

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2016年7月1日設定）	
運用方針	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への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、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。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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。	
主要運用対象	ベビーフンド	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。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	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 先進国債券 インデックス（為替ヘッジあり）

第8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 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、去る1月26日に第8期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ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 (分配落)	価 額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、為替ヘッジあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円	円	円	騰	落	%	%	%	百万円
4期(2020年1月27日)	10,106		0			409.73	6.4	97.6	181
5期(2021年1月26日)	10,459		0			427.41	4.3	98.3	282
6期(2022年1月26日)	9,990		0	△	4.5	410.80	△ 3.9	97.0	265
7期(2023年1月26日)	8,650		0	△	13.4	355.93	△ 13.4	97.3	553
8期(2024年1月26日)	8,248		0	△	4.6	341.23	△ 4.1	101.9	1,069

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	騰 落 率 %	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年 1月26日	8,650	—	355.93	—	97.3	—
1 月 末	8,586	△0.7	353.36	△0.7	98.0	—
2 月 末	8,385	△3.1	344.92	△3.1	102.1	—
3 月 末	8,528	△1.4	350.96	△1.4	97.9	—
4 月 末	8,487	△1.9	349.53	△1.8	99.8	—
5 月 末	8,410	△2.8	346.62	△2.6	102.0	—
6 月 末	8,353	△3.4	344.37	△3.2	103.1	—
7 月 末	8,307	△4.0	342.72	△3.7	96.9	—
8 月 末	8,237	△4.8	339.97	△4.5	102.1	—
9 月 末	8,010	△7.4	330.75	△7.1	99.5	—
10 月 末	7,963	△7.9	329.05	△7.6	98.9	—
11 月 末	8,191	△5.3	338.66	△4.9	99.2	—
12 月 末	8,417	△2.7	347.97	△2.2	96.1	—
(期 末) 2024年 1月26日	8,248	△4.6	341.23	△4.1	101.9	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第8期：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8期首	8,650円
第8期末	8,248円
既払分配金	0円
騰落率	-4.6%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.6%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%）を0.5%下回りました。

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。

第8期：2023年1月27日～2024年1月26日

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

▶ eMAXIS 先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）

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

▶ 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。

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

▶ eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は 0.0% 程度でした。

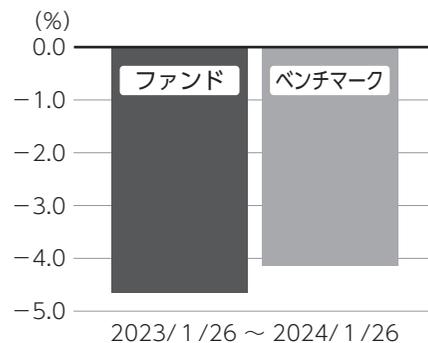
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：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。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第8期 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	998

（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 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマーク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	55	0.660	(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）	(25)	(0.297)	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）	(25)	(0.297)	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)	(0.066)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.016	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（保管費用）	(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
（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	56	0.676	

期中の平均基準価額は、8,315円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

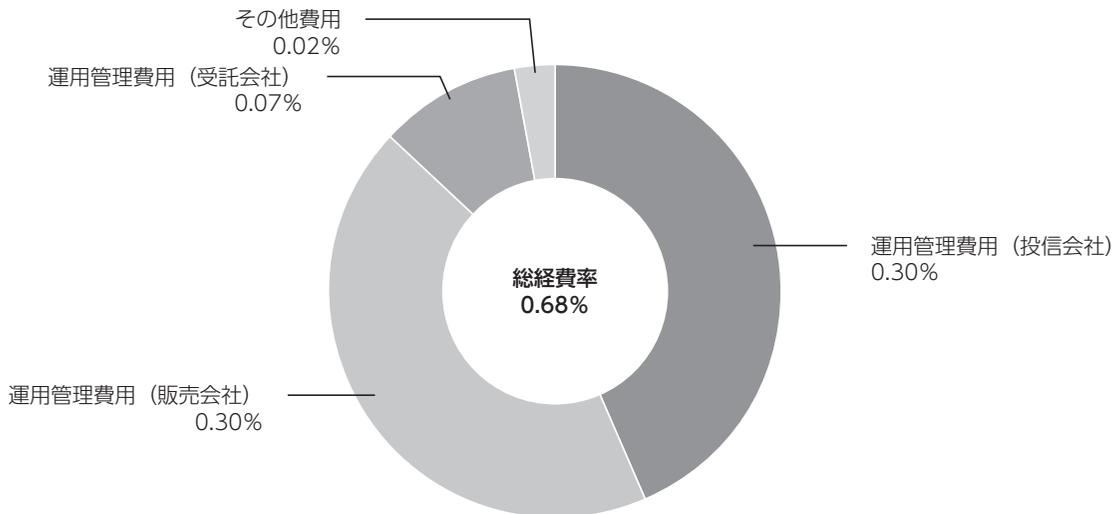
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.68%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 742,466	千円 836,730	千口 260,190	千円 294,093

○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 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり） >
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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
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 0.3%

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

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

○組入資産の明細

(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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 472,626	千口 954,902	千円 1,069,395

○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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,069,395	% 98.7
コール・ローン等、その他	14,108	1.3
投資信託財産総額	1,083,503	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 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	1,083,503,175
コール・ローン等	7,352,701
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,069,395,427
未収入金	6,755,047
(B) 負債	13,826,487
未払解約金	10,745,083
未払信託報酬	3,063,079
未払利息	1
その他未払費用	18,324
(C) 純資産総額(A - B)	1,069,676,688
元本	1,296,886,388
次期繰越損益金	△ 227,209,700
(D) 受益権総口数	1,296,886,388口
1万口当たり基準価額(C / D)	8,248円

<注記事項>

- ①期首元本額 639,463,952円
 期中追加設定元本額 1,234,885,488円
 期中一部解約元本額 577,463,052円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8248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227,209,700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	14,250,255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	110,933,302円
分配準備積立金額	4,359,304円
当ファンドの分配対象収益額	129,542,861円
1万口当たり収益分配対象額	998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	△ 857
受取利息	17
支払利息	△ 874
(B) 有価証券売買損益	△ 14,316,403
売買益	8,250,119
売買損	△ 22,566,522
(C) 信託報酬等	△ 5,225,521
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 19,542,781
(E) 前期繰越損益金	△ 18,290,676
(F) 追加信託差損益金	△ 189,376,243
(配当等相当額)	(109,750,095)
(売買損益相当額)	(△299,126,338)
(G) 計(D + E + F)	△ 227,209,700
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G + H)	△ 227,209,700
追加信託差損益金	△ 189,376,243
(配当等相当額)	(110,933,302)
(売買損益相当額)	(△300,309,545)
分配準備積立金	18,609,559
繰越損益金	△ 56,443,016

- (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)

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

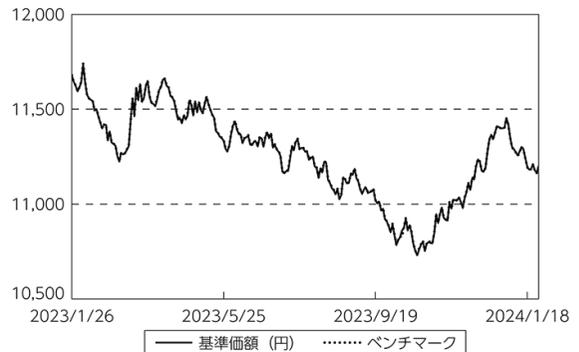
◎基準価額の動き

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 52,413	千イギリスポンド 24,960
	スウェーデン	国債証券 13,061	千スウェーデンクローネ 6,253
	ノルウェー	国債証券 9,754	千ノルウェークローネ 4,429
	デンマーク	国債証券 15,722	千デンマーククローネ 13,104
	ポーランド	国債証券 19,558	千ポーランドズロチ 9,188
	オーストラリア	国債証券 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 3,662	千ニュージーランドドル 142	
シンガポール	国債証券 4,787	千シンガポールドル 3,219	
マレーシア	国債証券 20,124	千マレーシアリングギット 8,122	
中国	国債証券 974,725	千中国元 185,410	
イスラエル	国債証券 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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,607,697	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力しています。

(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		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	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.875	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
		3.0	T-BOND 420515	3.0	1,310	1,068	157,812	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	2,100	1,673	247,142	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	1,800	1,428	210,958	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	760	600	88,731	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	2,880	2,252	332,624	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	2,050	1,600	236,361	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	3,880	3,014	445,275	2048/2/15
		3.0	T-BOND 480815	3.0	4,480	3,472	512,814	2048/8/15
		3.0	T-BOND 490215	3.0	4,700	3,635	537,007	2049/2/15
		3.0	T-BOND 520815	3.0	6,300	4,855	717,219	2052/8/15
		3.0	T-NOTE 250715	3.0	4,100	4,013	592,808	2025/7/15
		3.0	T-NOTE 250930	3.0	3,500	3,419	505,116	2025/9/30
		3.0	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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.625 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	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		債 年 月 日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	4.375 T-NOTE 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	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	
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	銘柄		当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.6 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	

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				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	
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			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
		2.875SINGAPORGOVT 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
		3.502MALAYSIAGOV 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
(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(KAKUSHIN)	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
(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)