405,668	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	300,000	303,129	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	201,260	2027/1/27
第35回東京電力パワーグリッド	1.2	100,000	102,451	2030/4/23
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	400,000	402,004	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド	1.08	400,000	406,100	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	100,526	2026/10/8
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	200,000	199,356	2026/4/22
第47回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	195,730	2031/8/29
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	200,264	2027/4/26
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	0.18	200,000	199,298	2024/9/9
第13回広島ガス	0.405	200,000	199,122	2028/9/13
第7回ファーストリテイリング	0.405	100,000	100,347	2028/6/6
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	101,844	2025/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,201	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	200,000	199,172	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	500,000	494,090	2026/10/21
第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	1.258	200,000	202,646	2024/1/25
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	200,000	199,912	2023/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	98,391	2026/12/16
第1回サントンデール銀行（2019）	0.463	500,000	498,485	2024/12/5

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第17回ナショナル・オーストラリア銀行	% 0.44	千円 100,000	千円 100,100	2024/1/23
小 計		37,600,000	37,849,909	
合 計		643,660,157	664,651,823	

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 債券先物取引 10年国債標準物	百万円 597	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 664,651,823	% 99.4
コール・ローン等、その他	3,796,001	0.6
投資信託財産総額	668,447,824	100.0



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	668,447,824,593
コール・ローン等	1,826,580,669
公社債(評価額)	664,651,823,785
未収入金	774,297,500
未収利息	1,135,810,623
前払費用	51,352,016
差入委託証拠金	7,960,000
(B) 負債	1,693,617,081
未払金	4,964,400
未払解約金	1,688,652,428
未払利息	253
(C) 純資産総額(A-B)	666,754,207,512
元本	505,301,120,122
次期繰越損益金	161,453,087,390
(D) 受益権総口数	505,301,120,122口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,195円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 233,376,402,849円  
期中追加設定元本額 338,061,364,572円  
期中一部解約元本額 66,136,647,299円  
また、1口当たり純資産額は、期末13,195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)	132,821,900,949円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	80,608,730,907円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	49,039,170,647円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	37,303,791,268円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	22,488,923,721円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	12,587,972,410円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	12,181,739,242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)	11,975,398,538円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	11,448,244,609円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	10,053,277,239円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	8,123,809,275円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	7,846,043,338円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,744,612,215円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	6,405,791,117円
つみたて8資産均等バランス	5,712,464,887円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	4,692,511,185円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	4,602,602,433円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,419,966,792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)	4,300,357,035円
国内債券セレクション(ラップ向け)	4,297,241,132円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,267,658,124円
ラップ向けインデックスf 国内債券	4,199,720,600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)	4,129,355,212円

## ○損益の状況 (2021年5月13日~2022年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	3,558,039,908
受取利息	3,558,563,677
支払利息	△ 523,769
(B) 有価証券売買損益	△ 17,217,267,011
売買益	88,364,927
売買損	△ 17,305,631,938
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,624,700
取引益	7,910,500
取引損	△ 13,535,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 13,664,851,803
(E) 前期繰越損益金	80,795,488,319
(F) 追加信託差損益金	116,667,524,390
(G) 解約差損益金	△ 22,345,073,516
(H) 計(D+E+F+G)	161,453,087,390
次期繰越損益金(H)	161,453,087,390

(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>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,058,372,038円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,468,061,838円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	3,243,481,473円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	3,014,921,473円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,899,656,932円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	2,687,965,605円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,413,154,659円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,240,064,768円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	2,109,627,765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)	2,012,122,340円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	1,927,858,584円
つみたて4資産均等バランス	1,825,124,141円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1,815,785,887円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,666,793,821円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,540,080,866円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	1,535,428,719円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	1,449,641,249円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,383,210,986円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,223,727,192円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	905,977,226円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	875,561,368円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	788,469,826円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	732,480,950円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	708,480,827円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	701,866,500円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	481,939,883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)	470,894,297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)	465,944,536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)	464,649,283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)	464,386,656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)	464,386,656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)	464,041,874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)	459,282,676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)	459,088,162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)	436,099,602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)	432,299,569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)	426,375,402円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	390,689,148円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	257,816,621円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	233,069,692円
eMAXIS 最適化バランス (マイフワード)	212,736,610円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	194,552,846円
eMAXIS バランス (波乗り型)	193,760,387円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	158,782,787円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	105,076,539円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	89,536,855円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	80,245,393円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	74,780,973円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	69,278,086円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	56,243,620円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	42,139,087円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	28,604,113円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	27,674,720円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	27,349,665円

三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	16,917,380円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	16,879,532円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	12,163,581円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	10,389,033円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	8,375,940円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	8,235,518円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	6,815,181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)	3,352,099円
コアバランス	2,330,848円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	2,196,883円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,007,378円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	226,600円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	175,041円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	129,462円
合計	505,301,120,122円

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 《第14期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26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26日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847
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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス ( <small>係(日本、円ヘッジ・円ベース)</small> )		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月26日	円 13,500	% —	410.80	% —	97.2	—
1 月末	13,473	△ 0.2	409.98	△ 0.2	98.0	—
2 月末	13,189	△ 2.3	401.33	△ 2.3	98.6	—
3 月末	12,828	△ 5.0	390.67	△ 4.9	104.1	—
4 月末	12,541	△ 7.1	382.14	△ 7.0	101.4	—
5 月末	12,417	△ 8.0	378.13	△ 8.0	98.1	—
6 月末	12,077	△10.5	367.91	△10.4	103.7	—
7 月末	12,433	△ 7.9	378.91	△ 7.8	96.9	—
8 月末	12,007	△11.1	365.57	△11.0	100.9	—
9 月末	11,501	△14.8	350.26	△14.7	101.9	—
10 月末	11,479	△15.0	349.59	△14.9	101.3	—
11 月末	11,643	△13.8	354.67	△13.7	95.3	—
12 月末	11,424	△15.4	347.74	△15.4	95.5	—
(期 末) 2023年 1 月26日	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—

(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13.5%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(−13.4%)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下落しました。
- ・ 先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

**● 当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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13.4%の下落になったため、カ  
イ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通り  
です。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

**○ 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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、12,176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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 1,545,378	千アメリカドル 1,722,070
	カナダ	千カナダドル 85,453	千カナダドル 96,285
	メキシコ	千メキシコペソ 374,997	千メキシコペソ 454,329
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	千ユーロ 190,677	千ユーロ 209,914
	イタリア	千ユーロ 210,931	千ユーロ 251,294
	フランス	千ユーロ 254,535	千ユーロ 291,093
	オランダ	千ユーロ 42,187	千ユーロ 51,855
	スペイン	千ユーロ 141,665	千ユーロ 167,024
	ベルギー	千ユーロ 48,965	千ユーロ 59,678
	オーストリア	千ユーロ 32,516	千ユーロ 38,486
	フィンランド	千ユーロ 12,026	千ユーロ 14,644
	アイルランド	千ユーロ 14,706	千ユーロ 19,873
	イギリス	千イギリスポンド 118,808	千イギリスポンド 133,082
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 64,113	千スウェーデンクローネ 81,239
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 43,484	千ノルウェークローネ 61,275
	デンマーク	千デンマーククローネ 67,446	千デンマーククローネ 89,438
	ポーランド	千ポーランドズロチ 43,781	千ポーランドズロチ 56,888
	オーストラリア	千オーストラリアドル 69,174	千オーストラリアドル 77,621
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 7,288	千ニュージーランドドル 2,328	
シンガポール	千シンガポールドル 18,357	千シンガポールドル 21,011	
マレーシア	千マレーシアリンギット 59,063	千マレーシアリンギット 71,839	
中国	千中国元 825,716	千中国元 457,077	
イスラエル	千イスラエルシェケル 33,033	千イスラエルシェケル 44,571	

(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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,257,563	1,926,468	59.1	3,176,280	1,929,758	60.8
為替直物取引	375,138	316,037	84.2	416,856	299,523	71.9

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

(2023年1月26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 950,740	千アメリカドル 865,341	千円 111,862,707	% 48.5	% —	% 21.6	% 17.4	% 9.5
カナダ	千カナダドル 50,760	千カナダドル 47,524	4,586,585	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 287,850	千メキシコペソ 272,699	1,875,272	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	114,220	108,292	15,278,931	6.6	—	3.6	2.1	1.0
イタリア	132,870	123,630	17,443,094	7.6	—	4.2	2.4	1.0
フランス	149,270	138,057	19,478,581	8.4	—	5.2	2.6	0.7
オランダ	26,900	24,806	3,499,905	1.5	—	1.0	0.5	0.1
スペイン	86,280	81,013	11,430,142	5.0	—	2.9	1.6	0.4
ベルギー	32,120	29,871	4,214,536	1.8	—	1.3	0.5	0.0
オーストリア	21,450	19,615	2,767,565	1.2	—	0.7	0.4	0.2
フィンランド	9,250	7,967	1,124,187	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	11,430	10,094	1,424,297	0.6	—	0.4	0.1	0.0
イギリス	千イギリスポンド 79,850	千イギリスポンド 69,652	11,172,242	4.8	—	3.5	0.9	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 40,000	千スウェーデンクローネ 38,834	492,035	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 36,000	千ノルウェークローネ 34,163	446,174	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 41,620	千デンマーククローネ 39,580	750,451	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 38,650	千ポーランドズロチ 33,577	1,004,681	0.4	—	0.1	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 44,690	千オーストラリアドル 41,229	3,787,753	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 5,600	千ニュージーランドドル 5,013	420,041	0.2	—	0.1	0.1	—
シンガポール	千シンガポールドル 10,790	千シンガポールドル 10,573	1,041,131	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 39,590	千マレーシアリンギット 40,266	1,222,547	0.5	—	0.3	0.2	—
中国	千中国元 462,000	千中国元 468,755	8,912,969	3.9	—	1.8	1.5	0.6
イスラエル	千イスラエルシェケル 22,060	千イスラエルシェケル 21,380	819,390	0.4	—	0.1	0.2	0.1
合 計	—	—	225,055,227	97.5	—	50.5	32.2	14.7

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.125 T-NOTE 240215	0.125	5,800	5,528	714,657	2024/2/15
	0.25 T-NOTE 240315	0.25	5,000	4,758	615,092	2024/3/15
	0.25 T-NOTE 240515	0.25	8,000	7,564	977,887	2024/5/15
	0.25 T-NOTE 240615	0.25	6,500	6,129	792,334	2024/6/15
	0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,200	4,765	615,972	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250630	0.25	4,000	3,662	473,471	2025/6/30
	0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,000	4,561	589,655	2025/7/31
	0.25 T-NOTE 250831	0.25	1,900	1,728	223,464	2025/8/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	5,050	4,590	593,359	2025/9/30
	0.25 T-NOTE 251031	0.25	4,000	3,621	468,179	2025/10/31
	0.375 T-NOTE 240415	0.375	3,500	3,325	429,875	2024/4/15
	0.375 T-NOTE 240715	0.375	1,000	942	121,826	2024/7/15
	0.375 T-NOTE 240815	0.375	3,600	3,383	437,322	2024/8/15
	0.375 T-NOTE 240915	0.375	5,300	4,970	642,497	2024/9/15
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,000	3,685	476,430	2025/4/30
	0.375 T-NOTE 251130	0.375	4,000	3,626	468,805	2025/11/30
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	2,000	1,812	234,266	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	6,600	5,955	769,846	2026/1/31
	0.375 T-NOTE 270731	0.375	4,000	3,468	448,425	2027/7/31
	0.375 T-NOTE 270930	0.375	4,200	3,626	468,853	2027/9/30
	0.5 T-NOTE 260228	0.5	2,700	2,440	315,503	2026/2/28
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	4,200	3,687	476,700	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270531	0.5	500	437	56,608	2027/5/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,000	874	113,020	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	3,850	3,351	433,223	2027/8/31
	0.5 T-NOTE 271031	0.5	5,200	4,505	582,401	2027/10/31
	0.625 T-NOTE 241015	0.625	4,200	3,946	510,145	2024/10/15
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	2,700	2,425	313,608	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	4,000	3,540	457,656	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271130	0.625	4,500	3,914	506,046	2027/11/30
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	5,480	4,757	615,062	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	7,800	6,406	828,228	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	8,900	7,276	940,581	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 241115	0.75	5,600	5,260	680,024	2024/11/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	4,900	4,459	576,526	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260430	0.75	5,300	4,811	621,943	2026/4/30
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	5,200	4,711	609,001	2026/5/31
	0.75 T-NOTE 260831	0.75	6,000	5,405	698,785	2026/8/31
	0.75 T-NOTE 280131	0.75	4,300	3,750	484,815	2028/1/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	5,000	4,542	587,244	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 260930	0.875	3,000	2,709	350,316	2026/9/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	7,250	6,018	778,065	2030/11/15
	1 T-NOTE 241215	1.0	6,000	5,653	730,840	2024/12/15
	1 T-NOTE 280731	1.0	3,090	2,698	348,842	2028/7/31
	1.125 T-BOND 400515	1.125	4,220	2,833	366,243	2040/5/15
	1.125 T-BOND 400815	1.125	2,800	1,869	241,648	2040/8/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日	
			額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円				
アメリカ	国債証券	1.125	T-NOTE 250115	4,500	4,242	548,470	2025/1/15
		1.125	T-NOTE 261031	4,400	4,005	517,819	2026/10/31
		1.125	T-NOTE 270228	1,900	1,721	222,577	2027/2/28
		1.125	T-NOTE 280229	4,400	3,906	504,977	2028/2/29
		1.125	T-NOTE 280831	2,900	2,545	329,091	2028/8/31
		1.125	T-NOTE 310215	11,590	9,797	1,266,480	2031/2/15
		1.25	T-BOND 500515	3,850	2,268	293,257	2050/5/15
		1.25	T-NOTE 261130	5,700	5,206	672,998	2026/11/30
		1.25	T-NOTE 261231	2,900	2,645	341,919	2026/12/31
		1.25	T-NOTE 280331	5,590	4,984	644,401	2028/3/31
		1.25	T-NOTE 280430	4,000	3,561	460,342	2028/4/30
		1.25	T-NOTE 280531	7,100	6,307	815,351	2028/5/31
		1.25	T-NOTE 280630	6,200	5,501	711,151	2028/6/30
		1.25	T-NOTE 280930	7,300	6,443	833,010	2028/9/30
		1.25	T-NOTE 310815	11,160	9,405	1,215,829	2031/8/15
		1.375	T-BOND 401115	4,100	2,857	369,369	2040/11/15
		1.375	T-BOND 500815	5,990	3,643	470,948	2050/8/15
		1.375	T-NOTE 250131	4,000	3,787	489,589	2025/1/31
		1.375	T-NOTE 260831	3,400	3,133	405,043	2026/8/31
		1.375	T-NOTE 281031	2,620	2,325	300,637	2028/10/31
		1.375	T-NOTE 281231	3,000	2,657	343,575	2028/12/31
		1.375	T-NOTE 311115	10,230	8,660	1,119,521	2031/11/15
		1.5	T-NOTE 240229	5,000	4,831	624,535	2024/2/29
		1.5	T-NOTE 240930	4,000	3,818	493,569	2024/9/30
		1.5	T-NOTE 241031	2,000	1,905	246,340	2024/10/31
		1.5	T-NOTE 241130	4,000	3,807	492,155	2024/11/30
		1.5	T-NOTE 250215	5,000	4,741	612,972	2025/2/15
		1.5	T-NOTE 260815	5,000	4,631	598,681	2026/8/15
		1.5	T-NOTE 270131	4,700	4,324	558,975	2027/1/31
		1.5	T-NOTE 281130	6,300	5,626	727,361	2028/11/30
		1.5	T-NOTE 300215	3,300	2,906	375,766	2030/2/15
		1.625	T-BOND 501115	4,500	2,922	377,819	2050/11/15
		1.625	T-NOTE 260215	2,120	1,986	256,731	2026/2/15
		1.625	T-NOTE 260515	3,500	3,269	422,594	2026/5/15
		1.625	T-NOTE 260930	1,950	1,812	234,283	2026/9/30
		1.625	T-NOTE 261031	4,000	3,711	479,773	2026/10/31
		1.625	T-NOTE 261130	2,200	2,040	263,747	2026/11/30
		1.625	T-NOTE 290815	3,400	3,038	392,784	2029/8/15
		1.625	T-NOTE 310515	7,280	6,358	821,905	2031/5/15
		1.75	T-BOND 410815	4,900	3,597	465,058	2041/8/15
		1.75	T-NOTE 240630	4,850	4,665	603,056	2024/6/30
		1.75	T-NOTE 240731	5,000	4,804	621,026	2024/7/31
		1.75	T-NOTE 250315	6,200	5,905	763,372	2025/3/15
		1.75	T-NOTE 261231	2,800	2,608	337,205	2026/12/31
		1.75	T-NOTE 290131	5,100	4,610	596,001	2029/1/31
		1.75	T-NOTE 291115	4,000	3,598	465,210	2029/11/15
		1.875	T-BOND 410215	6,820	5,158	666,898	2041/2/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.875 T-BOND 510215	1.875	7,300	5,049	652,810	2051/2/15
		1.875 T-BOND 511115	1.875	7,350	5,064	654,664	2051/11/15
		1.875 T-NOTE 260630	1.875	3,000	2,823	365,041	2026/6/30
		1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,700	2,537	327,964	2026/7/31
		1.875 T-NOTE 270228	1.875	5,700	5,317	687,361	2027/2/28
		1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,500	5,003	646,746	2029/2/28
		1.875 T-NOTE 320215	1.875	7,450	6,560	848,133	2032/2/15
		2 T-BOND 411115	2.0	5,890	4,507	582,738	2041/11/15
		2 T-BOND 500215	2.0	5,400	3,870	500,365	2050/2/15
		2 T-BOND 510815	2.0	5,440	3,872	500,597	2051/8/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	4,000	3,872	500,638	2024/4/30
		2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,598	594,391	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	5,150	4,905	634,091	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,410	182,304	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,900	2,821	364,749	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,500	4,371	565,104	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 240930	2.125	4,000	3,858	498,780	2024/9/30
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	4,000	3,851	497,830	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,100	4,885	631,592	2025/5/15
		2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,400	1,328	171,752	2026/5/31
		2.25 T-BOND 410515	2.25	4,140	3,325	429,856	2041/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	2,500	1,915	247,658	2046/8/15
		2.25 T-BOND 490815	2.25	4,800	3,646	471,383	2049/8/15
		2.25 T-BOND 520215	2.25	4,490	3,386	437,833	2052/2/15
		2.25 T-NOTE 240331	2.25	6,000	5,834	754,260	2024/3/31
		2.25 T-NOTE 240430	2.25	3,100	3,010	389,184	2024/4/30
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,300	2,220	287,054	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	3,000	2,896	374,479	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 241231	2.25	3,600	3,471	448,720	2024/12/31
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,400	6,123	791,617	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 260331	2.25	3,250	3,102	401,041	2026/3/31
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	3,981	514,663	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,000	3,776	488,246	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,200	3,955	511,375	2027/11/15
		2.375 T-BOND 420215	2.375	5,350	4,356	563,136	2042/2/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	2,560	1,997	258,216	2049/11/15
		2.375 T-BOND 510515	2.375	6,500	5,052	653,199	2051/5/15
		2.375 T-NOTE 240229	2.375	2,400	2,341	302,716	2024/2/29
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,600	4,458	576,303	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 260430	2.375	2,100	2,011	260,014	2026/4/30
2.375 T-NOTE 270515	2.375	5,800	5,511	712,497	2027/5/15		
2.375 T-NOTE 290331	2.375	2,650	2,479	320,552	2029/3/31		
2.375 T-NOTE 290515	2.375	4,100	3,834	495,660	2029/5/15		
2.5 T-BOND 450215	2.5	3,780	3,069	396,781	2045/2/15		
2.5 T-BOND 460215	2.5	1,900	1,532	198,169	2046/2/15		
2.5 T-BOND 460515	2.5	2,570	2,072	267,920	2046/5/15		
2.5 T-NOTE 240430	2.5	5,300	5,163	667,427	2024/4/30		

## 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				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-NOTE 240515	2.5	3,700	3,602	465,715	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 240531	2.5	5,000	4,866	629,080	2024/5/31
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,700	2,614	337,999	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,000	2,884	372,918	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	4,500	4,301	556,083	2027/3/31
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,900	3,784	489,245	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 250415	2.625	3,100	3,005	388,527	2025/4/15
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	4,000	3,868	500,093	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	1,600	1,546	199,891	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 270531	2.625	4,900	4,705	608,271	2027/5/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	3,500	3,325	429,911	2029/2/15
	2.625 T-NOTE 290731	2.625	4,500	4,266	551,583	2029/7/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	300	258	33,430	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,900	2,495	322,545	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,820	1,534	198,354	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	3,400	2,866	370,517	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	8,000	7,839	1,013,367	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	5,000	4,864	628,827	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250515	2.75	4,000	3,887	502,496	2025/5/15
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	3,000	2,911	376,312	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	2,200	2,123	274,506	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 270731	2.75	6,000	5,788	748,276	2027/7/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,650	6,399	827,308	2028/2/15
	2.75 T-NOTE 290531	2.75	5,500	5,257	679,629	2029/5/31
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	8,300	7,838	1,013,258	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,070	2,688	347,561	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,800	1,557	201,400	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	200	172	22,335	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	3,000	2,597	335,735	2049/5/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	5,700	4,931	637,480	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 250615	2.875	6,800	6,628	856,819	2025/6/15
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	4,500	4,378	566,035	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	7,100	6,862	887,091	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,160	5,947	768,852	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 290430	2.875	4,500	4,333	560,173	2029/4/30
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	11,000	10,515	1,359,314	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,950	1,754	226,740	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	1,700	1,509	195,079	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	650	575	74,382	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,610	1,423	183,970	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,420	3,019	390,363	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,050	1,809	233,958	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,980	3,514	454,383	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	3,980	3,518	454,785	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	5,100	4,520	584,309	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	4,100	3,642	470,836	2052/8/15
	3 T-NOTE 240630	3.0	6,000	5,874	759,380	2024/6/30

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-NOTE 240731	3.0	6,000	5,873	759,319	2024/7/31
	3 T-NOTE 250715	3.0	4,100	4,005	517,833	2025/7/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	3,500	3,417	441,823	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,000	2,928	378,614	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	550	507	65,595	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,340	1,232	159,309	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,250	2,054	265,623	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,090	2,802	362,316	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	2,360	2,133	275,796	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	4,500	4,409	569,967	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	5,000	4,902	633,789	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	6,500	6,356	821,743	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	3,250	3,174	410,346	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	3,000	2,800	362,056	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 240831	3.25	4,500	4,421	571,512	2024/8/31
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	4,500	4,433	573,068	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	900	885	114,461	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	2,400	2,283	295,123	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,850	1,747	225,884	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,900	3,693	477,507	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	700	697	90,103	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	3,450	3,413	441,242	2025/9/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,100	1,082	139,914	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,300	1,276	164,959	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,900	1,923	248,587	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,210	2,212	285,954	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	910	943	121,913	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	2,980	3,022	390,686	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	1,500	1,531	197,957	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	3,060	3,126	404,157	2029/11/30
	4 T-BOND 421115	4.0	2,080	2,162	279,489	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	3,790	4,065	525,491	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	1,800	1,807	233,622	2025/12/15
	4 T-NOTE 291031	4.0	2,840	2,921	377,681	2029/10/31
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	1,700	1,738	224,767	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	2,400	2,455	317,483	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	4,740	5,004	646,919	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,500	1,634	211,299	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,410	1,530	197,799	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 240930	4.25	4,000	3,993	516,292	2024/9/30
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	1,000	1,008	130,350	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	390	430	55,632	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,680	1,855	239,824	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,260	292,156	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,580	1,742	225,253	2041/5/15
	4.375 T-NOTE 241031	4.375	5,000	5,005	647,056	2024/10/31
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,005	129,924	2036/2/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	4.5 T-BOND 390815	4.5	900	1,009	130,490	2039/8/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,260	1,455	188,113	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	440	515	66,630	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	1,000	1,087	140,626	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	520	588	76,116	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,100	1,168	151,056	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	800	888	114,896	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	660	775	100,282	2030/5/15
小 計					111,862,707	
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	1,097	105,949	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,500	2,325	224,450	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	3,800	3,197	308,569	2030/12/1
	0.75 CAN GOVT 240201	0.75	500	482	46,555	2024/2/1
	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	1,750	1,665	160,731	2024/10/1
	1 CAN GOVT 260901	1.0	1,300	1,210	116,834	2026/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	600	555	53,632	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	850	811	78,358	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	3,200	2,994	288,992	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	1,870	1,684	162,580	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 240501	1.5	1,500	1,453	140,250	2024/5/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	958	92,541	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,150	1,094	105,635	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,350	2,127	205,314	2031/6/1
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	3,300	2,968	286,519	2031/12/1
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,180	1,660	160,219	2053/12/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,000	962	92,862	2028/6/1
	2 CAN GOVT 320601	2.0	2,250	2,103	203,022	2032/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	3,410	2,786	268,892	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,600	1,561	150,702	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	700	679	65,622	2029/6/1
	2.25 CAN GOVT 291201	2.25	1,000	969	93,586	2029/12/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	981	94,676	2024/6/1
	2.5 CAN GOVT 321201	2.5	1,300	1,266	122,216	2032/12/1
	2.75 CAN GOVT 240801	2.75	2,000	1,967	189,845	2024/8/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	970	935	90,319	2048/12/1
	2.75 CANADA GOWER 641201	2.75	870	831	80,236	2064/12/1
	3 CAN GOVT 241101	3.0	2,000	1,976	190,744	2024/11/1
	3.5 CAN GOVT 280301	3.5	100	103	9,941	2028/3/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	960	1,045	100,903	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	740	847	81,814	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	300	371	35,847	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	600	703	67,874	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	910	1,143	110,337	2033/6/1
小 計					4,586,585	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	26,750	26,888	184,905	2024/12/5



## 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		
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,000	3,340	22,974	2036/11/20	
		5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	23,000	20,913	143,817	2025/3/6	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	20,000	17,662	121,461	2027/3/4	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	41,350	37,605	258,602	2026/3/5	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	9,750	9,305	63,994	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	31,000	29,489	202,791	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,132	69,674	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	23,600	21,453	147,528	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	18,000	17,410	119,727	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	16,500	15,291	105,153	2047/11/7	
		8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	6,000	5,567	38,286	2053/7/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	32,900	32,756	225,254	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,200	24,881	171,100	2038/11/18	
小	計					1,875,272		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,700	1,573	221,976	2026/8/15
			0 BUND 271115	—	2,150	1,941	273,995	2027/11/15
			0 BUND 281115	—	1,180	1,045	147,576	2028/11/15
			0 BUND 290815	—	2,300	2,008	283,439	2029/8/15
			0 BUND 300215	—	3,000	2,596	366,352	2030/2/15
			0 BUND 300815	—	2,250	1,928	272,045	2030/8/15
			0 BUND 300815	—	1,200	1,030	145,404	2030/8/15
			0 BUND 310215	—	2,070	1,755	247,683	2031/2/15
			0 BUND 310815	—	2,100	1,761	248,593	2031/8/15
			0 BUND 310815	—	850	713	100,721	2031/8/15
			0 BUND 320215	—	2,050	1,698	239,701	2032/2/15
			0 BUND 350515	—	1,920	1,465	206,752	2035/5/15
			0 BUND 360515	—	2,800	2,087	294,474	2036/5/15
			0 BUND 500815	—	2,650	1,513	213,484	2050/8/15
			0 BUND 500815	—	950	544	76,825	2050/8/15
			0 BUND 520815	—	2,050	1,126	159,004	2052/8/15
			0 OBL 240405	—	2,200	2,135	301,289	2024/4/5
			0 OBL 241018	—	3,500	3,353	473,151	2024/10/18
			0 OBL 250411	—	3,000	2,846	401,573	2025/4/11
			0 OBL 251010	—	1,200	1,127	159,058	2025/10/10
			0 OBL 260410	—	3,200	2,979	420,443	2026/4/10
			0 OBL 261009	—	1,750	1,612	227,564	2026/10/9
			0 OBL 270416	—	2,000	1,824	257,418	2027/4/16
			0.2 SCHATS 240614	0.2	1,000	968	136,662	2024/6/14
			0.25 BUND 270215	0.25	2,300	2,130	300,612	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	2,620	2,367	334,074	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	3,470	3,110	438,867	2029/2/15
			0.4 SCHATS 240913	0.4	2,000	1,932	272,676	2024/9/13
			0.5 BUND 250215	0.5	3,150	3,030	427,512	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	3,450	3,272	461,708	2026/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	3,260	3,030	427,503	2027/8/15
			0.5 BUND 280215	0.5	2,000	1,845	260,445	2028/2/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 BUND 240815	1.0	2,500	2,443	344,805	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	3,200	3,092	436,285	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	980	822	116,094	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,480	2,067	291,730	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	961	135,643	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	963	136,002	2027/10/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,500	2,467	348,128	2024/5/15
		1.7 BUND 320815	1.7	2,700	2,603	367,369	2032/8/15
		1.75 BUND 240215	1.75	3,000	2,974	419,698	2024/2/15
		1.8 BUND 530815	1.8	450	417	58,876	2053/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	1,000	998	140,852	2029/11/15
		2.5 BUND 440704	2.5	2,430	2,565	361,997	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,100	3,307	466,703	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,030	2,359	332,890	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,070	2,508	353,910	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,970	2,515	354,877	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,300	1,473	207,842	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,820	2,294	323,754	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	980	1,331	187,795	2040/7/4
5.5 BUND 310104	5.5	2,170	2,702	381,232	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	1,850	2,149	303,311	2028/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	1,300	1,645	232,192	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,070	1,263	178,336	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240130	—	3,000	2,911	410,852	2024/1/30
		0 ITALY GOVT 240415	—	3,000	2,894	408,344	2024/4/15
		0 ITALY GOVT 241215	—	1,300	1,230	173,553	2024/12/15
		0 ITALY GOVT 260801	—	2,200	1,970	278,037	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,400	1,193	168,420	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,200	1,138	160,631	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,500	1,249	176,295	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,000	1,850	261,018	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	1,400	1,196	168,876	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,230	1,721	242,838	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	1,300	1,188	167,622	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	1,600	1,282	181,004	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	2,250	2,027	286,021	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	1,150	944	133,234	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,100	1,653	233,301	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,170	1,684	237,705	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,850	1,244	175,561	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	2,300	2,109	297,655	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	200	190	26,935	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,200	2,049	289,096	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	1,200	1,028	145,092	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,100	2,045	288,532	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,300	1,257	177,450	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,420	1,048	147,901	2036/3/1

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	3,280	3,171	447,432	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	1,640	1,025	144,649	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,550	2,425	342,261	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	1,831	258,418	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,240	1,037	146,334	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	1,050	644	90,891	2051/9/1
		1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	2,000	1,965	277,287	2024/7/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,430	1,010	142,618	2041/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,000	1,970	278,068	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	1,600	1,555	219,502	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,800	2,718	383,557	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	2,550	2,393	337,725	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	2,250	2,136	301,479	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,400	1,351	190,696	2026/7/15
		2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	1,050	702	99,123	2052/9/1
		2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	170	105	14,908	2072/3/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	400	383	54,152	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,660	1,349	190,389	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,500	2,160	304,836	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,460	1,072	151,292	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,500	1,488	210,054	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,150	1,132	159,846	2025/11/15
		2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	1,440	1,274	179,842	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	1,500	1,451	204,820	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,650	1,308	184,586	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,260	1,219	172,054	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	2,120	2,024	285,606	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	980	723	102,065	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,910	1,654	233,368	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,250	2,182	307,911	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,570	1,365	192,611	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	780	699	98,692	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,260	1,098	154,930	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,970	1,823	257,315	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,780	1,600	225,860	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	1,400	1,412	199,352	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,450	3,434	484,526	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,416	199,846	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	900	857	121,010	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	550	543	76,679	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,190	2,174	306,785	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,700	1,767	249,444	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,800	1,921	271,124	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,650	1,777	250,807	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,150	2,237	315,653	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,420	1,536	216,853	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,820	1,998	281,917	2039/8/1

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,420	1,563	220,633	2040/9/1	
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,980	3,298	465,412	2029/11/1	
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,500	1,713	241,743	2033/2/1	
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,270	3,808	537,284	2031/5/1	
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,720	1,965	277,266	2027/11/1	
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	900	1,031	145,576	2026/11/1	
		フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	2,500	2,430	342,922
0 O. A. T 240325	—			2,000	1,940	273,758	2024/3/25	
0 O. A. T 250225	—			1,250	1,184	167,076	2025/2/25	
0 O. A. T 250325	—			5,300	5,011	707,053	2025/3/25	
0 O. A. T 260225	—			4,200	3,892	549,188	2026/2/25	
0 O. A. T 270225	—			2,200	1,995	281,495	2027/2/25	
0 O. A. T 291125	—			4,800	4,074	574,818	2029/11/25	
0 O. A. T 301125	—			4,500	3,723	525,282	2030/11/25	
0 O. A. T 311125	—			3,450	2,772	391,121	2031/11/25	
0 O. A. T 320525	—			4,250	3,357	473,696	2032/5/25	
0.25 O. A. T 261125	0.25			4,450	4,099	578,389	2026/11/25	
0.5 O. A. T 250525	0.5			2,400	2,289	322,994	2025/5/25	
0.5 O. A. T 260525	0.5			5,100	4,785	675,125	2026/5/25	
0.5 O. A. T 290525	0.5			3,980	3,534	498,741	2029/5/25	
0.5 O. A. T 400525	0.5			2,560	1,727	243,727	2040/5/25	
0.5 O. A. T 440625	0.5			1,060	662	93,419	2044/6/25	
0.5 O. A. T 720525	0.5			1,160	490	69,240	2072/5/25	
0.75 O. A. T 280225	0.75			3,770	3,466	489,020	2028/2/25	
0.75 O. A. T 280525	0.75			4,170	3,821	539,176	2028/5/25	
0.75 O. A. T 281125	0.75			4,520	4,112	580,226	2028/11/25	
0.75 O. A. T 520525	0.75			2,340	1,371	193,459	2052/5/25	
0.75 O. A. T 530525	0.75			2,830	1,617	228,245	2053/5/25	
1 O. A. T 251125	1.0			4,300	4,127	582,374	2025/11/25	
1 O. A. T 270525	1.0			4,500	4,238	597,953	2027/5/25	
1.25 O. A. T 340525	1.25			4,700	4,026	568,057	2034/5/25	
1.25 O. A. T 360525	1.25			4,360	3,602	508,312	2036/5/25	
1.25 O. A. T 380525	1.25			600	478	67,542	2038/5/25	
1.5 O. A. T 310525	1.5			4,690	4,362	615,475	2031/5/25	
1.5 O. A. T 500525	1.5			3,410	2,517	355,182	2050/5/25	
1.75 O. A. T 241125	1.75			3,700	3,644	514,166	2024/11/25	
1.75 O. A. T 390625	1.75			2,740	2,353	332,119	2039/6/25	
1.75 O. A. T 660525	1.75			860	639	90,245	2066/5/25	
2 O. A. T 321125	2.0			3,300	3,130	441,720	2032/11/25	
2 O. A. T 480525	2.0			2,360	1,978	279,094	2048/5/25	
2.25 O. A. T 240525	2.25			3,800	3,781	533,485	2024/5/25	
2.5 O. A. T 300525	2.5			4,800	4,827	681,095	2030/5/25	
2.5 O. A. T 430525	2.5			650	606	85,544	2043/5/25	
2.75 O. A. T 271025	2.75			3,980	4,037	569,650	2027/10/25	
3.25 O. A. T 450525	3.25			2,750	2,894	408,433	2045/5/25	
3.5 O. A. T 260425	3.5			2,400	2,476	349,400	2026/4/25	
4 O. A. T 381025	4.0	2,070	2,351	331,771	2038/10/25			

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ	千円		
フランス	国債証券	4 O. A. T 550425	4.0	1,450	1,758	248,112	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	1,640	2,033	286,886	2060/4/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	3,010	3,669	517,730	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,250	1,500	211,662	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	3,690	4,337	611,945	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,970	2,505	353,450	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	3,500	3,820	538,990	2025/10/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	1,000	931	131,362	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	600	547	77,277	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,330	1,158	163,465	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	1,500	1,264	178,348	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	750	615	86,872	2031/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	930	644	90,948	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,520	807	113,994	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,133	301,028	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,360	1,192	168,319	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,550	1,455	205,296	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	1,320	1,108	156,347	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,640	1,199	169,181	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,750	1,637	230,998	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,100	1,013	142,957	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	900	893	126,029	2024/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	420	390	55,110	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,250	1,254	177,013	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,530	1,641	231,633	2047/1/15
3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,150	1,370	193,408	2042/1/15		
4 NETH GOVT 370115	4.0	1,650	1,940	273,717	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,400	1,606	226,592	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	1,300	1,255	177,069	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	2,000	1,896	267,581	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,346	331,107	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	3,700	3,413	481,677	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	900	808	114,022	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,100	1,832	258,506	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,500	1,986	280,312	2031/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 240730	0.25	1,200	1,158	163,402	2024/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	1,800	1,526	215,368	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	1,390	1,126	158,965	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,750	2,380	335,900	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	1,950	1,585	223,716	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,600	2,392	337,494	2027/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,450	1,027	144,911	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	900	591	83,393	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,470	832	117,467	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,100	1,474	208,092	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	2,630	2,334	329,332	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,900	1,810	255,468	2026/10/31

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,850	2,662	375,680	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,450	1,350	190,564	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,850	2,690	379,643	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,290	1,192	168,289	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	700	361	50,991	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,550	1,478	208,557	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,700	1,661	234,361	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	1,730	1,481	208,985	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,150	800	113,008	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,500	1,467	206,998	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,870	1,754	247,600	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,700	2,666	376,239	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,080	1,935	273,030	2033/7/30
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	1,500	1,430	201,784	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,390	1,209	170,627	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,204	310,995	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,620	1,481	209,087	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	700	691	97,550	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,160	1,124	158,641	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,500	2,531	357,163	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,590	1,745	246,239	2037/1/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,000	1,047	147,815	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,680	1,974	278,561	2041/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,430	1,713	241,690	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,100	1,236	174,446	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,450	204,622	2044/10/31
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,300	2,827	398,934	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,800	1,995	281,580	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,600	3,066	432,659	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	800	712	100,529	2027/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,370	1,150	162,327	2030/6/22
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	2,050	1,656	233,753	2032/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	600	390	55,073	2040/6/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	570	262	37,051	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,900	2,787	393,347	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,190	1,108	156,458	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	500	459	64,771	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,089	294,852	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,240	174,984	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,900	1,675	236,384	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	970	846	119,375	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	950	648	91,547	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	610	504	71,174	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	560	423	59,815	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,320	997	140,717	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,170	1,018	143,643	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	410	337	47,686	2066/6/22

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	2.25 BEL GOVT 570622	2.25	800	678	95,706	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	700	699	98,730	2024/6/22
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	500	484	68,374	2039/4/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,140	1,158	163,447	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	890	993	140,199	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	710	785	110,772	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,210	1,416	199,805	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,700	1,805	254,687	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,390	1,693	238,966	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,610	1,845	260,349	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	—	2,000	1,927	271,993	2024/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 250420	—	1,000	944	133,296	2025/4/20
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	200	172	24,393	2028/10/20
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,250	1,041	146,965	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,600	1,295	182,762	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	420	256	36,166	2040/10/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	400	284	40,206	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	540	498	70,299	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,150	1,018	143,629	2029/2/20
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	200	99	14,047	2071/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	800	752	106,122	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,150	1,054	148,831	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	740	461	65,089	2051/3/20
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	450	211	29,789	2120/6/30
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	500	428	60,452	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	400	387	54,702	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	900	698	98,577	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	310	207	29,221	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	680	669	94,481	2024/10/21
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	260	217	30,620	2049/5/23
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	500	492	69,444	2026/7/15
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	460	377	53,263	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	660	637	89,912	2034/5/23
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	630	661	93,375	2044/6/20		
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	400	494	69,727	2062/1/26		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	1,558	219,872	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,600	1,724	243,294	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,042	147,026	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	400	384	54,195	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 260915	—	420	384	54,209	2026/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	400	328	46,391	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	500	404	57,040	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	300	212	30,025	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	580	298	42,058	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	270	175	24,691	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	250	235	33,272	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,100	1,004	141,730	2027/9/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	480	420	59,287	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	610	400	56,489	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	280	241	34,097	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	480	67,741	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	236	33,360	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	300	286	40,444	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	160	125	17,735	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	900	810	114,403	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	480	472	66,695	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	598	84,391	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	450	467	65,923	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	750	602	84,987	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	700	637	89,975	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	1,200	1,010	142,637	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	700	567	80,090	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	550	415	58,613	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	430	287	40,493	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	900	833	117,536	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	550	526	74,334	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	820	756	106,697	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	554	78,215	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	960	718	101,378	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	280	242	34,184	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	620	525	74,211	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	540	538	76,007	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	606	85,515	2024/3/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,200	1,271	179,418	2025/3/13
小 計						76,661,241	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	3,200	3,093	496,246	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,100	1,007	161,654	2026/1/30
		0.125 GILT 280131	0.125	1,550	1,331	213,584	2028/1/31
		0.25 GILT 250131	0.25	150	140	22,553	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	2,550	1,983	318,094	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	2,000	1,802	289,135	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	1,670	1,348	216,223	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	1,830	1,556	249,604	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	1,720	662	106,285	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,050	1,933	310,126	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	1,900	1,350	216,650	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,330	642	103,051	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,630	1,404	225,280	2029/10/22
		0.875 GILT 330731	0.875	900	700	112,411	2033/7/31
		0.875 GILT 460131	0.875	1,810	1,026	164,700	2046/1/31
		1 GILT 240422	1.0	2,000	1,942	311,618	2024/4/22
		1 GILT 320131	1.0	2,950	2,422	388,631	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	800	556	89,192	2039/1/31



## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		利 率	当 期		末		償還年月日
			額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド			
国債証券	1.125 GILT 731022	1.125	910	431	69,170		2073/10/22
	1.25 GILT 270722	1.25	1,300	1,198	192,183		2027/7/22
	1.25 GILT 411022	1.25	2,520	1,697	272,328		2041/10/22
	1.25 GILT 510731	1.25	1,720	1,001	160,577		2051/7/31
	1.5 GILT 260722	1.5	1,370	1,296	207,899		2026/7/22
	1.5 GILT 470722	1.5	1,860	1,210	194,221		2047/7/22
	1.5 GILT 530731	1.5	1,200	735	118,028		2053/7/31
	1.625 GILT 281022	1.625	1,000	921	147,728		2028/10/22
	1.625 GILT 541022	1.625	1,340	844	135,497		2054/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	1,570	930	149,245		2071/10/22
	1.75 GILT 370907	1.75	1,500	1,185	190,122		2037/9/7
	1.75 GILT 490122	1.75	440	300	48,252		2049/1/22
	1.75 GILT 570722	1.75	1,180	763	122,458		2057/7/22
	2 GILT 250907	2.0	1,200	1,165	186,907		2025/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	1,030	812	130,358		2065/7/22
	2.75 GILT 240907	2.75	1,050	1,039	166,717		2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	1,900	1,774	284,595		2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	1,310	1,269	203,568		2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,130	1,138	182,582		2068/7/22
	3.75 GILT 380129	3.75	500	505	81,127		2038/1/29
	3.75 GILT 520722	3.75	1,270	1,296	207,914		2052/7/22
	4 GILT 600122	4.0	1,320	1,446	231,958		2060/1/22
	4.125 GILT 270129	4.125	1,730	1,778	285,289		2027/1/29
	4.25 GILT 271207	4.25	1,160	1,215	195,002		2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	1,680	1,813	290,854		2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,610	1,730	277,577		2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,070	1,146	183,894		2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	910	976	156,553		2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,230	1,334	214,020		2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,280	1,402	224,927		2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,130	1,268	203,523		2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,480	1,633	261,957		2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,950	2,170	348,128		2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,184	190,017		2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,340	1,519	243,694		2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	1,830	1,897	304,435		2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	620	709	113,871		2028/12/7
小	計				11,172,242		
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	5,300	4,557	57,743		2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	8,500	7,927	100,447		2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,200	5,711	72,370		2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	5,877	74,472		2026/11/12
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	3,100	3,182	40,317		2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,199	91,213		2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,550	4,378	55,470		2039/3/30
小	計				492,035		

## 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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,353	43,800	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	5,400	4,893	63,909	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,743	35,833	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	6,300	6,147	80,289	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,091	53,429	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,500	3,292	42,993	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,650	2,556	33,385	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	2,800	2,642	34,514	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,450	4,442	58,018	2024/3/14
小計					446,174	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	3,500	3,338	63,289	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	7,700	6,259	118,680	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,000	2,895	54,897	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,900	6,315	119,733	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	3,300	2,916	55,289	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,500	5,385	102,104	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,720	12,471	236,455	2039/11/15
小計					750,451	
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	3,257	97,479	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	1,000	896	26,822	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,400	3,164	94,699	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	1,800	1,279	38,284	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,761	112,537	2024/10/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	2,879	86,146	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,500	2,234	66,850	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,300	2,004	59,985	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,189	95,433	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	3,000	2,501	74,851	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,331	99,693	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,674	109,957	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,401	41,937	2029/4/25
小計					1,004,681	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	1,700	1,614	148,322	2024/11/21
	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	1,450	1,338	122,986	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	2,000	1,817	166,984	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	1,100	916	84,193	2030/12/21
	1 AUST GOVT 311121	1.0	3,500	2,846	261,496	2031/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,610	2,148	197,390	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,550	2,188	201,082	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	1,900	1,625	149,309	2032/11/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,450	919	84,467	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,400	1,332	122,454	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	1,770	1,669	153,392	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,000	994	91,357	2024/4/21

## 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		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
国債証券	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,500	1,469	134,968	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,650	1,605	147,452	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,280	1,233	113,347	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,400	1,275	117,208	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	890	757	69,548	2041/5/21
	3 AUST GOVT 331121	3.0	1,700	1,618	148,668	2033/11/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,380	1,181	108,536	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,200	2,207	202,837	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,800	1,795	164,908	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,150	1,068	98,142	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 340521	3.75	1,100	1,119	102,859	2034/5/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	960	961	88,323	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,950	3,049	280,193	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,400	1,518	139,548	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	900	955	87,769	2027/4/21
小 計					3,787,753	
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	1.75 NZ GOVT 410515	1.75	300	201	16,882	2041/5/15
	2 NZ GOVT 320515	2.0	800	674	56,536	2032/5/15
	2.75 NZ GOVT 250415	2.75	900	868	72,721	2025/4/15
	2.75 NZ GOVT 370415	2.75	700	586	49,114	2037/4/15
	2.75 NZ GOVT 510515	2.75	600	448	37,545	2051/5/15
	3 NZ GOVT 290420	3.0	800	755	63,314	2029/4/20
	3.5 NZ GOVT 330414	3.5	700	666	55,799	2033/4/14
	4.5 NZ GOVT 270415	4.5	800	813	68,127	2027/4/15
小 計					420,041	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	1.25	550	520	51,261	2026/11/1
	1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	100	91	8,988	2031/7/1
	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	790	676	66,589	2050/3/1
	1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	460	399	39,292	2051/10/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,000	976	96,195	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	500	467	46,046	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	800	789	77,736	2025/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	250	237	23,398	2039/7/1
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	250	248	24,432	2028/5/1
	2.625 SINGAPORGOV 320801	2.625	400	394	38,815	2032/8/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	700	705	69,440	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	400	405	39,900	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	953	93,920	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	800	803	79,091	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	1,500	1,497	147,491	2024/9/1
	3 SINGAPORGOVT 720801	3.0	170	189	18,656	2072/8/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	632	62,242	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	570	585	57,632	2027/3/1
小 計					1,041,131	

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,500	1,385	42,060	2031/4/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	1,000	30,387	2027/5/31
	3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	2,300	2,271	68,957	2032/7/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,300	2,318	70,385	2028/6/15
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	800	762	23,146	2040/5/22
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	1,000	992	30,123	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,950	1,941	58,952	2033/4/15
	3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	3,000	3,034	92,126	2025/3/14
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,500	2,527	76,740	2029/8/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,500	1,526	46,357	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,500	1,523	46,241	2026/11/30
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,500	1,525	46,322	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,043	92,416	2025/9/15
	4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	3,100	2,976	90,358	2050/6/15
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	1,200	1,237	37,586	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	3,000	3,092	93,879	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	524	15,936	2030/4/15
	4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	2,500	2,680	81,389	2042/10/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,200	1,275	38,740	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	2,900	3,151	95,694	2037/4/7
	4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	700	773	23,479	2038/6/8
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	640	700	21,263	2048/7/6
小	計				1,222,547	
中国			千中国元	千中国元		
国債証券	1.99 CHINA GOVT 240915	1.99	10,000	9,944	189,082	2024/9/15
	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	4,000	3,962	75,344	2025/4/9
	2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	9,000	8,958	170,345	2025/5/25
	2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	10,000	9,960	189,389	2025/2/24
	2.28 CHINA GOVT 240317	2.28	10,000	10,008	190,295	2024/3/17
	2.28 CHINA GOVT 251125	2.28	12,000	11,920	226,650	2025/11/25
	2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	10,000	9,879	187,858	2027/1/20
	2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	4,000	3,948	75,071	2027/10/15
	2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	10,000	10,009	190,330	2024/9/2
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	8,000	7,923	150,666	2027/4/15
	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	8,000	7,920	150,594	2027/7/25
	2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	5,000	4,868	92,567	2032/9/1
	2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	5,000	4,921	93,574	2029/9/25
	2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	10,000	9,870	187,673	2030/5/21
	2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	11,000	11,018	209,514	2026/8/12
	2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	7,000	6,856	130,366	2032/8/15
	2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,028	95,614	2026/8/4
	2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	15,000	14,911	283,520	2029/6/15
	2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	9,000	8,854	168,368	2032/2/17
	2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	9,000	8,870	168,672	2032/5/15
	2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	8,000	7,989	151,919	2029/3/24
	2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	7,000	6,935	131,871	2032/11/15
	2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	15,000	15,114	287,392	2024/4/8

## 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	
中国			%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	2.85 CHINA GOVT 270604		2.85	15,000	15,082	286,783	2027/6/4
	2.89 CHINA GOVT 311118		2.89	5,000	4,997	95,029	2031/11/18
	2.9 CHINA GOVT 260505		2.9	2,000	2,018	38,385	2026/5/5
	2.91 CHINA GOVT 281014		2.91	8,000	8,056	153,185	2028/10/14
	2.94 CHINA GOVT 241017		2.94	9,000	9,096	172,959	2024/10/17
	2.99 CHINA GOVT 251015		2.99	3,000	3,039	57,796	2025/10/15
	3.01 CHINA GOVT 280513		3.01	14,000	14,185	269,715	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022		3.02	7,000	7,102	135,047	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527		3.02	11,000	11,130	211,630	2031/5/27
	3.03 CHINA GOVT 260311		3.03	11,000	11,165	212,308	2026/3/11
	3.12 CHINA GOVT 261205		3.12	10,000	10,190	193,762	2026/12/5
	3.12 CHINA GOVT 521025		3.12	3,000	2,915	55,440	2052/10/25
	3.13 CHINA GOVT 291121		3.13	10,000	10,232	194,568	2029/11/21
	3.22 CHINA GOVT 251206		3.22	9,000	9,193	174,797	2025/12/6
	3.25 CHINA GOVT 260606		3.25	7,000	7,158	136,107	2026/6/6
	3.25 CHINA GOVT 281122		3.25	8,000	8,233	156,543	2028/11/22
	3.27 CHINA GOVT 301119		3.27	13,000	13,473	256,178	2030/11/19
	3.28 CHINA GOVT 271203		3.28	12,000	12,360	235,031	2027/12/3
	3.29 CHINA GOVT 290523		3.29	6,000	6,212	118,116	2029/5/23
	3.32 CHINA GOVT 520415		3.32	6,000	6,052	115,074	2052/4/15
	3.39 CHINA GOVT 500316		3.39	9,000	9,128	173,564	2050/3/16
	3.52 CHINA GOVT 270504		3.52	1,000	1,041	19,793	2027/5/4
	3.53 CHINA GOVT 511018		3.53	4,000	4,164	79,192	2051/10/18
	3.54 CHINA GOVT 280816		3.54	4,000	4,183	79,552	2028/8/16
	3.57 CHINA GOVT 240622		3.57	9,000	9,180	174,562	2024/6/22
	3.59 CHINA GOVT 270803		3.59	7,000	7,327	139,320	2027/8/3
	3.6 CHINA GOVT 250906		3.6	9,000	9,297	176,777	2025/9/6
	3.61 CHINA GOVT 250607		3.61	7,000	7,212	137,143	2025/6/7
	3.69 CHINA GOVT 240921		3.69	4,000	4,101	77,981	2024/9/21
	3.69 CHINA GOVT 280517		3.69	5,000	5,274	100,284	2028/5/17
	3.72 CHINA GOVT 510412		3.72	6,000	6,452	122,689	2051/4/12
	3.77 CHINA GOVT 250308		3.77	2,000	2,065	39,274	2025/3/8
	3.81 CHINA GOVT 500914		3.81	10,000	10,919	207,630	2050/9/14
	3.86 CHINA GOVT 490722		3.86	6,000	6,586	125,229	2049/7/22
	4.08 CHINA GOVT 481022		4.08	9,000	10,246	194,827	2048/10/22
小 計						8,912,969	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430		0.5	4,000	3,751	143,779	2025/4/30
	0.5 ISRAEL FIXED 260227		0.5	1,800	1,661	63,659	2026/2/27
	1 ISRAEL FIXED BO 300331		1.0	1,800	1,552	59,502	2030/3/31
	1.3 ISRAEL FIXED 320430		1.3	1,500	1,278	48,982	2032/4/30
	1.5 ISRAEL FIXED 370531		1.5	1,800	1,431	54,880	2037/5/31
	1.75 ISRAEL FIXED 250831		1.75	1,800	1,731	66,359	2025/8/31
	2 ISRAEL FIXED BO 270331		2.0	2,500	2,408	92,310	2027/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 240331		3.75	3,000	3,092	118,527	2024/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 470331		3.75	1,650	1,761	67,507	2047/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131		5.5	1,510	1,931	74,030	2042/1/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
イスラエル	%	千イスラエルシケル	千イスラエルシケル	千円	
国債証券	6.25	ISRAEL FIXED 261030			
小 計	6.25	700	778	29,849	2026/10/30
合 計				819,390	
				225,055,227	

(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

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 225,055,227	% 97.2
コール・ローン等、その他	6,443,939	2.8
投資信託財産総額	231,499,166	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（227,032,959千円）の投資信託財産総額（231,499,166千円）に対する比率は98.1%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=129.27円	1 カナダドル=96.51円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ユーロ=141.09円
1 イギリスポンド=160.40円	1 スウェーデンクローネ=12.67円	1 ノルウェークローネ=13.06円	1 デンマーククローネ=18.96円
1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 オーストラリアドル=91.87円	1 ニュージーランドドル=83.78円	1 シンガポールドル=98.47円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 中国元=19.0141円	1 イスラエルシケル=38.3249円	

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	453,943,495,513
コール・ローン等	1,956,314,371
公社債(評価額)	225,055,227,991
未収入金	225,260,171,381
未収利息	1,072,244,598
前払費用	599,537,172
(B) 負債	223,099,387,442
未払金	222,739,200,712
未払解約金	360,185,897
未払利息	833
(C) 純資産総額(A-B)	230,844,108,071
元本	197,648,585,205
次期繰越損益金	33,195,522,866
(D) 受益権総口数	197,648,585,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,680円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 207,797,445,119円  
期中追加設定元本額 295,149,205,041円  
期中一部解約元本額 305,298,064,955円  
また、1口当たり純資産額は、期末1.1680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)	90,390,214,009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)	16,938,050,283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)	11,836,613,756円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	11,450,242,548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)	10,221,600,661円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	9,817,843,855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)	8,049,330,980円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,379,885,493円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,139,379,769円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	3,938,003,291円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,708,138,293円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,424,810,611円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,292,590,386円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,280,758,521円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,269,914,309円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,002,113,906円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	1,973,203,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	823,298,571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)	801,899,314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)	767,455,615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)	764,138,227円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	472,626,962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)	379,989,610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)	376,017,480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)	374,936,978円

## ○損益の状況 (2022年1月27日~2023年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	4,842,008,862
受取利息	4,843,719,322
その他収益金	132,461
支払利息	△ 1,842,921
(B) 有価証券売買損益	△ 37,798,191,329
売買益	65,309,182,456
売買損	△ 103,107,373,785
(C) 保管費用等	△ 31,203,396
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 32,987,385,863
(E) 前期繰越損益金	72,724,250,082
(F) 追加信託差損益金	56,205,214,325
(G) 解約差損益金	△ 62,746,555,678
(H) 計(D+E+F+G)	33,195,522,866
次期繰越損益金(H)	33,195,522,866

- (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2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379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)	359,565,752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)	352,830,037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)	336,722,167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)	329,350,862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)	325,643,502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)	322,720,012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)	322,196,277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)	321,351,725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)	316,748,113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)	315,633,120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)	315,490,691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)	315,059,067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)	312,894,225円
e MAX I S 債券バランス (2資産均等型)	81,644,836円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	74,233,155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)	1,683,199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)	735,357円
合計	197,648,585,205円