

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。）	

運用報告書（全体版）



eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第9期（決算日：2024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9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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

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

○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	込み金	期騰落	中率	期騰落				中率
	円		円		%		%	%	百万円	
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
9期(2024年1月26日)	9,188		0		△2.7	9,568	△2.3	100.3	0.0	204

(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) 2023年1月26日	9,439	—	9,790	—	98.0	0.1
1月末	9,376	△0.7	9,727	△0.6	98.9	0.1
2月末	9,312	△1.3	9,662	△1.3	100.7	0.0
3月末	9,456	0.2	9,815	0.3	98.2	0.0
4月末	9,446	0.1	9,807	0.2	99.4	0.1
5月末	9,399	△0.4	9,762	△0.3	100.8	0.1
6月末	9,377	△0.7	9,743	△0.5	101.6	0.0
7月末	9,278	△1.7	9,644	△1.5	97.8	0.0
8月末	9,205	△2.5	9,571	△2.2	100.5	0.0
9月末	9,045	△4.2	9,407	△3.9	99.1	0.0
10月末	8,947	△5.2	9,308	△4.9	98.6	0.0
11月末	9,167	△2.9	9,542	△2.5	99.3	0.0
12月末	9,311	△1.4	9,692	△1.0	97.4	0.0
(期 末) 2024年1月26日	9,188	△2.7	9,568	△2.3	100.3	0.0

(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9期：2023年1月27日～2024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9期首	9,439円
第9期末	9,188円
既払分配金	0円
騰落率	-2.7%

※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2.7%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-2.3%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

国内債券市況が下落したことやヘッジコストの影響などが、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	-4.1%	50.1%
日本債券インデックスマザーファンド	-0.4%	49.4%

第9期：2023年1月27日～2024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、期間の前半は欧米金融不安などを背景に上昇しました。期間の後半は、日銀による度重なる金融政策の柔軟化などから下落し、その後、欧米中銀の利下げ観測が高まったことなどを背景に国内債券市況は反発する場面もありましたが、期間を通して見ると下落しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により下落した後、中銀による利上げの打ち止め観測等を背景とした金利低下により反発し、期間の初めとの比較では上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして国内債券、日本を除く先進国債券の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動するよう運用を行いました。

当期間の資産配分は、国内債券およびヘッジ付先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%となるように調整を行いました。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

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

ベンチマーク（NOMURA-BPI総

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいますが。

▶ 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）

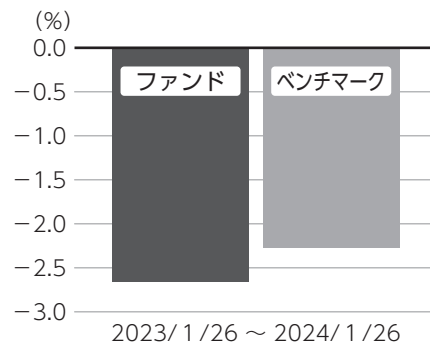
基準価額の騰落率は2.7%の下落となり、ベンチマークの2.3%の下落を0.4%下回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

日本債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%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：ありません。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第9期 2023年1月27日～2024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	981

(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。

2023年1月27日～2024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	41	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）	(18)	(0.193)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(18)	(0.192)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(5)	(0.055)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	1	0.010	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.006)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	42	0.450	

期中の平均基準価額は、9,274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。

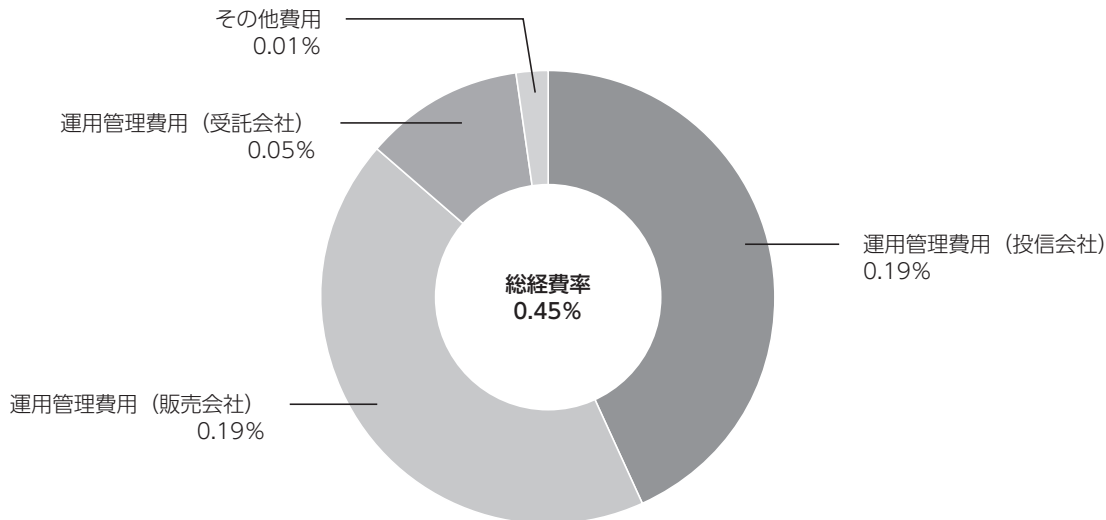
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2023年1月27日～2024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	29,786	33,568	20,012	22,437
日本債券インデックスマザーファンド	23,882	30,869	18,262	23,436

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	3,607,697	2,724,726	75.5%	3,665,108	2,725,544	74.4%
為替直物取引	161,779	74,591	46.1%	100,088	67,673	67.6%

平均保有割合 0.0%

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	308,889	62,403	20.2%	203,306	47,015	23.1%

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 600	百万円 2,399	百万円 1,931

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 12,400

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

(2024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	81,644	91,419	102,380
日本債券インデックスマザーファンド	73,455	79,075	100,797

○投資信託財産の構成

(2024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	102,380	49.4
日本債券インデックスマザーファンド	100,797	48.7
コール・ローン等、その他	3,974	1.9
投資信託財産総額	207,151	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（330,936,094千円）の投資信託財産総額（332,718,105千円）に対する比率は99.5%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=147.70円	1 カナダドル=109.60円	1 メキシコペソ=8.5875円	1 ユーロ=160.17円
1 イギリスポンド=187.62円	1 スウェーデンクローネ=14.13円	1 ノルウェークローネ=14.16円	1 デンマーククローネ=21.48円
1 ボーランドズロチ=36.6078円	1 オーストラリアドル=97.23円	1 ニューージーランドドル=90.20円	1 シンガポールドル=110.17円
1 マレーシアリンギット=31.1638円	1 中国元=20.5768円	1 イスラエルシェケル=39.8548円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	207,151,151
コール・ローン等	1,754,869
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	102,380,530
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	100,797,574
未収入金	2,218,178
(B) 負債	2,957,698
未払解約金	2,510,362
未払信託報酬	443,407
その他未払費用	3,929
(C) 純資産総額(A-B)	204,193,453
元本	222,237,551
次期繰越損益金	△ 18,044,098
(D) 受益権総口数	222,237,551口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,188円

<注記事項>

- ①期首元本額 201,598,101円
 期中追加設定元本額 90,613,830円
 期中一部解約元本額 69,974,380円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9188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18,044,098円です。

③分配金の計算過程

項 目	2023年1月27日～ 2024年1月26日
費用控除後の配当等収益額	2,209,340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	16,114,837円
分配準備積立金額	3,490,919円
当ファンドの分配対象収益額	21,815,096円
1万口当たり収益分配対象額	981円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2023年1月27日～2024年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 305
受取利息	7
支払利息	△ 312
(B) 有価証券売買損益	△ 3,497,623
売買益	1,064,282
売買損	△ 4,561,905
(C) 信託報酬等	△ 866,721
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,364,649
(E) 前期繰越損益金	△14,187,336
(F) 追加信託差損益金	507,887
(配当等相当額)	(16,052,091)
(売買損益相当額)	(△15,544,204)
(G) 計(D+E+F)	△18,044,098
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△18,044,098
追加信託差損益金	507,887
(配当等相当額)	(16,114,837)
(売買損益相当額)	(△15,606,950)
分配準備積立金	5,700,259
繰越損益金	△24,252,244

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

【お 知 ら せ】

- ①委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)
- ②新NISA（成長投資枠）の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年10月26日)

日本債券インデックスマザーファンド

《第22期》決算日2023年5月12日

[計算期間：2022年5月13日～2023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22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22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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
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
22期(2023年5月12日)	13,084	△0.8%	375.76	△0.9%	99.6%	0.1%	723,477

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2022年 5月12日	13,195	—	379.29	—	99.7	0.1
5月末	13,204	0.1	379.54	0.1	99.7	0.1
6月末	13,083	△0.8	376.08	△0.8	99.8	0.1
7月末	13,169	△0.2	378.55	△0.2	100.3	0.1
8月末	13,139	△0.4	377.67	△0.4	99.9	0.1
9月末	13,000	△1.5	373.60	△1.5	99.2	0.1
10月末	12,987	△1.6	373.25	△1.6	100.6	0.1
11月末	12,924	△2.1	371.33	△2.1	99.9	0.1
12月末	12,755	△3.3	366.60	△3.3	98.9	0.1
2023年 1月末	12,719	△3.6	365.59	△3.6	100.5	0.1
2月末	12,862	△2.5	369.57	△2.6	100.1	0.1
3月末	13,043	△1.2	374.74	△1.2	99.4	0.1
4月末	13,081	△0.9	375.61	△1.0	100.0	0.1
(期 末) 2023年 5月12日	13,084	△0.8	375.76	△0.9	99.6	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

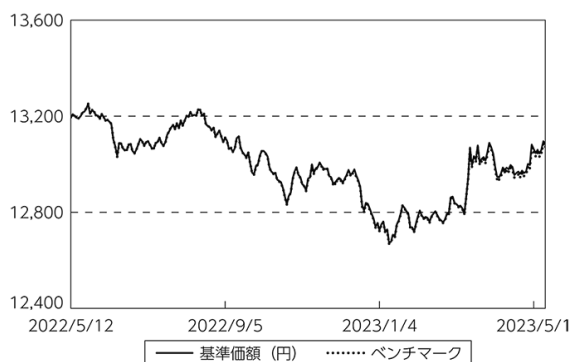
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.8%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(−0.9%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 国内債券市況

- ・ 国内債券市況は下落しました。
- ・ 国内債券市況は、期間の前半は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）の修正を決定したことなどにより国内債券市況は下落しましたが、期間の終わりにかけては米欧金融不安などを背景に反発しました。期間を通じてみると国内債券市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
 - ・ ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました[※]。
- ※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.9%の下落になったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

○ 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

(2022年5月13日～2023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、12,993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5月13日～2023年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	242,916,423	184,318,975
	地方債証券	11,881,000	10,719,735 (132,500)
内	特殊債券	7,830,630	5,739,299 (673,935)
	社債券	11,605,503	5,704,775 (200,000)

(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 3,254	百万円 3,119	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月13日～2023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 274,233	百万円 77,302	28.2	百万円 206,482	百万円 75,036	36.3

(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 —	百万円 299	百万円 3,736

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 5,599

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023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			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	593,728,000	603,890,129	83.5	—	57.2	18.5	7.7	
地方債証券	38,790,400	39,739,492	5.5	—	2.4	2.1	1.0	
	(38,790,400)	(39,739,492)	(5.5)	(—)	(2.4)	(2.1)	(1.0)	
特殊債券 (除く金融債)	30,856,129	31,543,391	4.4	—	2.2	1.5	0.7	
	(30,856,129)	(31,543,391)	(4.4)	(—)	(2.2)	(1.5)	(0.7)	
金融債券	2,300,000	2,299,100	0.3	—	—	0.2	0.1	
	(2,300,000)	(2,299,100)	(0.3)	(—)	(—)	(0.2)	(0.1)	
普通社債券	43,300,000	43,326,876	6.0	0.0	1.2	3.4	1.3	
	(43,300,000)	(43,326,876)	(6.0)	(0.0)	(1.2)	(3.4)	(1.3)	
合 計	708,974,529	720,798,990	99.6	0.0	62.9	25.9	10.8	
	(115,246,529)	(116,908,860)	(16.2)	(0.0)	(5.8)	(7.3)	(3.1)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第437回利付国債(2年)	0.005	1,800,000	1,802,628	2024/6/1
第438回利付国債(2年)	0.005	2,100,000	2,103,066	2024/7/1
第439回利付国債(2年)	0.005	1,800,000	1,802,718	2024/8/1
第440回利付国債(2年)	0.005	900,000	901,404	2024/9/1
第441回利付国債(2年)	0.005	3,700,000	3,705,883	2024/10/1
第442回利付国債(2年)	0.005	1,770,000	1,772,849	2024/11/1
第443回利付国債(2年)	0.005	1,300,000	1,302,210	2024/12/1
第444回利付国債(2年)	0.005	3,150,000	3,155,134	2025/1/1
第445回利付国債(2年)	0.005	3,590,000	3,595,528	2025/2/1
第446回利付国債(2年)	0.005	2,200,000	2,203,146	2025/3/1
第447回利付国債(2年)	0.005	1,020,000	1,021,438	2025/4/1
第140回利付国債(5年)	0.1	1,270,000	1,273,136	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	5,240,000	5,255,196	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	310,000	310,967	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	5,380,000	5,397,377	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,380,000	6,402,074	2025/6/20
第145回利付国債(5年)	0.1	5,810,000	5,832,542	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	4,970,000	4,990,675	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	1,280,000	1,282,188	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	2,180,000	2,183,379	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	6,630,000	6,638,884	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	4,990,000	4,994,491	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	750,000	750,285	2027/3/20
第152回利付国債(5年)	0.1	3,630,000	3,644,628	2027/3/20
第153回利付国債(5年)	0.005	6,040,000	6,037,523	2027/6/20
第154回利付国債(5年)	0.1	5,730,000	5,744,898	2027/9/20
第155回利付国債(5年)	0.3	2,550,000	2,577,463	2027/12/20
第156回利付国債(5年)	0.2	3,850,000	3,872,946	2027/12/20
第157回利付国債(5年)	0.2	1,700,000	1,708,194	2028/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	675,000	855,407	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,035,000	1,262,844	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	718,000	875,342	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,218,000	1,484,608	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	575,000	677,194	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,230,000	1,425,471	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,540,000	1,709,492	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,510,000	1,558,033	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,770,000	2,115,781	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,370,000	2,117,310	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	2,100,000	1,809,129	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	2,040,000	1,573,594	2059/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	2,800,000	2,140,600	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	2,410,000	1,965,885	2061/3/20
第15回利付国債(40年)	1.0	3,500,000	3,128,020	2062/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,990,000	4,021,800	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,890,000	3,922,325	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	2,460,000	2,483,443	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,620,000	1,630,238	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,330,000	3,359,237	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,020,000	4,059,275	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	3,470,000	3,507,961	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	3,320,000	3,351,108	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,570,000	2,581,333	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	4,870,000	4,891,866	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	4,620,000	4,640,882	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	6,340,000	6,367,388	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	6,130,000	6,154,703	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	5,700,000	5,719,836	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	4,970,000	4,982,922	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	6,090,000	6,099,744	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	6,530,000	6,531,567	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	4,570,000	4,568,811	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	3,870,000	3,867,910	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	5,500,000	5,493,840	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	5,740,000	5,731,619	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	5,060,000	5,049,272	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	7,040,000	7,020,006	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	5,250,000	5,231,100	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	6,790,000	6,760,056	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	7,250,000	7,206,790	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	6,430,000	6,378,752	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	5,630,000	5,575,276	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	5,890,000	5,821,970	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	5,860,000	5,783,292	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	7,890,000	7,774,095	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	6,300,000	6,199,515	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)	0.2	3,500,000	3,468,325	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)	0.2	5,020,000	4,966,737	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)	0.2	530,000	523,507	2032/9/20
第370回利付国債 (10年)	0.5	2,280,000	2,305,946	2033/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	196,000	228,888	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	268,000	308,411	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	307,000	352,442	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	252,000	302,279	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	238,000	274,675	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	339,000	399,287	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	339,000	398,853	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	302,000	342,670	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	206,000	226,089	2032/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第10回利付国債 (30年)	1.1	398,000	425,195	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	237,000	267,162	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	325,000	379,723	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	595,000	690,051	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	683,000	822,010	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	686,000	834,649	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	547,000	666,650	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	577,000	697,962	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	687,000	824,839	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	593,000	713,141	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	655,000	804,575	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	529,000	638,079	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	975,000	1,202,399	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	194,000	239,636	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	541,000	669,292	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	1,287,000	1,561,118	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	1,014,000	1,245,739	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	460,000	572,451	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,426,000	1,778,378	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	530,000	654,433	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,421,000	1,735,410	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	2,223,000	2,682,694	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,989,000	2,431,910	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,227,000	1,443,626	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	2,231,000	2,695,605	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	2,029,000	2,388,031	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,929,000	2,272,728	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	2,717,000	3,154,355	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,590,000	1,814,158	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,360,000	1,576,702	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	1,720,000	1,962,623	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	1,210,000	1,358,152	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	1,520,000	1,706,473	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,480,000	1,661,936	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,630,000	1,829,137	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,480,000	1,602,899	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	2,070,000	2,241,499	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,920,000	2,115,091	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,870,000	1,984,874	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,860,000	1,973,497	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	2,090,000	1,962,969	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,990,000	1,663,062	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	2,020,000	1,765,298	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	1,710,000	1,525,508	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	1,610,000	1,500,326	2047/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第55回利付国債 (30年)	0.8	1,790,000	1,663,930	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	1,740,000	1,613,397	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	1,800,000	1,664,820	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	2,570,000	2,370,953	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	1,800,000	1,617,030	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	1,630,000	1,530,472	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	1,570,000	1,399,812	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	1,320,000	1,113,538	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	1,630,000	1,332,427	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	1,720,000	1,401,043	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	1,520,000	1,236,170	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	1,830,000	1,480,122	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	2,830,000	2,408,867	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	1,710,000	1,450,917	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	1,720,000	1,496,692	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	1,990,000	1,728,215	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	1,950,000	1,691,781	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	1,910,000	1,655,435	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	1,930,000	1,671,148	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	2,720,000	2,548,803	2052/3/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	1,870,000	1,885,913	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)	1.4	2,190,000	2,262,948	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	2,110,000	2,284,349	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)	1.4	500,000	516,860	2053/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	732,000	752,327	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	360,000	369,205	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	1,079,000	1,111,326	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	520,000	537,456	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	698,000	722,548	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	705,000	733,348	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	410,000	424,973	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	370,000	384,193	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	310,000	322,799	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	150,000	156,508	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	585,000	611,611	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	250,000	262,152	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	1,082,000	1,137,149	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	395,000	417,214	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	880,000	927,203	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	520,000	551,943	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	1,047,000	1,117,295	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	420,000	447,001	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	1,264,000	1,355,968	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	340,000	363,684	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	1,270,000	1,365,211	2026/9/20

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91回利付国債 (20年)	2.3	548,000	590,924	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,282,000	1,379,906	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	190,000	204,654	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	875,000	945,857	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	1,107,000	1,210,604	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	340,000	369,036	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	573,000	626,753	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	610,000	664,570	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,480,000	1,618,498	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,030,000	1,134,864	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	723,000	803,585	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	520,000	580,668	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	760,000	844,816	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	610,000	671,884	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	920,000	1,017,648	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	571,000	634,649	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	674,037	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	1,000,000	1,099,320	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	560,000	617,870	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	876,000	976,696	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	861,000	969,124	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,050,000	1,175,506	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	922,000	1,036,079	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,600,000	1,804,480	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	944,000	1,070,816	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	461,000	524,866	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,320,000	1,493,923	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	520,000	586,539	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	400,000	445,572	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	780,000	857,929	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,299,000	1,458,971	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	100,000	111,590	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,318,000	1,503,772	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	1,240,000	1,405,502	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	1,844,000	2,123,163	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	200,000	227,196	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	440,000	496,443	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,974,000	2,232,534	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	280,000	314,448	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,862,000	2,095,494	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	469,236	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	187,000	209,385	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	2,320,000	2,617,215	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	4,545,000	5,136,940	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	56,080	2032/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第136回利付国債 (20年)	1.6	190,000	211,468	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	8,382,000	9,417,093	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	160,000	176,926	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	310,000	345,538	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,517,000	2,829,762	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,120,000	1,261,008	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	9,350,000	10,614,120	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,740,000	1,943,319	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	1,520,000	1,683,172	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	3,210,000	3,618,536	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	3,170,000	3,576,013	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	3,200,000	3,579,552	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,940,000	3,259,225	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	3,090,000	3,425,697	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	3,250,000	3,567,980	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	3,620,000	3,891,427	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,740,000	2,944,623	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	3,380,000	3,669,632	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	3,040,000	3,262,862	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	3,330,000	3,492,171	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	2,700,000	2,629,314	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	3,360,000	3,179,400	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	2,900,000	2,846,553	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	2,260,000	2,243,072	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	3,480,000	3,493,224	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	2,760,000	2,728,066	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	3,820,000	3,765,259	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	2,840,000	2,791,265	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	3,350,000	3,238,110	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	2,700,000	2,601,369	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	3,690,000	3,649,520	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	2,660,000	2,545,779	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	2,750,000	2,582,580	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	2,540,000	2,338,857	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	1,620,000	1,485,685	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	2,450,000	2,239,300	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,950,000	1,806,031	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	2,800,000	2,584,876	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	4,050,000	3,726,526	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	2,690,000	2,509,339	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	2,460,000	2,287,578	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	3,010,000	2,741,628	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	3,420,000	3,164,662	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	2,730,000	2,519,871	2041/12/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	2,970,000	2,887,226	2042/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第181回利付国債 (20年)	0.9	2,100,000	2,074,632	2042/6/20
第182回利付国債 (20年)	1.1	2,880,000	2,938,579	2042/9/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	2,780,000	2,979,298	2042/12/20
第184回利付国債 (20年)	1.1	780,000	792,253	2043/3/20
小 計		593,728,000	603,890,129	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	20,032	2023/6/20
第4回東京都公募公債 (20年)	2.22	200,000	205,960	2024/9/20
第5回東京都公募公債 (20年)	2.11	100,000	103,803	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	104,928	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	80,000	97,936	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)	2.31	100,000	119,976	2039/9/20
第12回東京都公募公債 (20年)	2.31	100,000	109,194	2027/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	88,822	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	89,562	2029/12/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	108,600	2033/3/18
第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	100,000	92,251	2036/6/20
第733回東京都公募公債	0.581	700,000	704,501	2024/6/20
第738回東京都公募公債	0.426	100,000	100,619	2024/12/20
第747回東京都公募公債	0.475	500,000	504,820	2025/9/19
第750回東京都公募公債	0.444	200,000	201,892	2025/12/19
第751回東京都公募公債	0.37	500,000	503,765	2025/12/19
第757回東京都公募公債	0.03	150,000	149,674	2026/6/19
第758回東京都公募公債	0.03	150,000	149,674	2026/6/19
第782回東京都公募公債	0.23	100,000	99,874	2028/6/20
第809回東京都公募公債	0.105	100,000	97,857	2030/9/20
平成26年度第9回北海道公募公債	0.52	100,000	100,704	2024/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	100,666	2024/12/26
平成27年度第1回北海道公募公債	0.43	300,000	302,109	2025/4/30
平成27年度第5回北海道公募公債	0.583	100,000	101,071	2025/6/30
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	100,000	99,473	2028/12/28
令和3年度第14回北海道公募公債 (5年)	0.001	400,000	397,936	2027/1/28
第36回2号宮城県公募公債	0.135	342,000	335,060	2030/10/28
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	680,000	700,406	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	180,000	225,554	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債 (20年)	2.11	500,000	521,455	2025/6/20
第4回神奈川県公募公債 (30年)	2.62	100,000	123,776	2038/3/19
第20回神奈川県公募公債 (20年)	1.706	500,000	548,665	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	107,288	2034/9/20
第234回神奈川県公募公債	0.254	100,000	99,995	2028/6/20
第243回神奈川県公募公債	0.075	100,000	98,288	2029/12/20
第256回神奈川県公募公債	0.269	350,000	341,701	2032/3/19
第7回大阪府公募公債 (20年)	1.84	220,000	243,773	2031/9/26
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	100,000	109,603	2033/9/27
第179回大阪府公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,758	2026/1/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第184回大阪府公募公債 (5年)	0.001	120,000	119,590	2026/6/29
第186回大阪府公募公債 (5年)	0.001	300,000	298,869	2026/8/28
第191回大阪府公募公債 (5年)	0.001	160,000	159,174	2027/1/28
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	201,430	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	201,388	2024/9/27
第391回大阪府公募公債	0.513	210,000	211,572	2024/12/25
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	110,795	2025/2/26
第400回大阪府公募公債	0.531	136,000	137,457	2025/9/29
第407回大阪府公募公債	0.09	200,000	199,970	2026/4/27
第410回大阪府公募公債	0.001	200,000	199,298	2026/7/28
第415回大阪府公募公債	0.142	100,000	100,024	2026/12/25
第417回大阪府公募公債	0.248	300,000	301,155	2027/2/26
第420回大阪府公募公債	0.17	100,000	100,019	2027/5/28
第426回大阪府公募公債	0.172	100,000	99,828	2027/11/29
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	129,550	2028/8/30
第439回大阪府公募公債	0.193	100,000	99,463	2028/12/27
第455回大阪府公募公債	0.116	148,000	145,451	2030/4/26
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	189,766	2030/9/27
第464回大阪府公募公債	0.072	800,000	777,144	2031/1/28
第465回大阪府公募公債	0.12	500,000	487,210	2031/2/25
第467回大阪府公募公債	0.164	200,000	195,232	2031/4/28
第471回大阪府公募公債	0.083	97,000	93,772	2031/8/29
平成26年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.071	200,000	209,078	2029/4/27
平成26年度第5回京都府公募公債 (20年)	1.455	100,000	107,928	2034/8/10
第1回兵庫県公募公債 (12年)	1.1	100,000	101,218	2024/6/26
第1回兵庫県公募公債 (15年)	1.66	400,000	419,780	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債 (20年)	2.37	300,000	328,215	2027/9/17
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	90,000	108,550	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (12年)	0.73	100,000	101,997	2026/8/6
第5回兵庫県公募公債 (12年)	0.687	200,000	204,264	2027/7/7
第5回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	200,000	210,494	2028/5/26
第6回兵庫県公募公債 (15年)	1.35	100,000	105,515	2028/7/14
第9回兵庫県公募公債 (15年)	1.02	500,000	521,015	2029/7/13
第27回兵庫県公募公債 (20年)	0.387	200,000	190,032	2036/5/12
平成28年度第29回兵庫県公募公債	0.238	100,000	100,346	2027/2/19
第6回静岡県公募公債 (15年)	1.062	300,000	313,548	2029/6/25
第11回静岡県公募公債 (20年)	1.841	550,000	606,760	2030/10/18
第14回静岡県公募公債 (20年)	1.736	100,000	109,992	2032/6/18
令和2年度第15回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,743	2026/3/19
令和2年度第13回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,743	2026/3/19
平成20年度第8回愛知県公募公債 (20年)	2.04	200,000	219,370	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年)	2.28	700,000	782,628	2029/6/20
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	200,000	209,836	2026/11/13
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)	1.314	100,000	105,017	2027/12/13
平成26年度第7回愛知県公募公債	0.591	600,000	604,224	2024/7/29

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	
平成26年度第15回愛知県公募公債	0.48	200,000	201,412	2024/12/20
平成27年度第7回愛知県公募公債	0.548	100,000	101,055	2025/7/28
平成30年度第5回愛知県公募公債	0.195	100,000	99,698	2028/6/29
平成30年度第8回愛知県公募公債	0.255	200,000	199,988	2028/8/31
令和3年度第18回愛知県公募公債	0.274	100,000	97,581	2032/3/30
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	261,942	2025/3/25
平成28年度第1回広島県公募公債	0.08	100,000	99,969	2026/5/25
平成28年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.414	100,000	94,812	2036/9/26
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	199,934	2028/11/22
令和3年度第7回広島県公募公債	0.244	100,000	97,331	2032/3/25
第10回埼玉県公募公債 (20年)	1.94	100,000	111,091	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	200,000	217,600	2034/5/8
第16回埼玉県公募公債 (20年)	1.216	100,000	105,170	2035/8/14
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	100,497	2025/1/28
平成30年度第4回埼玉県公募公債	0.205	100,000	99,748	2028/6/26
令和2年度第1回埼玉県公募公債	0.131	100,000	98,487	2030/4/15
令和3年度第2回埼玉県公募公債 (5年)	0.01	110,000	109,759	2026/4/15
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	86,352	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	95,308	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債 (20年)	2.116	800,000	900,824	2031/2/21
平成23年度第1回福岡県公募公債 (15年)	1.491	100,000	104,820	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	200,000	201,298	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債	0.654	100,000	100,729	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債	0.464	100,000	101,004	2025/12/25
令和2年度第4回福岡県公募公債	0.14	200,000	196,214	2030/9/20
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	88,230	2030/10/11
平成27年度第3回千葉県公募公債	0.524	200,000	201,922	2025/6/25
平成27年度第6回千葉県公募公債	0.469	500,000	505,085	2025/12/25
平成28年度第3回千葉県公募公債	0.05	400,000	399,356	2026/7/24
平成30年度第6回千葉県公募公債	0.145	100,000	99,240	2029/1/25
令和元年度第6回千葉県公募公債	0.135	100,000	98,624	2030/1/25
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	100,000	100,376	2026/2/26
令和4年度第1回長野県公募公債	0.299	300,000	292,956	2032/4/23
第2回群馬県公募公債 (20年)	2.019	100,000	112,157	2031/7/18
第7回群馬県公募公債 (20年)	0.313	100,000	93,887	2036/6/13
平成27年度第1回岐阜県公募公債	0.515	300,000	303,180	2025/9/30
令和2年度第2回岐阜県公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,860	2025/11/25
平成27年度第1回大分県公募公債	0.476	203,400	205,434	2025/10/30
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	201,466	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	300,000	302,166	2024/7/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	201,444	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	400,000	402,040	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	201,532	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	100,672	2025/4/25
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	500,000	505,310	2025/7/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	200,000	202,084	2025/9/25
第151回共同発行市場公募地方債	0.466	200,000	201,938	2025/10/24
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	600,000	606,402	2025/11/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	200,000	202,034	2025/12/25
第158回共同発行市場公募地方債	0.08	200,000	199,938	2026/5/25
第185回共同発行市場公募地方債	0.245	300,000	299,820	2028/8/25
第193回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	98,885	2029/4/25
第198回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	98,314	2029/9/25
第232回共同発行市場公募地方債	0.364	450,000	440,923	2032/7/23
令和元年度第3回堺市公募公債	0.11	100,000	98,451	2029/12/19
平成27年度第1回佐賀県公募公債	0.476	500,000	505,095	2025/11/28
平成29年度第1回佐賀県公募公債	0.19	100,000	99,954	2027/11/30
平成30年度第1回福島県公募公債	0.264	100,000	99,994	2028/11/30
令和元年度第2回栃木県公募公債	0.09	100,000	98,462	2029/11/29
令和2年度第2回栃木県公募公債	0.135	100,000	97,911	2030/11/27
令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）	0.005	200,000	199,388	2026/7/30
第5回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	111,713	2028/9/21
第15回大阪市公募公債（20年）	2.12	100,000	112,552	2031/1/24
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	100,772	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債（30年）	2.53	100,000	120,091	2035/3/20
第9回名古屋市公募公債（20年）	2.07	100,000	109,851	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債（30年）	2.095	90,000	105,314	2042/9/19
第28回名古屋市公募公債（5年）	0.01	500,000	499,085	2025/12/19
第488回名古屋市公募公債	0.598	200,000	201,566	2024/9/20
第491回名古屋市公募公債	0.587	400,000	404,344	2025/6/19
第511回名古屋市公募公債	0.075	100,000	98,155	2030/3/27
第1回京都市公募公債（15年）	0.781	100,000	102,540	2030/12/20
第3回京都市公募公債（20年）	2.09	100,000	105,239	2025/12/19
第5回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	54,007	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	2.54	110,000	118,305	2026/6/19
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	2.08	200,000	219,812	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	110,657	2030/9/13
第5回横浜市公募公債（20年）	2.17	100,000	104,417	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）	2.06	450,000	473,224	2025/12/19
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	202,084	2025/6/16
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	400,000	404,112	2025/8/18
平成27年度第4回横浜市公募公債	0.486	300,000	303,039	2025/10/20
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	100,000	108,639	2033/5/20
第33回横浜市公募公債（20年）	0.323	100,000	94,168	2036/4/28
第35回横浜市公募公債（20年）	0.443	500,000	476,260	2036/10/28
第54回横浜市公募公債（5年）	0.02	300,000	299,580	2025/11/25
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	2.277	80,000	95,638	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	111,606	2031/7/29
平成23年度第9回札幌市公募公債	1.493	400,000	420,288	2027/2/12
令和元年度第2回札幌市公募公債（5年）	0.01	600,000	600,066	2024/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
令和2年度第7回札幌市公募公債	0.115	200,000	195,274	2030/12/20
令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）	0.01	100,000	99,721	2026/6/19
第7回川崎市公募公債（20年）	2.08	100,000	110,698	2029/7/17
第12回川崎市公募公債（20年）	2.04	100,000	112,260	2031/5/30
第62回川崎市公募公債（5年）	0.005	490,000	488,500	2026/7/30
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	100,000	108,376	2034/6/20
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,154	2023/10/24
令和3年度第4回千葉市公募公債	0.135	100,000	96,864	2031/12/24
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	100,708	2025/4/24
令和2年度第2回徳島県公募公債	0.135	100,000	97,911	2030/11/27
平成28年度第1回山梨県公募公債	0.06	200,000	199,616	2026/10/30
平成30年度第1回山梨県公募公債	0.289	100,000	100,156	2028/10/30
令和2年度第1回山梨県公募公債	0.135	700,000	685,790	2030/10/30
第96回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債	2.34	100,000	110,699	2028/12/20
小 計		38,790,400	39,739,492	
特殊債券(除く金融債)				
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	120,386	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	118,819	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	112,578	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	111,196	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	111,281	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	115,753	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	110,567	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	112,931	2042/5/30
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	100,736	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	124,908	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	107,906	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	1,183,000	1,191,789	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	100,725	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	201,544	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	650,000	656,188	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	101,945	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	101,135	2025/7/31
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.386	100,000	100,841	2025/10/31
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.379	200,000	201,698	2025/12/26
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	100,719	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	200,502	2026/2/27
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	300,000	299,643	2026/4/30
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	99,675	2028/5/31
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.001	500,000	500,000	2024/8/28
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,002	2023/5/16
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	100,702	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	241,749	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	304,766	2025/6/13
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	400,000	403,548	2025/9/12

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77回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.386	100,000	100,826	2025/10/15
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	150,000	151,249	2025/11/18
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.145	100,000	100,248	2026/2/16
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	674,000	673,326	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	101,879	2026/4/17
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.085	300,000	299,943	2026/12/14
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.09	325,000	324,155	2027/9/17
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	131,000	130,941	2027/11/15
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.145	223,000	222,279	2028/5/19
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	200,000	199,226	2028/12/15
第232回政府保証預金保険機構債券		0.1	400,000	400,532	2024/12/10
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	104,952	2025/6/13
第26回政府保証日本政策投資銀行		0.466	100,000	100,714	2024/12/12
第52回政府保証日本政策投資銀行		0.001	500,000	499,795	2025/1/24
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	98,807	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	32,429	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	130,691	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	149,333	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	321,954	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	38,747	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	253,634	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	216,296	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	137,761	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	326,949	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	218,358	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	120,560	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)		2.91	300,000	366,081	2034/6/20
第38回道路債券(財投機関債)		2.26	200,000	205,998	2024/9/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	200,000	207,902	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	167,091	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	110,180	2032/9/17
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.523	100,000	103,653	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	311,109	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	110,682	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	105,441	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	55,746	2029/6/28
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	122,789	2034/3/24
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.33	50,000	51,559	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	110,269	2030/10/28
第12回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.03	300,000	310,902	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	112,491	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	90,643	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	88,569	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.39	150,000	159,769	2026/3/24
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.32	100,000	108,557	2027/6/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第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	109,470	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	300,000	329,295	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	55,261	2033/1/28
第27回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.02	100,000	99,880	2025/5/28
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	105,796	2035/6/28
第67回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.501	170,000	171,230	2024/12/27
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.491	300,000	303,030	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	106,258	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	102,270	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	75,804	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	104,892	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	207,416	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	109,376	2035/4/27
第27回首都高速道路	0.06	100,000	99,727	2025/12/19
第24回阪神高速道路	0.04	200,000	199,726	2025/3/19
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	89,484	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	88,437	2030/10/29
第5回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.23	200,000	206,854	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.175	400,000	399,996	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.225	100,000	99,572	2028/6/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	200,444	2027/2/22
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	31,140	31,353	2042/6/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	36,390	36,212	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	37,511	37,304	2033/1/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	43,325	42,990	2033/4/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	10,068	10,130	2038/11/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	62,404	61,925	2034/6/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	10,897	11,066	2039/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	20,854	21,013	2043/5/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	19,700	20,803	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	19,876	20,939	2044/12/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	20,223	21,256	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	19,413	20,382	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	37,280	38,975	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	9,850	9,906	2040/12/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	38,894	40,621	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	20,893	21,781	2045/7/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	40,582	41,903	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	10,213	10,280	2041/4/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	23,931	24,994	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	91,552	96,048	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	56,946	59,390	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	16,486	17,152	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	35,192	36,689	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	35,970	37,422	2046/6/10

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50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	37,262	38,705	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	39,120	40,650	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	20,816	21,136	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	42,108	43,676	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	44,200	45,853	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	24,886	25,836	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	25,068	26,044	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	53,382	55,529	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	54,138	56,097	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	54,668	56,492	2047/6/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	30,530	31,513	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	30,370	31,224	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	100,272	103,173	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	31,475	32,561	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	35,590	36,959	2048/7/10
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	30,189	31,175	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	31,498	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	31,418	32,269	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	35,192	36,111	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	37,787	38,705	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	148,004	151,412	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	76,882	78,672	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	110,952	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	41,148	41,936	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	126,636	128,543	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	44,807	45,130	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	209,856	2026/12/18
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	56,266	56,801	2050/4/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	53,860	54,163	2050/5/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	55,051	55,816	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	222,934	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	104,819	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	58,441	59,007	2050/12/10
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	122,236	120,954	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	267,460	261,731	2051/6/10
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	338,560	328,819	2051/7/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	206,058	199,385	2051/8/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	142,422	139,765	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	495,635	486,941	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	153,279	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	219,432	214,760	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	110,428	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	73,252	71,548	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	75,295	73,370	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	74,080	72,325	2053/1/10

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129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	151,610	148,283	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	150,926	147,349	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	75,573	73,626	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	75,151	73,222	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	228,831	223,231	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	77,029	74,937	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,820	75,936	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	156,404	152,913	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	155,284	152,162	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	104,634	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	164,514	157,332	2054/8/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	249,069	236,936	2054/9/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	253,635	242,201	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	170,880	163,692	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	85,391	82,257	2055/1/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	170,654	164,421	2055/2/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	88,591	85,358	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	102,045	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	178,794	171,956	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.514	100,000	100,962	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	89,924	86,488	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	272,487	262,699	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	183,806	176,981	2056/6/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	184,118	176,817	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	186,402	178,153	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	93,030	88,889	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	186,417	2035/11/20
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,651	90,763	2056/12/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	189,366	180,836	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	189,742	182,400	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	94,681	91,678	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	190,710	184,183	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	95,451	92,471	2057/5/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	96,266	93,192	2057/6/10
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	193,392	187,114	2057/7/10
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.53	194,060	188,145	2057/8/10
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	194,906	188,468	2057/9/10
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	98,064	96,747	2057/11/10
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	197,134	199,085	2058/1/10
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	99,341	100,899	2058/3/10
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	99,856	100,203	2058/4/10
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	101,108	2058/5/10
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	99,689	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	100,206	2027/3/19
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	52,039	2025/6/20

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7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	78,141	2031/6/13
第83回東日本高速道路	0.05	400,000	398,268	2026/6/19
第29回西日本高速道路	0.31	200,000	200,794	2026/2/12
第56回西日本高速道路	0.06	900,000	898,407	2025/9/19
第61回西日本高速道路	0.04	700,000	696,759	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	103,286	2029/11/27
小 計		30,856,129	31,543,391	
金融債券				
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,909	2024/9/27
い第843号商工債券	0.12	200,000	199,794	2025/8/27
い第848号商工債券	0.1	100,000	99,743	2026/1/27
い第850号商工債券	0.1	300,000	299,055	2026/3/27
い第852号商工債券	0.09	100,000	99,622	2026/5/27
い第854号商工債券	0.08	500,000	497,760	2026/7/27
い第857号商工債券	0.09	100,000	99,500	2026/10/27
い第872号商工債券	0.45	200,000	200,880	2028/1/27
第376回信金中金債	0.05	100,000	99,770	2026/3/27
第11号商工債券(10年)	0.66	300,000	302,232	2024/9/20
第257号商工債券(3年)	0.04	200,000	199,876	2024/6/27
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	100,959	2025/9/26
小 計		2,300,000	2,299,100	
普通社債券				
第548回東京電力	2.347	100,000	103,524	2028/9/29
第567回東京電力	1.958	100,000	101,076	2030/7/29
第508回関西電力	0.455	200,000	200,616	2027/4/23
第510回関西電力	0.49	500,000	501,545	2027/7/23
第511回関西電力	0.41	100,000	99,893	2027/9/17
第518回関西電力	0.44	200,000	198,956	2028/6/20
第524回関西電力	0.514	200,000	199,144	2028/10/25
第532回関西電力	0.18	100,000	99,939	2024/7/25
第543回関西電力	0.001	200,000	199,246	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,719	2026/11/25
第400回中国電力	0.34	200,000	199,356	2027/9/24
第409回中国電力	0.4	200,000	198,538	2028/9/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	102,349	2026/6/25
第322回北陸電力	0.38	100,000	100,081	2027/6/25
第485回東北電力	0.25	100,000	99,840	2026/7/24
第494回東北電力	0.425	200,000	200,120	2027/6/25
第529回東北電力	0.07	500,000	496,490	2026/4/24
第552回東北電力	0.864	400,000	405,192	2028/12/25
第449回九州電力	0.43	300,000	300,399	2027/4/23
第468回九州電力	0.435	100,000	99,173	2028/8/25
第471回九州電力	0.455	300,000	297,351	2028/11/24
第484回九州電力	0.375	400,000	391,152	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	400,000	397,412	2026/5/25

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511回九州電力		0.51	600,000	602,784	2027/2/25
第29回沖縄電力		0.001	200,000	199,788	2024/6/25
第12回新関西国際空港		1.067	100,000	103,749	2029/9/20
第27回新関西国際空港		0.05	100,000	99,631	2026/3/19
第32回成田国際空港		0.22	100,000	98,826	2029/1/29
第1回国際石油開発帝石		0.08	100,000	99,469	2026/3/16
第48回鹿島建設 (サステナビリティ)		0.554	100,000	100,676	2028/3/16
第10回明治ホールディングス (サステナビリティ)		0.05	200,000	199,044	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	99,527	2026/3/13
第19回アサヒグループホールディングス		0.28	400,000	400,524	2026/3/6
第9回サントリーホールディングス		0.3	200,000	199,692	2027/6/8
第5回サントリー食品インターナショナル		0.001	200,000	199,760	2024/7/8
第22回味の素		0.305	100,000	100,167	2026/3/2
第3回 キューピー		0.23	100,000	99,951	2026/2/13
第13回日本たばこ産業		0.355	200,000	198,696	2028/9/8
第6回ヒューリック		0.494	400,000	397,528	2028/10/20
第11回ヒューリック		0.32	300,000	300,147	2026/4/13
第4回トヨタ紡織		0.21	200,000	200,004	2024/12/20
第27回東急不動産ホールディングス (グリーン)		0.32	300,000	300,642	2026/2/27
第9回クラレ		0.34	100,000	99,811	2027/4/30
第16回旭化成		0.001	200,000	199,544	2024/12/9
第42回王子ホールディングス		0.08	300,000	298,608	2026/3/24
第11回イビデン		0.001	200,000	199,632	2024/9/9
第56回三井化学		0.3	100,000	100,033	2026/2/27
第4回野村総合研究所		0.34	100,000	99,209	2028/3/23
第6回花王		0.13	200,000	199,586	2025/9/19
第1回アステラス製薬		0.26	400,000	400,376	2025/12/5
第19回オリエンタルランド		0.001	300,000	299,574	2024/9/2
第12回ヤフー		0.37	500,000	495,145	2026/7/31
第19回Zホールディングス		0.35	400,000	395,876	2026/7/28
第22回Zホールディングス		0.76	200,000	199,348	2027/9/15
第8回住友三井オートサービス (サステナビリティ)		0.4	100,000	100,060	2026/2/17
第11回ブリヂストン		0.295	500,000	498,960	2027/4/21
第12回日本電気硝子		0.26	100,000	99,007	2028/2/25
第4回新日本製鐵		0.375	200,000	199,934	2027/5/20
第36回ジェイ エフ イー ホールディングス		0.33	400,000	398,904	2027/6/9
第14回LIXIL		0.475	200,000	199,808	2027/8/27
第1回日本郵政 (グリーン)		0.255	100,000	99,585	2027/9/1
第30回ダイキン工業		0.459	200,000	198,298	2029/7/27
第55回日本精工		0.3	100,000	100,145	2026/3/6
第19回日立製作所		0.16	100,000	99,372	2027/3/12
第17回パナソニック		0.47	500,000	501,770	2026/9/18
第18回パナソニック		0.23	100,000	99,699	2026/3/5
第22回パナソニック		0.29	100,000	98,730	2027/12/24
第18回デンソー		0.315	300,000	299,001	2028/3/17

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40回三菱重工業	0.31	300,000	298,725	2027/9/8
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	99,570	2024/10/21
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）	0.05	800,000	796,368	2026/3/18
第4回ヤマハ発動機	0.32	100,000	100,094	2026/4/24
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,988	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	200,000	199,756	2024/8/2
第63回三井物産	2.37	400,000	431,704	2027/4/23
第51回住友商事	1.241	100,000	103,763	2029/4/23
第61回住友商事	0.644	100,000	100,596	2028/3/1
第1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	100,306	2024/6/26
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	300,000	300,057	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	500,000	490,200	2028/5/31
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.91	200,000	224,226	2029/10/16
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	200,000	206,100	2025/11/12
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.16	200,000	207,636	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	110,227	2031/1/20
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	107,793	2027/4/20
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	0.545	100,000	97,674	2028/6/12
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	104,223	2026/9/11
第28回芙蓉総合リース	0.14	500,000	495,525	2026/4/21
第14回みずほリース	0.37	100,000	99,746	2026/6/19
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	1,200,000	1,198,512	2025/12/19
第17回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	300,000	298,746	2027/12/20
第20回エス・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	0.001	600,000	598,788	2024/10/28
第52回日産フィナンシャルサービス	0.28	200,000	199,178	2024/9/20
第53回日産フィナンシャルサービス	0.58	300,000	296,940	2026/9/18
第34回東京センチュリー	0.22	300,000	292,839	2028/7/21
第70回ホンダファイナンス	0.001	200,000	199,544	2024/9/19
第72回ホンダファイナンス	0.03	400,000	398,920	2024/12/19
第96回トヨタファイナンス	0.06	800,000	796,504	2026/4/15
第97回トヨタファイナンス	0.001	200,000	199,786	2024/7/22
第22回ポケットカード	0.3	100,000	99,530	2025/10/29
第31回リコーリース	0.3	100,000	100,027	2025/1/23
第41回リコーリース	0.14	500,000	496,475	2026/4/17
第79回アコム	0.29	300,000	299,499	2025/2/28
第80回アコム	0.28	200,000	198,116	2026/2/26
第81回アコム	0.17	100,000	98,433	2026/9/3
第34回三井住友ファイナンス&リース	0.43	300,000	300,501	2026/2/2
第1回三菱HCキャピタル	0.05	900,000	896,886	2024/11/29
第69回三菱UFJリース	0.24	500,000	497,145	2026/7/10
第3回野村ホールディングス	0.28	200,000	197,450	2026/9/4
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	103,631	2025/6/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	103,550	2025/9/24
第137回三菱地所	0.05	300,000	299,382	2025/2/7
第143回三菱地所	0.9	100,000	100,708	2033/5/2

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111回住友不動産（グリーン）	0.52	100,000	99,920	2028/4/28
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000	100,652	2024/9/20
第13回森トラスト総合リート投資法人	0.17	200,000	199,882	2024/2/22
第76回東京急行電鉄	1.563	200,000	209,416	2027/6/7
第36回京王電鉄	0.325	200,000	198,952	2027/9/17
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	102,663	2024/6/20
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	327,555	2028/4/21
第100回東日本旅客鉄道	1.981	200,000	218,806	2044/1/29
第102回東日本旅客鉄道	0.63	100,000	100,599	2024/7/25
第163回東日本旅客鉄道	0.05	600,000	596,166	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	397,428	2026/4/22
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	110,433	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	108,421	2030/10/25
第2回東京地下鉄	2.36	500,000	512,380	2024/6/20
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	296,754	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	197,706	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	200,000	198,792	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	200,000	198,396	2026/3/23
第8回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	99,973	2024/9/18
第1回横浜高速鉄道	0.62	300,000	301,422	2026/2/25
第9回九州旅客鉄道	0.001	200,000	199,298	2024/12/9
第31回KDDI（サステナビリティ）	0.43	200,000	199,846	2027/10/27
第9回ソフトバンク	0.48	300,000	295,614	2027/12/3
第14回ソフトバンク	0.24	100,000	98,769	2026/10/9
第16回ソフトバンク	0.52	300,000	283,383	2031/10/10
第50回電源開発	0.415	200,000	200,222	2027/7/20
第57回電源開発	0.355	100,000	98,860	2028/7/20
第59回電源開発	0.414	300,000	297,159	2028/9/20
第64回電源開発	0.405	600,000	591,726	2029/4/20
第67回電源開発	0.24	200,000	194,266	2029/9/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	100,175	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	300,000	298,134	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	98,653	2030/7/24
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	199,870	2025/9/12
第25回東京電力パワーグリッド	1.02	100,000	100,444	2029/4/24
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	400,000	401,020	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	300,000	300,066	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	199,542	2027/1/27
第35回東京電力パワーグリッド	1.2	100,000	100,928	2030/4/23
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	400,000	400,188	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド	1.08	400,000	399,952	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	99,790	2026/10/8
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	200,000	198,510	2026/4/22
第47回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	192,116	2031/8/29

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49回東京電力パワーグリッド	0.6	400,000	397,336	2027/4/26
第16回JERA	0.64	200,000	201,242	2028/4/25
第17回JERA	0.9	200,000	202,228	2030/4/25
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	199,288	2024/9/9
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	0.85	400,000	400,456	2027/9/14
第13回広島ガス	0.405	200,000	197,306	2028/9/13
第7回ファーストリテイリング	0.405	100,000	99,968	2028/6/6
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	100,847	2025/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,024	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	200,000	199,308	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	500,000	492,755	2026/10/21
第38回フランス相互信用連合銀行	0.802	300,000	301,110	2025/10/10
第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	1.258	200,000	200,776	2024/1/25
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.528	300,000	299,844	2024/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	97,815	2026/12/16
第1回サンタンデール銀行（2019）	0.463	500,000	496,510	2024/12/5
第17回ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	300,000	300,183	2024/1/23
小 計		43,300,000	43,326,876	
合 計		708,974,529	720,798,990	

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 744	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 720,798,990	% 99.4
コール・ローン等、その他	4,583,391	0.6
投資信託財産総額	725,382,381	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	725,367,711,208
コール・ローン等	1,791,086,826
公社債(評価額)	720,798,990,479
未収入金	1,437,798,565
未収利息	1,274,872,862
前払費用	70,332,476
差入委託証拠金	△ 5,370,000
(B) 負債	1,890,163,226
未払金	1,337,327,944
未払解約金	552,833,163
未払利息	2,119
(C) 純資産総額(A-B)	723,477,547,982
元本	552,953,193,068
次期繰越損益金	170,524,354,914
(D) 受益権総口数	552,953,193,068口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,084円

<注記事項>

- ①期首元本額 505,301,120,122円
 期中追加設定元本額 136,351,256,491円
 期中一部解約元本額 88,699,183,545円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,084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)	116,121,862,701円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	90,894,262,647円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	53,292,981,188円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	40,144,545,982円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	26,757,132,595円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	16,907,291,170円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	14,361,338,339円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	14,137,980,746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)	13,109,035,096円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	9,257,933,215円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	9,100,321,586円
三菱UFJ バランスファンド4OVA(適格機関投資家限定)	8,948,944,800円
国内債券セレクション(ラップ向け)	8,651,501,655円
つみたて8資産均等バランス	8,074,347,512円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,903,499,724円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	6,856,365,619円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	6,368,468,343円
ラップ向けインデックスf 国内債券	5,678,326,069円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	4,972,729,003円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	4,950,442,822円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	4,597,272,186円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	4,387,550,381円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	4,272,747,781円

○損益の状況 (2022年5月13日~2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,028,579,379
受取利息	5,029,689,419
支払利息	△ 1,110,040
(B) 有価証券売買損益	△ 10,597,170,988
売買益	1,468,646,965
売買損	△ 12,065,817,953
(C) 先物取引等取引損益	11,962,865
取引益	18,326,065
取引損	△ 6,363,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,556,628,744
(E) 前期繰越損益金	161,453,087,390
(F) 追加信託差損益金	40,769,827,946
(G) 解約差損益金	△ 26,141,931,678
(H) 計(D+E+F+G)	170,524,354,914
次期繰越損益金(H)	170,524,354,914

(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>日本債券インデックスファンド	4,251,387,969円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,217,058,411円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	3,854,583,062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)	3,850,978,535円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,811,118,987円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	3,702,243,851円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	2,925,521,581円
つみたて4資産均等バランス	2,858,251,331円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	2,682,815,893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)	2,610,464,306円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,573,771,336円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	2,283,730,876円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,159,745,479円
日本債券インデックスファンドS	2,117,680,073円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,106,034,462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)	2,102,609,182円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,059,583,616円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	1,930,693,096円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	1,794,266,682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)	1,730,531,829円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールデンキーパー)	1,695,685,409円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	1,643,127,680円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,185,572,136円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,058,810,755円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	887,846,440円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	730,381,530円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	712,581,726円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	507,480,082円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	481,227,287円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	479,565,718円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919円
eMAXIS バランス (波乗り型)	475,193,577円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	448,276,674円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	431,694,209円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429,832,474円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424,729,389円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424,280,144円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421,626,267円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420,955,442円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419,477,595円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413,671,752円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	197,170,754円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	192,273,147円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	167,572,867円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	150,524,199円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	112,114,045円
eMAXIS 最適化バランス (マイフオワード)	90,139,485円

eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	72,708,769円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	53,960,847円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	45,904,144円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	34,999,568円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	27,636,299円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,706,550円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	17,283,391円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	16,520,699円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	14,268,228円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	14,248,579円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	10,787,577円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	8,354,145円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,931,596円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,809,470円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	2,446,516円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	1,438,842円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,426,520円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	257,508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)	132,813円
合計	552,953,193,068円

【お知らせ】

①信託金限度額の引き上げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2022年9月27日)

②三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2024年1月26日

[計算期間：2023年1月27日～2024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15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15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
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
15期(2024年1月26日)	11,199	△4.1	341.23	△4.1	101.9	—	321,276

(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 (係(日本、円ヘッジ・円ベース))		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年1月26日	円 11,680	% —	355.93	% —	97.5	—
1月末	11,594	△0.7	353.36	△0.7	98.2	—
2月末	11,317	△3.1	344.92	△3.1	102.4	—
3月末	11,516	△1.4	350.96	△1.4	97.9	—
4月末	11,467	△1.8	349.53	△1.8	99.8	—
5月末	11,370	△2.7	346.62	△2.6	102.0	—
6月末	11,298	△3.3	344.37	△3.2	103.1	—
7月末	11,242	△3.8	342.72	△3.7	96.9	—
8月末	11,154	△4.5	339.97	△4.5	102.1	—
9月末	10,852	△7.1	330.75	△7.1	99.6	—
10月末	10,795	△7.6	329.05	△7.6	98.9	—
11月末	11,110	△4.9	338.66	△4.9	99.2	—
12月末	11,422	△2.2	347.97	△2.2	96.1	—
(期 末) 2024年1月26日	11,199	△4.1	341.23	△4.1	101.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

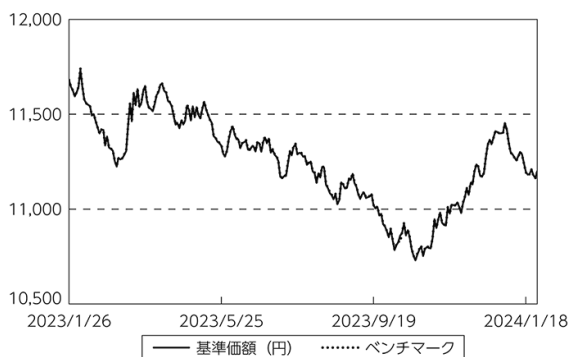
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−4.1%)と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

◎ 債券市況

- ・ 先進国の債券市況は上昇しました。
- ・ 先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により下落した後、中銀による利上げの打ち止め観測等を背景とした金利低下により反発し、期間の初めとの比較では上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークである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4.1%の下落になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

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

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・ 組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年1月27日～2024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 ）	1	0.012	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(1)	(0.012)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、11,254円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2023年1月27日～2024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 697,567	千アメリカドル 478,524
	カナダ	千カナダドル 35,168	千カナダドル 20,290
	メキシコ	千メキシコペソ 148,773	千メキシコペソ 77,981
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 75,593	51,409
	イタリア	国債証券 85,608	61,678
	フランス	国債証券 96,216	64,758
	オランダ	国債証券 15,482	10,110
	スペイン	国債証券 52,156	34,675
	ベルギー	国債証券 19,770	13,896
	オーストリア	国債証券 12,297	7,653
	フィンランド	国債証券 4,975	2,221
	アイルランド	国債証券 6,279	4,956
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 52,413	千イギリスポンド 24,960
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 13,061	千スウェーデンクローネ 6,253
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 9,754	千ノルウェークローネ 4,429
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 15,722	千デンマーククローネ 13,104
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 19,558	千ポーランドズロチ 9,188
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 24,685	千オーストラリアドル 17,028
ニュージーランド	国債証券 千ニュージーランドドル 3,662	千ニュージーランドドル 142	
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 4,787	千シンガポールドル 3,219	
マレーシア	国債証券 千マレーシアリングギット 20,124	千マレーシアリングギット 8,122	
中国	国債証券 千中国元 974,725	千中国元 185,410	
イスラエル	国債証券 千イスラエルシェケル 11,121	千イスラエルシェケル 4,892	

(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

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	百万円	うち利害関係人 との取引状況B 百万円	$\frac{B}{A}$ %	百万円	うち利害関係人 との取引状況D 百万円	$\frac{D}{C}$ %
為替先物取引	3,607,697	2,724,726	75.5	3,665,108	2,725,544	74.4
為替直物取引	161,779	74,591	46.1	100,088	67,673	67.6

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

○組入資産の明細

(2024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 1,171,390	千アメリカドル 1,053,542	千円 155,608,233	% 48.4	% —	% 20.6	% 18.5	% 9.3
カナダ	千カナダドル 65,670	千カナダドル 60,351	6,614,487	2.1	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 366,760	千メキシコペソ 337,286	2,896,443	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	140,470	131,905	21,127,277	6.6	—	3.6	2.1	0.8
イタリア	157,310	150,032	24,030,649	7.5	—	4.3	2.5	0.7
フランス	182,580	169,053	27,077,363	8.4	—	5.0	2.6	0.8
オランダ	32,700	30,037	4,811,063	1.5	—	0.9	0.5	0.1
スペイン	105,060	98,562	15,786,796	4.9	—	2.9	1.5	0.5
ベルギー	38,300	35,515	5,688,552	1.8	—	1.2	0.5	0.1
オーストリア	27,080	24,164	3,870,461	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フィンランド	12,290	10,761	1,723,691	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	12,890	11,492	1,840,695	0.6	—	0.4	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 110,490	千イギリスポンド 90,688	17,014,884	5.3	—	3.7	1.1	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 46,900	千スウェーデンクローネ 45,124	637,603	0.2	—	0.1	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 41,680	千ノルウェークローネ 38,552	545,899	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 45,020	千デンマーククローネ 42,051	903,276	0.3	—	0.2	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 49,970	千ポーランドズロチ 46,352	1,696,862	0.5	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 52,390	千オーストラリアドル 46,785	4,548,912	1.4	—	1.0	0.3	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 9,800	千ニュージーランドドル 8,345	752,745	0.2	—	0.2	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 12,390	千シンガポールドル 11,916	1,312,839	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,080	千マレーシアリンギット 52,297	1,629,793	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 1,243,000	千中国元 1,279,376	26,325,476	8.2	—	3.6	3.1	1.5
イスラエル	千イスラエルシェケル 28,680	千イスラエルシェケル 26,479	1,055,351	0.3	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	327,499,360	101.9	—	51.5	35.1	15.4

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	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	0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,200	4,909	725,197	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250630	0.25	4,000	3,767	556,425	2025/6/30
	0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,000	4,693	693,194	2025/7/31
	0.25 T-NOTE 250831	0.25	4,290	4,014	592,929	2025/8/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	5,050	4,712	696,033	2025/9/30
	0.25 T-NOTE 251031	0.25	4,000	3,722	549,755	2025/10/31
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,000	3,794	560,406	2025/4/30
	0.375 T-NOTE 251130	0.375	4,000	3,720	549,455	2025/11/30
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	6,000	5,566	822,158	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	6,600	6,104	901,594	2026/1/31
	0.375 T-NOTE 270731	0.375	4,000	3,520	519,938	2027/7/31
	0.375 T-NOTE 270930	0.375	4,200	3,675	542,942	2027/9/30
	0.5 T-NOTE 250331	0.5	2,200	2,096	309,695	2025/3/31
	0.5 T-NOTE 260228	0.5	4,700	4,346	642,044	2026/2/28
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	4,200	3,744	552,999	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270531	0.5	4,200	3,733	551,399	2027/5/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	3,500	3,102	458,308	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	3,850	3,394	501,407	2027/8/31
	0.5 T-NOTE 271031	0.5	5,200	4,560	673,535	2027/10/31
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	6,700	6,137	906,499	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	1,500	1,346	198,880	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271130	0.625	4,500	3,954	584,152	2027/11/30
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	5,480	4,803	709,454	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	8,200	6,640	980,857	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	11,200	8,992	1,328,173	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	4,300	3,991	589,597	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260430	0.75	4,300	3,980	587,873	2026/4/30
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	6,000	5,540	818,367	2026/5/31
	0.75 T-NOTE 260831	0.75	6,000	5,500	812,430	2026/8/31
	0.75 T-NOTE 280131	0.75	3,800	3,339	493,262	2028/1/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	5,000	4,623	682,953	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 260930	0.875	4,000	3,673	542,532	2026/9/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	10,300	8,373	1,236,718	2030/11/15
	1 T-NOTE 280731	1.0	4,950	4,334	640,182	2028/7/31
	1.125 T-BOND 400515	1.125	4,520	2,799	413,497	2040/5/15
	1.125 T-BOND 400815	1.125	3,950	2,419	357,296	2040/8/15
	1.125 T-NOTE 250115	1.125	4,500	4,345	641,807	2025/1/15
	1.125 T-NOTE 261031	1.125	5,100	4,702	694,523	2026/10/31
	1.125 T-NOTE 270228	1.125	1,900	1,737	256,639	2027/2/28
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	6,400	5,700	841,945	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	6,900	6,063	895,520	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	10,300	8,494	1,254,635	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	5,750	2,898	428,137	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	5,700	5,262	777,301	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 261231	1.25	6,150	5,671	837,620	2026/12/31
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	5,590	4,994	737,708	2028/3/31

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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.25 T-NOTE 280430	1.25	6,000	5,348	790,033	2028/4/30
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	7,950	7,072	1,044,569	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	6,900	6,125	904,736	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	7,300	6,439	951,120	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	11,260	9,199	1,358,806	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	5,200	3,312	489,280	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	6,440	3,357	495,918	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	4,000	3,867	571,234	2025/1/31
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	2,200	2,050	302,841	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	4,840	4,286	633,104	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 281231	1.375	6,000	5,292	781,759	2028/12/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	10,390	8,514	1,257,535	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 250215	1.5	5,000	4,833	713,871	2025/2/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,678	691,045	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	7,200	6,671	985,405	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	4,900	4,358	643,681	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	5,880	5,075	749,705	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	6,650	3,713	548,442	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,920	4,663	688,816	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	5,600	5,283	780,432	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,950	1,826	269,845	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	1,600	1,495	220,940	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,200	2,053	303,374	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	4,900	4,326	639,087	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	10,280	8,704	1,285,679	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	7,380	4,936	729,167	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	6,200	6,000	886,336	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	1,510	1,412	208,669	2026/12/31
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	5,100	4,575	675,868	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	4,000	3,540	522,973	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	6,650	4,597	678,987	2041/2/15
	1.875 T-BOND 510215	1.875	7,300	4,348	642,208	2051/2/15
	1.875 T-BOND 511115	1.875	6,540	3,877	572,726	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 260630	1.875	2,700	2,558	377,939	2026/6/30
	1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,700	2,553	377,152	2026/7/31
	1.875 T-NOTE 270228	1.875	5,300	4,959	732,462	2027/2/28
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,500	4,957	732,257	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	10,400	8,819	1,302,697	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	5,970	4,158	614,155	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	5,300	3,285	485,219	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	7,630	4,679	691,093	2051/8/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,664	688,945	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,150	4,961	732,858	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,000	4,719	697,045	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,100	4,942	730,053	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,400	1,335	197,289	2026/5/31
	2.25 T-BOND 410515	2.25	5,990	4,393	648,992	2041/5/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	2.25 T-BOND 460815	2.25	3,300	2,242	331,276	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	4,120	2,720	401,827	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	6,290	4,096	605,105	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,400	6,165	910,607	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	3,250	3,116	460,252	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	3,978	587,578	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,800	4,511	666,394	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,200	3,933	580,987	2027/11/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	5,000	3,694	545,739	2042/2/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	4,160	2,821	416,745	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	6,950	4,673	690,251	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 260430	2.375	2,100	2,016	297,884	2026/4/30
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	5,800	5,493	811,367	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	4,650	4,290	633,725	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	3,940	3,629	536,110	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,380	2,458	363,118	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	2,760	1,983	292,944	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	2,570	1,841	272,021	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,700	2,640	389,945	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,000	2,893	427,401	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	4,500	4,288	633,442	2027/3/31
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,900	3,811	562,889	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 250415	2.625	3,100	3,026	447,040	2025/4/15
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	2,700	2,616	386,421	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	1,600	1,549	228,796	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 270531	2.625	4,900	4,676	690,723	2027/5/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	5,030	4,707	695,336	2029/2/15
	2.625 T-NOTE 290731	2.625	2,800	2,604	384,618	2029/7/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	1,430	1,117	165,086	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,200	1,714	253,250	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	3,040	2,259	333,783	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	3,400	2,522	372,623	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	5,000	4,897	723,297	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250515	2.75	4,000	3,908	577,276	2025/5/15
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	3,000	2,921	431,555	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	3,200	3,069	453,383	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 270731	2.75	5,550	5,310	784,367	2027/7/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,650	6,327	934,514	2028/2/15
	2.75 T-NOTE 290531	2.75	5,000	4,690	692,776	2029/5/31
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	10,600	9,558	1,411,748	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	2,950	2,333	344,648	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	2,000	1,549	228,877	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	1,370	1,049	154,990	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	4,600	3,470	512,590	2049/5/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	5,800	4,355	643,247	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	4,800	4,698	693,936	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250531	2.875	6,000	5,868	866,848	2025/5/31

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	2.875 T-NOTE 250615	2.875	4,100	4,009	592,252	2025/6/15
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	3,500	3,418	504,945	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	4,500	4,381	647,163	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	6,600	6,296	930,039	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,160	5,863	866,081	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 290430	2.875	4,500	4,252	628,094	2029/4/30
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	9,900	9,040	1,335,341	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,310	1,068	157,812	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	2,100	1,673	247,142	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	1,800	1,428	210,958	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	760	600	88,731	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	2,880	2,252	332,624	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,050	1,600	236,361	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,880	3,014	445,275	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	4,480	3,472	512,814	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	4,700	3,635	537,007	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	6,300	4,855	717,219	2052/8/15
	3 T-NOTE 250715	3.0	4,100	4,013	592,808	2025/7/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	3,500	3,419	505,116	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,000	2,929	432,723	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,550	1,296	191,478	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,340	1,118	165,172	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,850	1,525	225,373	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,090	2,520	372,325	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,810	3,026	446,969	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	7,300	7,154	1,056,687	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	5,000	4,842	715,176	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	5,270	5,061	747,547	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	3,250	3,098	457,711	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	4,200	3,554	524,999	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	4,500	4,382	647,345	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	4,100	3,941	582,115	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	4,040	3,476	513,518	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,850	1,573	232,413	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	4,150	3,444	508,716	2048/11/15
	3.375 T-NOTE 330515	3.375	9,730	9,172	1,354,711	2033/5/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	700	639	94,486	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	3,450	3,398	502,030	2025/9/15
	3.5 T-NOTE 280131	3.5	5,400	5,290	781,363	2028/1/31
	3.5 T-NOTE 280430	3.5	5,100	4,991	737,263	2028/4/30
	3.5 T-NOTE 300131	3.5	3,500	3,393	501,209	2030/1/31
	3.5 T-NOTE 300430	3.5	2,500	2,420	357,494	2030/4/30
	3.5 T-NOTE 330215	3.5	9,650	9,199	1,358,772	2033/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,230	1,977	292,098	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	2,400	2,124	313,756	2044/2/15
	3.625 T-BOND 530215	3.625	5,910	5,160	762,208	2053/2/15
	3.625 T-BOND 530515	3.625	5,350	4,675	690,556	2053/5/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.625 T-NOTE 260515	3.625	4,300	4,243	626,798	2026/5/15
	3.625 T-NOTE 280331	3.625	5,000	4,919	726,629	2028/3/31
	3.625 T-NOTE 280531	3.625	2,300	2,262	334,156	2028/5/31
	3.625 T-NOTE 300331	3.625	3,590	3,501	517,131	2030/3/31
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,200	1,099	162,437	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,210	1,993	294,495	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 260415	3.75	3,900	3,858	569,864	2026/4/15
	3.75 T-NOTE 300531	3.75	2,900	2,846	420,365	2030/5/31
	3.75 T-NOTE 300630	3.75	4,890	4,798	708,668	2030/6/30
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,610	1,512	223,413	2040/8/15
	3.875 T-BOND 430215	3.875	4,000	3,683	544,101	2043/2/15
	3.875 T-BOND 430515	3.875	3,760	3,459	510,967	2043/5/15
	3.875 T-NOTE 250331	3.875	4,000	3,964	585,572	2025/3/31
	3.875 T-NOTE 250430	3.875	4,000	3,963	585,457	2025/4/30
	3.875 T-NOTE 260115	3.875	5,100	5,057	747,031	2026/1/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	4,480	4,449	657,198	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 271231	3.875	5,400	5,364	792,377	2027/12/31
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	3,650	3,614	533,903	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	3,060	3,028	447,301	2029/11/30
	3.875 T-NOTE 291231	3.875	3,350	3,315	489,653	2029/12/31
	3.875 T-NOTE 330815	3.875	8,940	8,765	1,294,648	2033/8/15
	4 T-BOND 421115	4.0	3,640	3,419	504,992	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	5,690	5,319	785,720	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	1,800	1,788	264,162	2025/12/15
	4 T-NOTE 260215	4.0	3,900	3,877	572,688	2026/2/15
	4 T-NOTE 280229	4.0	3,400	3,393	501,189	2028/2/29
	4 T-NOTE 280630	4.0	4,000	3,994	589,946	2028/6/30
	4 T-NOTE 291031	4.0	2,840	2,829	417,985	2029/10/31
	4 T-NOTE 300228	4.0	3,490	3,475	513,258	2030/2/28
	4 T-NOTE 300731	4.0	3,500	3,483	514,486	2030/7/31
	4.125 T-BOND 530815	4.125	6,200	5,933	876,320	2053/8/15
	4.125 T-NOTE 260615	4.125	5,000	4,989	737,014	2026/6/15
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	4,200	4,208	621,587	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	2,950	2,955	436,540	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 280731	4.125	2,970	2,981	440,365	2028/7/31
	4.125 T-NOTE 300831	4.125	2,060	2,063	304,844	2030/8/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	10,640	10,642	1,571,896	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,300	1,292	190,911	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,410	1,385	204,689	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 241231	4.25	1,000	994	146,921	2024/12/31
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	3,000	2,991	441,897	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	790	803	118,706	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,280	1,286	189,968	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,050	1,051	155,275	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	780	775	114,596	2041/5/15
	4.375 T-BOND 430815	4.375	4,410	4,344	641,739	2043/8/15
	4.375 T-NOTE 260815	4.375	3,500	3,515	519,302	2026/8/15

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 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	4.375 T-NOTE 261215	4.375	5,500	5,536	817,807	2026/12/15
	4.375 T-NOTE 280831	4.375	3,740	3,793	560,338	2028/8/31
	4.375 T-NOTE 281130	4.375	5,900	5,992	885,114	2028/11/30
	4.375 T-NOTE 301130	4.375	4,200	4,269	630,614	2030/11/30
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	937	138,408	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	550	565	83,522	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,400	1,429	211,101	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 251115	4.5	3,000	3,006	443,991	2025/11/15
	4.5 T-NOTE 260715	4.5	3,600	3,625	535,417	2026/7/15
	4.5 T-NOTE 331115	4.5	8,300	8,549	1,262,783	2033/11/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,330	1,373	202,863	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 250228	4.625	7,000	6,993	1,032,991	2025/2/28
	4.625 T-NOTE 250630	4.625	4,700	4,707	695,301	2025/6/30
	4.625 T-NOTE 260315	4.625	5,300	5,337	788,314	2026/3/15
	4.625 T-NOTE 260915	4.625	5,100	5,156	761,685	2026/9/15
	4.625 T-NOTE 261015	4.625	5,240	5,302	783,123	2026/10/15
	4.625 T-NOTE 261115	4.625	5,000	5,062	747,788	2026/11/15
	4.625 T-NOTE 280930	4.625	4,200	4,304	635,751	2028/9/30
	4.625 T-NOTE 300930	4.625	4,650	4,794	708,079	2030/9/30
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,260	1,313	194,011	2041/2/15
	4.75 T-BOND 431115	4.75	1,550	1,605	237,072	2043/11/15
	4.75 T-BOND 531115	4.75	4,300	4,569	674,903	2053/11/15
	4.75 T-NOTE 250731	4.75	4,500	4,517	667,220	2025/7/31
	4.875 T-NOTE 251130	4.875	6,000	6,053	894,058	2025/11/30
	4.875 T-NOTE 281031	4.875	5,500	5,698	841,702	2028/10/31
	4.875 T-NOTE 301031	4.875	3,350	3,503	517,447	2030/10/31
	5 T-BOND 370515	5.0	580	630	93,088	2037/5/15
	5 T-NOTE 250831	5.0	1,800	1,814	267,978	2025/8/31
	5 T-NOTE 250930	5.0	4,030	4,066	600,648	2025/9/30
	5 T-NOTE 251031	5.0	5,000	5,050	745,913	2025/10/31
	5.25 T-BOND 281115	5.25	1,000	1,052	155,523	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	520	563	83,227	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,100	1,135	167,775	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	800	857	126,648	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	660	738	109,092	2030/5/15
小	計				155,608,233	
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	1,112	121,890	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,500	2,358	258,448	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	2,700	2,220	243,356	2030/12/1
	1 CAN GOVT 260901	1.0	1,300	1,211	132,761	2026/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	600	551	60,447	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	850	820	89,969	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	3,200	2,975	326,091	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	3,270	2,864	313,989	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	966	105,903	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,150	1,089	119,431	2026/6/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	3,700	3,232	354,263	2031/6/1	
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	3,400	2,943	322,606	2031/12/1	
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,970	2,033	222,856	2053/12/1	
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,000	940	103,097	2028/6/1	
	2 CAN GOVT 320601	2.0	2,250	2,012	220,557	2032/6/1	
	2 CAN GOVT 511201	2.0	3,960	2,923	320,369	2051/12/1	
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,600	1,556	170,571	2025/6/1	
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	700	660	72,350	2029/6/1	
	2.25 CAN GOVT 291201	2.25	400	375	41,178	2029/12/1	
	2.5 CAN GOVT 321201	2.5	2,000	1,853	203,138	2032/12/1	
	2.75 CAN GOVT 270901	2.75	2,300	2,232	244,713	2027/9/1	
	2.75 CAN GOVT 330601	2.75	1,700	1,603	175,700	2033/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	970	852	93,462	2048/12/1	
	2.75 CAN GOVT 551201	2.75	1,200	1,037	113,757	2055/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	590	504	55,266	2064/12/1	
	3 CAN GOVT 251001	3.0	3,900	3,823	419,012	2025/10/1	
	3 CAN GOVT 260401	3.0	1,500	1,470	161,205	2026/4/1	
	3.25 CAN GOVT 280901	3.25	1,700	1,680	184,199	2028/9/1	
	3.25 CAN GOVT 331201	3.25	1,810	1,776	194,653	2033/12/1	
	3.5 CAN GOVT 280301	3.5	700	698	76,521	2028/3/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,030	1,029	112,785	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 250201	3.75	2,300	2,279	249,813	2025/2/1	
	4 CAN GOVT 290301	4.0	980	1,003	109,962	2029/3/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	960	1,018	111,679	2041/6/1	
	4.5 CAN GOVT 260201	4.5	2,070	2,089	228,989	2026/2/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	700	809	88,723	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	600	666	73,080	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	910	1,073	117,677	2033/6/1	
小 計					6,614,487		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	8,000	8,459	72,646	2036/11/20	
	5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	23,000	21,890	187,988	2025/3/6	
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	20,000	17,899	153,712	2027/3/4	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	61,350	56,665	486,614	2026/3/5	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	39,750	37,658	323,391	2027/6/3	
	7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	17,000	15,157	130,165	2033/5/26	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	52,000	47,983	412,054	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	9,682	83,144	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	30,900	26,483	227,426	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	27,700	24,107	207,026	2047/11/7	
	8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	18,480	15,905	136,585	2053/7/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	34,900	34,013	292,094	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	22,880	21,379	183,592	2038/11/18	
小 計					2,896,443		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	3,700	3,487	558,570	2026/8/15
		0 BUND 271115	—	2,150	1,979	317,104	2027/11/15

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	0 BUND 281115	—	2,880	2,601	416,677	2028/11/15
		0 BUND 290815	—	2,700	2,401	384,679	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	2,620	2,305	369,264	2030/2/15
		0 BUND 300815	—	3,590	3,125	500,664	2030/8/15
		0 BUND 300815	—	1,200	1,045	167,518	2030/8/15
		0 BUND 310215	—	2,460	2,118	339,341	2031/2/15
		0 BUND 310815	—	3,370	2,869	459,634	2031/8/15
		0 BUND 310815	—	850	724	116,034	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	2,850	2,397	383,938	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	2,420	1,862	298,258	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	2,560	1,912	306,345	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	3,750	1,966	314,994	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	1,210	637	102,141	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	2,900	1,449	232,142	2052/8/15
		0 OBL 250411	—	1,000	965	154,658	2025/4/11
		0 OBL 251010	—	3,200	3,061	490,417	2025/10/10
		0 OBL 251010	—	900	862	138,154	2025/10/10
		0 OBL 260410	—	3,200	3,034	486,081	2026/4/10
		0 OBL 261009	—	1,750	1,644	263,352	2026/10/9
		0 OBL 270416	—	2,000	1,861	298,178	2027/4/16
		0.25 BUND 270215	0.25	3,800	3,577	573,008	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	3,520	3,234	518,034	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	2,800	2,550	408,472	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	3,150	3,066	491,139	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	3,450	3,313	530,751	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	3,260	3,073	492,206	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	2,500	2,340	374,802	2028/2/15
		1 BUND 250815	1.0	3,200	3,116	499,183	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	2,200	1,814	290,697	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	3,700	2,867	459,231	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	2,970	2,875	460,510	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	500	484	77,635	2027/10/15
		1.7 BUND 320815	1.7	2,700	2,597	415,979	2032/8/15
		1.8 BUND 530815	1.8	2,560	2,193	351,396	2053/8/15
1.8 BUND 530815	1.8	480	412	66,009	2053/8/15		
2.1 BUND 291115	2.1	2,700	2,689	430,778	2029/11/15		
2.2 OBL 280413	2.2	2,200	2,199	352,335	2028/4/13		
2.3 BUND 330215	2.3	3,850	3,874	620,643	2033/2/15		
2.3 BUND 330215	2.3	700	704	112,882	2033/2/15		
2.4 BUND 301115	2.4	1,170	1,185	189,890	2030/11/15		
2.4 OBL 281019	2.4	2,220	2,240	358,887	2028/10/19		
2.5 BUND 440704	2.5	2,980	2,966	475,223	2044/7/4		
2.5 BUND 460815	2.5	3,080	3,075	492,610	2046/8/15		
2.5 SCHATS 250313	2.5	1,700	1,689	270,668	2025/3/13		
2.6 BUND 330815	2.6	2,850	2,934	469,990	2033/8/15		
2.8 SCHATS 250612	2.8	2,500	2,496	399,923	2025/6/12		
3.1 SCHATS 250918	3.1	1,750	1,760	281,927	2025/9/18		

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	3.25 BUND 420704	3.25	1,930	2,132	341,597	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,710	3,179	509,288	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,940	2,371	379,836	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,300	1,438	230,456	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,220	2,718	435,368	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,110	2,742	439,222	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	2,290	2,776	444,705	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,850	2,084	333,916	2028/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	1,300	1,591	254,939	2030/1/4
6.5 BUND 270704	6.5	1,070	1,217	194,972	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 260401	—	3,200	3,002	480,873	2026/4/1
		0 ITALY GOVT 260801	—	1,800	1,673	268,010	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	3,400	3,034	486,032	2028/3/15
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,500	1,311	210,058	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,000	1,903	304,918	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	1,400	1,250	200,355	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,230	1,809	289,869	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	1,300	1,224	196,050	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,570	2,158	345,683	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	2,250	2,094	335,460	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	1,980	1,700	272,443	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,100	1,734	277,760	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,170	1,765	282,733	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,550	1,072	171,747	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	2,300	2,172	347,917	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	900	874	140,072	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,200	2,101	336,520	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,200	1,959	313,777	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,300	1,272	203,802	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,350	1,027	164,634	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,280	2,230	357,307	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	1,400	869	139,311	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,550	2,474	396,315	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	1,900	304,421	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	2,600	2,257	361,620	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	1,900	1,135	181,885	2051/9/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,830	1,300	208,234	2041/3/1
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	1,600	1,571	251,733	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,400	1,375	220,309	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,750	1,683	269,644	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,820	1,764	282,669	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,400	1,372	219,907	2026/7/15
2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	850	553	88,700	2052/9/1		
2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	480	286	45,870	2072/3/1		
2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,150	2,098	336,179	2027/6/1		
2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,960	1,624	260,213	2036/9/1		
2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,900	1,711	274,134	2033/9/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,130	806	129,097	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,500	2,479	397,135	2025/11/15
		2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	2,050	1,878	300,819	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	2,090	2,063	330,472	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,950	1,508	241,622	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,810	1,784	285,779	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	2,000	1,957	313,461	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	950	677	108,502	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,490	1,301	208,474	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,250	2,223	356,211	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,530	1,335	213,949	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	1,250	1,135	181,827	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,670	1,424	228,118	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,720	1,637	262,235	2035/3/1
		3.4 ITALY GOVT 250328	3.4	1,200	1,201	192,457	2025/3/28
		3.4 ITALY GOVT 280401	3.4	1,250	1,266	202,796	2028/4/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,930	1,692	271,023	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	1,400	1,413	226,389	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,930	2,961	474,405	2030/3/1
		3.7 ITALY GOVT 300615	3.7	1,850	1,883	301,726	2030/6/15
		3.8 ITALY GOVT 260415	3.8	950	967	154,904	2026/4/15
		3.8 ITALY GOVT 280801	3.8	800	822	131,815	2028/8/1
		3.85 ITALY GOVT 260915	3.85	2,950	3,016	483,227	2026/9/15
		3.85 ITALY GOVT 291215	3.85	1,670	1,717	275,121	2029/12/15
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,220	1,132	181,427	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 301115	4.0	1,200	1,241	198,879	2030/11/15
		4 ITALY GOVT 311030	4.0	800	826	132,435	2031/10/30
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	1,050	1,061	170,012	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,850	2,855	457,418	2037/2/1
		4.1 ITALY GOVT 290201	4.1	500	520	83,420	2029/2/1
		4.2 ITALY GOVT 340301	4.2	1,550	1,604	256,926	2034/3/1
		4.35 ITALY GOVT 331101	4.35	2,000	2,099	336,257	2033/11/1
		4.4 ITALY GOVT 330501	4.4	2,150	2,271	363,885	2033/5/1
		4.45 ITALY GOVT 430901	4.45	900	916	146,778	2043/9/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	4,200	4,328	693,267	2026/3/1
		4.5 ITALY GOVT 531001	4.5	900	911	145,929	2053/10/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,530	2,704	433,250	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,000	2,119	339,420	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,150	2,188	350,453	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,600	2,863	458,575	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,500	2,730	437,364	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,170	2,372	379,949	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,980	3,294	527,606	2029/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,330	2,700	432,477	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,060	3,566	571,220	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,330	3,742	599,451	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,320	1,470	235,482	2026/11/1

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	0 O.A.T 250325	—	5,300	5,117	819,697	2025/3/25
		0 O.A.T 260225	—	4,200	3,981	637,665	2026/2/25
		0 O.A.T 270225	—	4,300	3,986	638,439	2027/2/25
		0 O.A.T 291125	—	4,550	3,939	630,994	2029/11/25
		0 O.A.T 301125	—	6,080	5,120	820,162	2030/11/25
		0 O.A.T 311125	—	5,280	4,316	691,339	2031/11/25
		0 O.A.T 320525	—	3,960	3,186	510,301	2032/5/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	4,250	3,990	639,130	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	5,100	4,940	791,374	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	5,100	4,863	779,060	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	5,580	5,032	806,040	2029/5/25
		0.5 O.A.T 400525	0.5	2,470	1,651	264,508	2040/5/25
		0.5 O.A.T 440625	0.5	2,200	1,324	212,065	2044/6/25
		0.5 O.A.T 720525	0.5	1,270	493	78,972	2072/5/25
		0.75 O.A.T 280225	0.75	4,760	4,444	711,922	2028/2/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	6,070	5,645	904,319	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	6,200	5,717	915,846	2028/11/25
		0.75 O.A.T 520525	0.75	3,170	1,723	276,053	2052/5/25
		0.75 O.A.T 530525	0.75	3,080	1,639	262,568	2053/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	4,200	4,073	652,435	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	4,500	4,289	687,033	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	4,300	3,706	593,686	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	4,660	3,850	616,677	2036/5/25
		1.25 O.A.T 380525	1.25	1,300	1,029	164,850	2038/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	5,870	5,456	873,938	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	3,360	2,331	373,499	2050/5/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	3,250	2,739	438,743	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,660	1,125	180,212	2066/5/25
		2 O.A.T 321125	2.0	4,650	4,401	705,026	2032/11/25
		2 O.A.T 480525	2.0	3,060	2,427	388,794	2048/5/25
		2.5 O.A.T 260924	2.5	4,900	4,891	783,546	2026/9/24
		2.5 O.A.T 300525	2.5	6,020	6,012	962,970	2030/5/25
		2.5 O.A.T 430525	2.5	1,540	1,385	221,838	2043/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	4,780	4,823	772,632	2027/10/25
		2.75 O.A.T 290225	2.75	3,240	3,276	524,733	2029/2/25
		3 O.A.T 330525	3.0	3,650	3,730	597,511	2033/5/25
		3 O.A.T 540525	3.0	2,140	2,012	322,375	2054/5/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	3,020	3,039	486,827	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	4,900	4,995	800,063	2026/4/25
		3.5 O.A.T 331125	3.5	1,240	1,316	210,846	2033/11/25
4 O.A.T 381025	4.0	2,770	3,087	494,498	2038/10/25		
4 O.A.T 550425	4.0	1,960	2,222	355,991	2055/4/25		
4 O.A.T 600425	4.0	1,970	2,263	362,612	2060/4/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	3,750	4,436	710,594	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	3,010	3,547	568,123	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	3,940	4,506	721,758	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	3,420	4,221	676,148	2032/10/25		

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	6 O.A.T 251025	6.0	2,600	2,740	438,926	2025/10/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	1,010	960	153,774	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	1,450	1,351	216,453	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,880	1,672	267,899	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	1,500	1,285	205,908	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	1,550	1,295	207,437	2031/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	1,200	821	131,599	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,770	856	137,122	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,250	1,205	193,010	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	960	856	137,191	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,390	2,279	365,045	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	1,320	1,121	179,557	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,610	1,150	184,350	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,750	1,656	265,332	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,700	1,584	253,786	2028/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	850	729	116,776	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 300115	2.5	600	602	96,508	2030/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,750	1,747	279,876	2033/1/15
		2.5 NETH GOVT 330715	2.5	750	746	119,514	2033/7/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,960	1,972	315,864	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 440115	3.25	490	527	84,426	2044/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,910	2,175	348,478	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,650	1,879	301,016	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,400	1,561	250,130	2028/1/15
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,399	384,389	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	1,500	1,418	227,148	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	1,900	1,751	280,605	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	3,380	3,033	485,948	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,500	2,041	326,930	2031/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	2,800	2,426	388,577	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	2,170	1,800	288,357	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,350	2,075	332,396	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	2,470	2,054	328,998	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,600	2,434	389,924	2027/7/30
		0.8 SPAIN GOVT 290730	0.8	2,700	2,424	388,386	2029/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,320	949	152,131	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	1,310	846	135,530	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	2,210	1,186	190,076	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	1,850	1,289	206,492	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	2,630	2,365	378,808	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	2,500	2,406	385,375	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,750	2,604	417,122	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	2,250	2,123	340,186	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,050	1,957	313,604	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	2,020	1,890	302,797	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	870	418	67,064	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	2,550	2,453	393,042	2027/4/30

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		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
スペイン	国債証券	1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,700	1,668	267,251	2025/4/30	
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	2,140	1,842	295,091	2035/7/30	
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,910	1,264	202,509	2052/10/31	
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	2,500	2,454	393,076	2026/4/30	
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,500	2,363	378,537	2030/7/30	
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,700	2,668	427,335	2025/10/31	
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,080	1,945	311,579	2033/7/30	
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	2,500	2,399	384,299	2032/10/31	
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,800	1,492	238,992	2048/10/31	
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	3,000	2,999	480,473	2026/5/31	
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,970	1,719	275,431	2046/10/31	
		3.15 SPAIN GOVT 330430	3.15	2,500	2,501	400,612	2033/4/30	
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	1,150	1,104	176,953	2043/7/30	
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,360	1,222	195,749	2066/7/30	
		3.5 SPAIN GOVT 290531	3.5	550	568	91,040	2029/5/31	
		3.55 SPAIN GOVT 331031	3.55	2,470	2,542	407,285	2033/10/31	
		3.9 SPAIN GOVT 390730	3.9	1,050	1,085	173,827	2039/7/30	
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,190	2,369	379,579	2037/1/31	
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	3,000	3,071	491,959	2025/7/30	
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,230	2,535	406,106	2041/7/30	
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,970	2,277	364,719	2040/7/30	
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,000	2,211	354,170	2028/10/31	
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,560	1,881	301,334	2044/10/31	
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,000	2,403	384,912	2032/7/30	
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,450	2,631	421,446	2026/7/30	
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,600	2,988	478,623	2029/1/31	
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	800	729	116,918	2027/10/22	
		0 BEL GOVT 311022	—	1,350	1,100	176,315	2031/10/22	
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,370	1,173	187,950	2030/6/22	
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	1,900	1,563	250,433	2032/6/22	
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	1,010	653	104,632	2040/6/22	
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	720	301	48,250	2071/6/22	
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,130	1,097	175,814	2025/6/22	
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,990	1,881	301,426	2027/6/22	
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,500	1,397	223,775	2028/6/22	
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	1,800	1,655	265,240	2029/6/22	
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,900	1,831	293,286	2026/6/22	
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,900	1,691	270,867	2031/6/22	
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	970	854	136,876	2033/4/22	
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	930	595	95,379	2053/6/22	
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	610	502	80,523	2037/6/22	
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	960	695	111,425	2047/6/22	
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,110	793	127,061	2050/6/22	
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	870	748	119,873	2038/6/22	
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	830	623	99,871	2066/6/22	
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	800	625	100,258	2057/6/22	
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	500	476	76,276	2039/4/22	

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		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
ベルギー	国債証券	3 BEL GOVT 330622	3.0	1,320	1,341	214,795	2033/6/22	
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,040	1,051	168,497	2034/6/22	
		3.3 BEL GOVT 540622	3.3	1,000	980	157,107	2054/6/22	
		3.45 BEL GOVT 430622	3.45	350	358	57,481	2043/6/22	
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,090	1,168	187,207	2045/6/22	
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,310	1,434	229,689	2032/3/28	
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,730	1,968	315,363	2041/3/28	
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,200	1,246	199,613	2026/3/28	
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,000	2,388	382,589	2035/3/28	
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,310	2,583	413,750	2028/3/28			
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	—	1,000	964	154,534	2025/4/20	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	1,230	1,092	174,984	2028/10/20	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,250	1,071	171,698	2030/2/20	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,300	1,081	173,172	2031/2/20	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	470	284	45,555	2040/10/20	
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	1,350	965	154,643	2036/10/20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,440	1,351	216,516	2027/4/20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,700	1,536	246,058	2029/2/20	
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	450	200	32,105	2071/4/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,500	1,429	228,906	2026/10/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,150	1,072	171,782	2028/2/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	1,240	719	115,235	2051/3/20	
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	450	196	31,481	2120/6/30	
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	1,300	1,130	181,120	2032/2/20	
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	400	389	62,444	2025/10/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	1,060	783	125,471	2047/2/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	310	183	29,463	2086/11/2	
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	260	203	32,640	2049/5/23	
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	500	493	78,979	2026/7/15	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	500	369	59,238	2117/9/20	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	660	635	101,708	2034/5/23			
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	2.9	500	509	81,543	2029/5/23			
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2.9	1,630	1,646	263,764	2033/2/20			
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	880	886	141,977	2044/6/20			
3.15 AUSTRIA GOVT 531020	3.15	230	230	36,974	2053/10/20			
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	470	539	86,352	2062/1/26			
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	1,515	242,766	2037/3/15			
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,600	1,671	267,679	2026/3/15			
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,009	161,660	2027/7/15			
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 260915	—	420	392	62,931	2026/9/15	
		0 FINNISH GOVT 300915	—	400	337	54,029	2030/9/15	
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	500	413	66,217	2031/9/15	
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	500	356	57,176	2036/4/15	
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	580	270	43,257	2052/4/15	
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	390	249	39,912	2040/9/15	
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	1,050	1,003	160,723	2026/4/15	
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	550	512	82,066	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 280915	0.5	660	602	96,484	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	480	429	68,727	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	610	384	61,647	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	600	526	84,356	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	485	77,731	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	330	281	45,015	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	300	289	46,380	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	450	328	52,553	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	700	635	101,730	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	480	451	72,372	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	596	95,488	2028/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 380415	2.75	430	416	66,693	2038/4/15
		2.875 FINNISH GOV 290415	2.875	800	812	130,116	2029/4/15
		3 FINNISH GOVT 330915	3.0	520	529	84,869	2033/9/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	450	457	73,207	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	750	620	99,321	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	830	773	123,832	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	700	603	96,702	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	700	580	92,979	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	550	427	68,475	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	430	292	46,839	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	950	893	143,185	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	700	676	108,402	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	820	766	122,808	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	563	90,203	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	460	427	68,392	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	990	718	115,073	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	700	611	97,962	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,090	916	146,870	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,130	1,127	180,539	2030/5/15
		3 IRISH GOVT 431018	3.0	260	262	42,120	2043/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,200	1,229	196,985	2025/3/13
小 計						105,956,551	
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 260130	0.125	1,900	1,755	329,439	2026/1/30	
	0.125 GILT 280131	0.125	1,210	1,043	195,874	2028/1/31	
	0.25 GILT 250131	0.25	1,750	1,674	314,117	2025/1/31	
	0.25 GILT 310731	0.25	3,050	2,335	438,164	2031/7/31	
	0.375 GILT 261022	0.375	3,270	2,965	556,331	2026/10/22	
	0.375 GILT 301022	0.375	1,670	1,331	249,882	2030/10/22	
	0.5 GILT 290131	0.5	2,880	2,445	458,861	2029/1/31	
	0.5 GILT 611022	0.5	2,420	713	133,896	2061/10/22	
	0.625 GILT 250607	0.625	2,050	1,948	365,486	2025/6/7	
	0.625 GILT 350731	0.625	2,230	1,517	284,758	2035/7/31	
	0.625 GILT 501022	0.625	1,730	690	129,638	2050/10/22	
	0.875 GILT 291022	0.875	1,880	1,599	300,154	2029/10/22	
	0.875 GILT 330731	0.875	2,700	2,036	382,007	2033/7/31	

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	
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券					
	0.875 GILT 460131	0.875	1,490	734	137,875	2046/1/31
	1 GILT 320131	1.0	3,330	2,668	500,655	2032/1/31
	1.125 GILT 390131	1.125	2,460	1,584	297,281	2039/1/31
	1.125 GILT 731022	1.125	1,210	441	82,746	2073/10/22
	1.25 GILT 270722	1.25	1,700	1,555	291,788	2027/7/22
	1.25 GILT 411022	1.25	2,380	1,451	272,297	2041/10/22
	1.25 GILT 510731	1.25	2,620	1,272	238,801	2051/7/31
	1.5 GILT 260722	1.5	2,370	2,231	418,589	2026/7/22
	1.5 GILT 470722	1.5	1,860	1,044	195,878	2047/7/22
	1.5 GILT 530731	1.5	1,470	745	139,951	2053/7/31
	1.625 GILT 281022	1.625	1,500	1,360	255,286	2028/10/22
	1.625 GILT 541022	1.625	1,340	698	131,010	2054/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	1,630	751	141,002	2071/10/22
	1.75 GILT 370907	1.75	2,100	1,555	291,916	2037/9/7
	1.75 GILT 490122	1.75	1,260	735	137,963	2049/1/22
	1.75 GILT 570722	1.75	1,970	1,041	195,487	2057/7/22
	2 GILT 250907	2.0	1,200	1,156	216,909	2025/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	1,430	908	170,368	2065/7/22
	3.25 GILT 330131	3.25	3,090	2,922	548,236	2033/1/31
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	1,826	342,635	2044/1/22
	3.5 GILT 251022	3.5	1,000	985	184,927	2025/10/22
	3.5 GILT 450122	3.5	1,980	1,698	318,587	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,530	1,255	235,560	2068/7/22
	3.75 GILT 380129	3.75	1,780	1,673	313,892	2038/1/29
	3.75 GILT 520722	3.75	1,250	1,088	204,200	2052/7/22
	3.75 GILT 531022	3.75	2,950	2,552	478,980	2053/10/22
	4 GILT 600122	4.0	1,240	1,130	212,012	2060/1/22
	4 GILT 631022	4.0	890	808	151,652	2063/10/22
	4.125 GILT 270129	4.125	3,480	3,489	654,707	2027/1/29
	4.25 GILT 271207	4.25	1,860	1,882	353,256	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	2,210	2,266	425,317	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,910	1,923	360,970	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,320	1,297	243,423	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	1,610	1,573	295,150	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,840	1,755	329,409	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,290	1,225	229,879	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,790	1,698	318,644	2055/12/7
	4.5 GILT 280607	4.5	2,030	2,077	389,856	2028/6/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,390	1,439	270,021	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,930	1,930	362,124	2042/12/7
	4.625 GILT 340131	4.625	940	984	184,651	2034/1/31
	4.75 GILT 301207	4.75	2,070	2,183	409,673	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,430	1,492	280,014	2038/12/7
	4.75 GILT 431022	4.75	690	709	133,043	2043/10/22
	5 GILT 250307	5.0	1,830	1,836	344,629	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	900	986	184,996	2028/12/7
小	計				17,014,884	

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		
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	千円	
国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	5,300	4,564	64,490	2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	4,000	3,759	53,114	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	12,700	11,721	165,622	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	5,913	83,557	2026/11/12
	1.75 SWD GOVT 331111	1.75	2,000	1,911	27,013	2033/11/11
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	5,500	5,497	77,677	2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,154	101,093	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,050	4,602	65,033	2039/3/30
小計					637,603	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,212	45,491	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	5,400	4,725	66,919	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,725	38,592	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	6,300	6,138	86,921	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,027	57,025	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,500	3,191	45,197	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,650	2,495	35,336	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	6,800	6,088	86,207	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 330815	3.0	4,000	3,805	53,882	2033/8/15
	3.5 NORWE GOVT 421006	3.5	2,130	2,141	30,323	2042/10/6
小計					545,899	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	0 DMK GOVT 311115	—	8,400	7,024	150,880	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	6,400	3,445	74,011	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,900	6,451	138,583	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	7,300	6,594	141,644	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,500	5,418	116,397	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	10,520	13,117	281,759	2039/11/15
小計					903,276	
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	3,524	129,034	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	1,000	950	34,782	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,400	3,441	125,968	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	4,000	3,078	112,711	2032/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	9,800	9,239	338,243	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,300	2,119	77,585	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,378	123,673	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	4,300	3,808	139,415	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,460	126,691	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,849	140,913	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,435	52,568	2029/4/25
	6 POLAND 331025	6.0	3,320	3,476	127,253	2033/10/25
	7.5 POLAND 280725	7.5	4,200	4,589	168,021	2028/7/25
小計					1,696,862	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	1,450	1,358	132,085	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	1,600	1,468	142,770	2026/9/21

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		
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	1 AUST GOVT 301221	1.0	2,340	1,914	186,189	2030/12/21
		1 AUST GOVT 311121	1.0	3,000	2,377	231,177	2031/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,610	2,078	202,120	2032/5/21
		1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,550	2,131	207,272	2031/6/21
		1.75 AUST GOVT 321121	1.75	3,160	2,592	252,069	2032/11/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1.75	2,150	1,194	116,162	2051/6/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,400	1,313	127,682	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	2,300	2,110	205,215	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,500	1,444	140,441	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,150	1,095	106,470	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,280	1,201	116,860	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	2,000	1,722	167,433	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,490	1,171	113,890	2041/5/21
		3 AUST GOVT 331121	3.0	2,100	1,892	183,996	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,380	1,062	103,293	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,200	2,179	211,899	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,600	2,522	245,252	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	800	692	67,301	2039/6/21
		3.5 AUST GOVT 341221	3.5	1,190	1,109	107,890	2034/12/21
		3.75 AUST GOVT 340521	3.75	2,400	2,299	223,544	2034/5/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	960	899	87,498	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,950	2,975	289,305	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,240	2,287	222,402	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,800	2,880	280,082	2027/4/21
		4.75 AUST GOVT 540621	4.75	790	808	78,601	2054/6/21
小	計					4,548,912	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	0.25	1,400	1,173	105,832	2028/5/15
		1.5 NZ GOVT 310515	1.5	1,000	810	73,147	2031/5/15
		1.75 NZ GOVT 410515	1.75	600	375	33,903	2041/5/15
		2 NZ GOVT 320515	2.0	1,200	984	88,798	2032/5/15
		2.75 NZ GOVT 250415	2.75	900	875	78,929	2025/4/15
		2.75 NZ GOVT 370415	2.75	1,100	872	78,734	2037/4/15
		2.75 NZ GOVT 510515	2.75	700	466	42,105	2051/5/15
		3 NZ GOVT 290420	3.0	800	747	67,391	2029/4/20
		3.5 NZ GOVT 330414	3.5	700	638	57,615	2033/4/14
		4.5 NZ GOVT 270415	4.5	800	800	72,176	2027/4/15
		4.5 NZ GOVT 300515	4.5	600	599	54,109	2030/5/15
小	計					752,745	
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 SINGAPORGGOVT 261101	1.25	550	524	57,745	2026/11/1
		1.625 SINGAPORGGOV 310701	1.625	500	456	50,237	2031/7/1
		1.875 SINGAPORGGOV 500301	1.875	840	680	74,959	2050/3/1
		1.875 SINGAPORGGOV 511001	1.875	460	374	41,261	2051/10/1
		2.125 SINGAPORGGOV 260601	2.125	1,000	976	107,614	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGGOVT 360801	2.25	1,000	925	101,907	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGGOV 250601	2.375	800	789	86,937	2025/6/1

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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	250	231	25,533	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	250	247	27,247	2028/5/1
		2.625 SINGAPORGOV 320801	2.625	900	877	96,624	2032/8/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	700	679	74,879	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	660	637	70,239	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 270901	2.875	1,100	1,097	120,944	2027/9/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	947	104,399	2029/7/1
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	797	87,827	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 720801	3.0	460	475	52,375	2072/8/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	620	68,364	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	570	578	63,738	2027/3/1
小	計					1,312,839	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,500	1,394	43,472	2031/4/15
		3.502 MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	999	31,163	2027/5/31
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	2,300	2,252	70,205	2032/7/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,300	2,310	71,993	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	2,500	2,406	74,982	2040/5/22
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	1,000	997	31,084	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,950	1,942	60,531	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	3,000	3,020	94,115	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,500	2,527	78,764	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	4,500	4,553	141,909	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,500	1,517	47,300	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,500	1,517	47,284	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,025	94,292	2025/9/15
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	3,100	3,017	94,033	2050/6/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	1,200	1,231	38,389	2035/5/31
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	4.457	590	612	19,081	2053/3/31
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,700	1,769	55,155	2030/4/15
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	4.504	1,600	1,664	51,880	2029/4/30
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	2,300	2,452	76,443	2033/11/7
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	2,000	2,155	67,188	2042/10/15
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,200	1,289	40,180	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	4,100	4,412	137,520	2037/4/7
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	1,700	1,866	58,168	2038/6/8
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	1,640	1,813	56,505	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	1,400	1,544	48,145	2043/9/30
小	計					1,629,793	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	20,000	19,964	410,810	2025/4/9
		2 CHINA GOVT 250615	2.0	20,000	19,949	410,496	2025/6/15
		2.18 CHINA GOVT 250825	2.18	16,000	15,996	329,166	2025/8/25
		2.18 CHINA GOVT 260815	2.18	32,000	31,962	657,686	2026/8/15
		2.22 CHINA GOVT 250925	2.22	28,000	28,014	576,451	2025/9/25
		2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	27,000	27,025	556,105	2025/5/25
		2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	10,000	10,018	206,140	2025/2/24

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		
				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	2.28 CHINA GOVT 251125	2.28	26,000	26,045	535,932	2025/11/25
	2.3 CHINA GOVT 260515	2.3	22,000	22,024	453,189	2026/5/15
	2.33 CHINA GOVT 251215	2.33	6,000	6,017	123,824	2025/12/15
	2.35 CHINA GOVT 250315	2.35	23,000	23,060	474,512	2025/3/15
	2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	21,000	21,067	433,499	2027/1/20
	2.39 CHINA GOVT 261115	2.39	13,000	13,050	268,529	2026/11/15
	2.4 CHINA GOVT 280715	2.4	18,000	18,008	370,557	2028/7/15
	2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	13,000	13,048	268,494	2027/10/15
	2.46 CHINA GOVT 260215	2.46	17,000	17,087	351,599	2026/2/15
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	8,000	8,033	165,302	2027/4/15
	2.48 CHINA GOVT 280925	2.48	10,000	10,049	206,777	2028/9/25
	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	18,000	18,100	372,459	2027/7/25
	2.52 CHINA GOVT 330825	2.52	23,000	22,962	472,484	2033/8/25
	2.55 CHINA GOVT 281015	2.55	31,000	31,289	643,829	2028/10/15
	2.6 CHINA GOVT 300915	2.6	26,000	26,192	538,964	2030/9/15
	2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	18,000	18,048	371,385	2032/9/1
	2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	21,000	21,253	437,336	2028/4/15
	2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	15,000	15,156	311,879	2029/9/25
	2.62 CHINA GOVT 300625	2.62	20,000	20,161	414,853	2030/6/25
	2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	18,000	18,207	374,659	2028/1/15
	2.67 CHINA GOVT 330525	2.67	17,000	17,165	353,204	2033/5/25
	2.67 CHINA GOVT 331125	2.67	21,000	21,272	437,716	2033/11/25
	2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	26,000	26,315	541,493	2030/5/21
	2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	21,000	21,235	436,953	2026/8/12
	2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	18,000	18,191	374,328	2032/8/15
	2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,068	104,285	2026/8/4
	2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	15,000	15,267	314,147	2029/6/15
	2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	15,000	15,251	313,820	2032/2/17
	2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	13,000	13,215	271,934	2032/5/15
	2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	20,000	20,382	419,406	2029/12/15
	2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	16,000	16,320	335,819	2029/3/24
	2.8 CHINA GOVT 300325	2.8	17,000	17,316	356,326	2030/3/25
	2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	16,000	16,299	335,388	2032/11/15
	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	25,000	25,446	523,606	2027/6/4
	2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	15,000	15,419	317,288	2033/2/25
	2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	14,000	14,381	295,927	2031/11/18
	2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	11,000	11,175	229,946	2026/5/5
	2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	20,000	20,500	421,838	2028/10/14
	2.99 CHINA GOVT 251015	2.99	3,000	3,045	62,674	2025/10/15
	3 CHINA GOVT 531015	3.0	6,000	6,347	130,602	2053/10/15
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	16,000	16,464	338,794	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	22,000	22,349	459,883	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	23,000	23,804	489,820	2031/5/27
	3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	19,000	19,358	398,327	2026/3/11
	3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	18,000	18,463	379,916	2026/12/5
	3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	9,000	9,555	196,616	2052/10/25
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	16,000	16,636	342,330	2029/11/21

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				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	3.19 CHINA GOVT 530415	3.19	10,000	10,891	224,109	2053/4/15
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	13,000	13,272	273,109	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	21,000	21,547	443,373	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	12,000	12,538	258,007	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	25,000	26,326	541,724	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	26,000	27,036	556,330	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	23,000	24,091	495,732	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	10,000	11,093	228,274	2052/4/15
		3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	21,000	23,325	479,963	2050/3/16
		3.52 CHINA GOVT 270504	3.52	8,000	8,363	172,103	2027/5/4
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	12,000	13,698	281,869	2051/10/18
		3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	7,000	7,408	152,437	2028/8/16
		3.59 CHINA GOVT 270803	3.59	7,000	7,352	151,282	2027/8/3
		3.6 CHINA GOVT 250906	3.6	9,000	9,239	190,110	2025/9/6
		3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	7,000	7,163	147,393	2025/6/7
		3.69 CHINA GOVT 280517	3.69	12,000	12,781	263,011	2028/5/17
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	12,000	14,229	292,804	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	2,000	2,042	42,033	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	20,000	23,796	489,653	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	15,000	17,902	368,378	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	14,000	17,225	354,440	2048/10/22
小	計					26,325,476	
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	3,850	153,464	2025/4/30
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	0.5	1,800	1,688	67,280	2026/2/27
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	3,800	3,186	127,004	2030/3/31
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,500	1,202	47,933	2032/4/30
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	1,800	1,262	50,303	2037/5/31
		1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	1,800	1,754	69,912	2025/8/31
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2.0	2,500	2,403	95,776	2027/3/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	2,000	1,867	74,412	2028/9/28
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	2.8	800	549	21,894	2052/11/29
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	3.75	3,000	3,045	121,387	2029/2/28
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	2,570	2,275	90,698	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	2,410	2,641	105,261	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	700	753	30,021	2026/10/30
小	計					1,055,351	
合	計					327,499,360	

(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

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 327,499,360	% 98.4
コール・ローン等、その他	5,218,745	1.6
投資信託財産総額	332,718,105	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(330,936,094千円)の投資信託財産総額(332,718,105千円)に対する比率は99.5%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=147.70円	1 カナダドル=109.60円	1 メキシコペソ=8.5875円	1 ユーロ=160.17円
1 イギリスポンド=187.62円	1 スウェーデンクローネ=14.13円	1 ノルウェークローネ=14.16円	1 デンマーククローネ=21.48円
1 ポーランドズロチ=36.6078円	1 オーストラリアドル=97.23円	1 ニュージーランドドル=90.20円	1 シンガポールドル=110.17円
1 マレーシアリングギット=31.1638円	1 中国元=20.5768円	1 イスラエルシェケル=39.8548円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	656,265,551,543
コール・ローン等	2,304,340,554
公社債(評価額)	327,499,360,517
未収入金	323,561,274,653
未収利息	2,620,226,515
前払費用	280,349,304
(B) 負債	334,989,352,034
未払金	334,938,387,446
未払解約金	50,964,137
未払利息	451
(C) 純資産総額(A-B)	321,276,199,509
元本	286,889,148,147
次期繰越損益金	34,387,051,362
(D) 受益権総口数	286,889,148,147口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,199円

<注記事項>

- ①期首元本額 197,648,585,205円
期中追加設定元本額 135,350,256,520円
期中一部解約元本額 46,109,693,578円
また、1口当たり純資産額は、期末11,199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)	115,772,811,179円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	61,462,182,613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)	18,135,683,929円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	12,029,007,258円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	11,212,978,694円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	9,564,560,310円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	9,540,120,109円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	6,251,572,488円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIIN)	4,897,190,228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)	4,432,947,151円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,891,227,596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)	3,630,426,677円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	2,808,822,315円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,435,092,729円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,412,645,299円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,406,347,053円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,129,580,674円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	2,100,241,630円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,017,254,605円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	1,050,122,102円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	954,902,605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)	395,801,252円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03(適格機関投資家限定)	388,520,282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)	388,518,761円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05(適格機関投資家限定)	381,708,272円

○損益の状況 (2023年1月27日~2024年1月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	7,537,675,405
受取利息	7,538,494,358
その他収益金	35,522
支払利息	△ 854,475
(B) 有価証券売買損益	△19,965,035,700
売買益	64,531,900,757
売買損	△84,496,936,457
(C) 保管費用等	△ 36,167,071
(D) 当期損益金(A+B+C)	△12,463,527,366
(E) 前期繰越損益金	33,195,522,866
(F) 追加信託差損益金	19,358,192,208
(G) 解約差損益金	△ 5,703,136,346
(H) 計(D+E+F+G)	34,387,051,362
次期繰越損益金(H)	34,387,051,362

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	376,017,480円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	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 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)	336,629,253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
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	308,645,765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)	246,162,165円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	200,465,512円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	91,419,350円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	12,097,422円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	9,438,844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)	774,616円
合計	286,889,148,147円

【お知らせ】

- ①新NISA (成長投資枠) の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年7月3日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)