

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／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2009年2月2日設定）	
運用方針	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 総合指数に概ね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。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 国内債券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、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが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は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
分配方針	経費等控除後の利子・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めます。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。	

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

## 運用報告書（全体版）

### 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド



第30期（決算日：2016年10月26日）

第31期（決算日：2017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「三菱UFJ 国内債券インデックスファンド」は、去る1月26日に第31期の決算を行いましたので、法令に基づいて第30期～第31期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

## 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10期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額		
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				中 落	率
	円		円		%	%	%	百万円		
22期(2014年10月27日)	10,381		30		0.6	358.53	0.6	99.6	—	2,138
23期(2015年1月26日)	10,541		30		1.8	365.50	1.9	99.6	—	2,056
24期(2015年4月27日)	10,488		30		△0.2	365.03	△0.1	99.2	—	2,743
25期(2015年7月27日)	10,405		30		△0.5	363.48	△0.4	99.6	—	2,760
26期(2015年10月26日)	10,443		30		0.7	366.22	0.8	99.3	—	2,809
27期(2016年1月26日)	10,527		30		1.1	370.57	1.2	99.7	—	2,826
28期(2016年4月26日)	10,940		30		4.2	386.52	4.3	99.5	0.3	2,886
29期(2016年7月26日)	11,013		30		0.9	390.50	1.0	99.4	0.4	3,205
30期(2016年10月26日)	10,817		30		△1.5	385.02	△1.4	99.5	0.3	3,226
31期(2017年1月26日)	10,569		30		△2.0	377.66	△1.9	99.2	0.4	3,432

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(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。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		NOMURA-BPI 総合指数	騰落率	債券組入比率	債券先物比率
		円	騰落率				
第30期	(期首) 2016年7月26日	11,013	—	390.50	—	99.4	0.4
	7月末	10,969	△0.4	389.24	△0.3	100.9	0.4
	8月末	10,859	△1.4	385.24	△1.3	99.2	0.3
	9月末	10,863	△1.4	385.50	△1.3	99.6	0.3
	(期末) 2016年10月26日	10,847	△1.5	385.02	△1.4	99.5	0.3
第31期	(期首) 2016年10月26日	10,817	—	385.02	—	99.5	0.3
	10月末	10,800	△0.2	384.44	△0.2	100.7	0.3
	11月末	10,728	△0.8	381.97	△0.8	101.1	0.5
	12月末	10,664	△1.4	379.82	△1.4	100.8	0.4
	(期末) 2017年1月26日	10,599	△2.0	377.66	△1.9	99.2	0.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、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

当作成期中の基準価額等の推移について (第30期～第31期：2016/7/27～2017/1/26)

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ3.5% (分配金再投資ベース) 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 (-3.3%) を0.2%程度下回りました。



- ・分配金再投資基準価額は、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はありません。
- ・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、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客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。

### 基準価額の主な変動要因

下落要因	日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。
------	------------------------------------------------------------------------------------

投資環境について

(第30期～第31期：2016/7/27～2017/1/26)

◎国内債券市況

- ・日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、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

<三菱UFJ 国内債券インデックスファンド>

- ・当ファンドは三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券に資産のほぼ全額を投資したことにより、基準価額（分配金再投資ベース）は債券市況とほぼ同様の推移となりました。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

基準価額は当作成期首に比べ3.3%の下落となりました。

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
  - ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数の構成銘柄を種別や年限など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。  
以上の運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の推移となりました。

(ご参考)

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

作成期首（2016年7月26日）

作成期末（2017年1月26日）

最終利回り	-0.1%	➡	最終利回り	0.2%
直接利回り	1.1%		直接利回り	1.0%
デュレーション	8.9年		デュレーション	8.6年

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について (第30期～第31期：2016/7/27～2017/1/26)

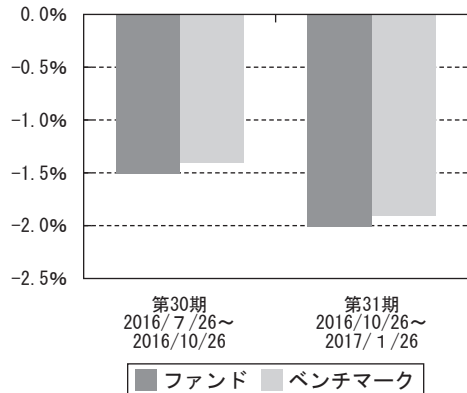
＜三菱UFJ 国内債券インデックスファンド＞  
ベンチマークとのカイ離は、 $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

- ◎ 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は $\Delta 0.2\%$ 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要因は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と  
ベンチマークの対比（騰落率）



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算していません。

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞  
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

- ◎ 組入比率要因  
組入比率による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
  - ・ 公社債の実質の組入比率については、当作成期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、当作成期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
  - ・ ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

## ◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

- ・年層構成、種別構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

## ◎その他の要因

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

## 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30期	第31期
	2016年7月27日～2016年10月26日	2016年10月27日～2017年1月26日
当期分配金	30	30
(対基準価額比率)	0.277%	0.283%
当期の収益	18	17
当期の収益以外	11	12
翌期繰越分配対象額	903	892

(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

## &lt;三菱UFJ 国内債券インデックスファンド&gt;

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数に概ね連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券に投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数に連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年7月27日～2017年1月26日)

項 目	第30期～第31期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	円 21 ( 9 ) ( 9 ) ( 3 )	% 0.190 (0.081) (0.081) (0.027)	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率× (作成期中の日数÷年間日数) 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 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 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 ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	0 ( 0 )	0.000 (0.000)	(b)売買委託手数料＝作成期中の売買委託手数料÷作成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
(c) そ の 他 費 用 ( 監 査 費 用 )	0 ( 0 )	0.002 (0.002)	(c)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数 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
合 計	21	0.192	
作成期中の平均基準価額は、10,813円です。			

(注) 作成期間の費用(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)を作成期間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

(2016年7月27日～2017年1月26日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第30期～第31期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 747,929	千円 1,043,525	千口 505,808	千円 706,220



## ○利害関係人との取引状況等

(2016年7月27日～2017年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ 国内債券インデックスファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

区 分	第30期～第31期					
	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 38,794	百万円 11,041	% 28.5	百万円 28,044	百万円 3,683	% 13.1

平均保有割合 1.5%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

種 類	第30期～第31期		
	買 付 額	売 付 額	第31期末保有額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 824

## 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

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

種 類	第30期～第31期
	買 付 額
公社債	百万円 1,400

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東京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リース、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	第29期末	第31期末	
	口数	口数	評価額
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 2,256,416	千口 2,498,537	千円 3,431,741

## ○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項目	第31期末	
	評価額	比率
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千円 3,431,741	% 98.6
コール・ローン等、その他	47,894	1.4
投資信託財産総額	3,479,635	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第30期末	第31期末
	2016年10月26日現在	2017年1月26日現在
(A) 資産	円 3,268,227,223	円 3,479,635,685
コール・ローン等	31,498,643	17,803,454
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	3,225,782,370	3,431,741,710
未収入金	10,946,210	30,090,521
(B) 負債	42,134,515	47,573,512
未払収益分配金	8,947,096	9,741,514
未払解約金	30,148,895	34,596,987
未払信託報酬	3,014,399	3,209,338
未払利息	43	25
その他未払費用	24,082	25,648
(C) 純資産総額(A-B)	3,226,092,708	3,432,062,173
元本	2,982,365,614	3,247,171,428
次期繰越損益金	243,727,094	184,890,745
(D) 受益権総口数	2,982,365,614口	3,247,171,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,817円	10,569円

## ○損益の状況

項 目	第30期	第31期
	2016年7月27日～ 2016年10月26日	2016年10月27日～ 2017年1月26日
	円	円
(A) 配当等収益	△ 2,518	△ 1,859
受取利息	37	21
支払利息	△ 2,555	△ 1,880
(B) 有価証券売買損益	△ 36,946,020	△ 60,043,781
売買益	7,977,940	4,324,146
売買損	△ 44,923,960	△ 64,367,927
(C) 信託報酬等	△ 3,038,481	△ 3,234,986
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 39,987,019	△ 63,280,626
(E) 前期繰越損益金	75,046,629	22,584,773
(F) 追加信託差損益金	217,614,580	235,328,112
(配当等相当額)	( 197,295,415)	( 231,499,187)
(売買損益相当額)	( 20,319,165)	( 3,828,925)
(G) 計(D+E+F)	252,674,190	194,632,259
(H) 収益分配金	△ 8,947,096	△ 9,741,514
次期繰越損益金(G+H)	243,727,094	184,890,745
追加信託差損益金	217,614,580	235,328,112
(配当等相当額)	( 197,918,103)	( 232,014,767)
(売買損益相当額)	( 19,696,477)	( 3,313,345)
分配準備積立金	71,499,477	57,822,464
繰越損益金	△ 45,386,963	△108,259,831

(注) (B)有価証券売買損益は各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。

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首（前作成期末）元本額 2,910,528,371円  
 作成期中追加設定元本額 1,494,756,459円  
 作成期中一部解約元本額 1,158,113,402円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0569円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2016年7月27日～ 2016年10月26日	2016年10月27日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	5,399,944円	5,723,928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	－円
収益調整金額	197,918,103円	232,014,767円
分配準備積立金額	75,046,629円	61,840,050円
当ファンドの分配対象収益額	278,364,676円	299,578,745円
1万口当たり収益分配対象額	933円	922円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	8,947,096円	9,741,514円

## ○分配金のお知らせ

	第30期	第31期
1 万口当たり分配金 (税込み)	30円	30円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

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

## 【お 知 ら せ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2016年10月26日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

## ＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

下記は、三菱UFJ 国内債券マザーファンド全体(157,154,388千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第31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	161,414,000 ( 100,000)	176,753,808 ( 100,252)	81.9 ( 0.0)	— (—)	51.5 ( —)	20.1 ( —)	10.3 ( 0.0)	
地方債証券	11,641,810 ( 11,641,810)	12,524,692 ( 12,524,692)	5.8 ( 5.8)	— (—)	3.6 ( 3.6)	1.9 ( 1.9)	0.3 ( 0.3)	
特殊債券 (除く金融債)	12,305,901 ( 12,305,901)	13,397,032 ( 13,397,032)	6.2 ( 6.2)	— (—)	4.5 ( 4.5)	1.6 ( 1.6)	0.1 ( 0.1)	
金融債券	1,330,000 ( 1,330,000)	1,337,548 ( 1,337,548)	0.6 ( 0.6)	— (—)	— ( —)	0.3 ( 0.3)	0.3 ( 0.3)	
普通社債券	9,821,000 ( 9,821,000)	10,228,771 ( 10,228,771)	4.7 ( 4.7)	— (—)	1.6 ( 1.6)	2.4 ( 2.4)	0.7 ( 0.7)	
合 計	196,512,711 ( 35,198,711)	214,241,853 ( 37,588,296)	99.3 (17.4)	— (—)	61.1 ( 9.6)	26.3 ( 6.3)	11.8 ( 1.5)	

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の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	第31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364回利付国債 (2年)	0.1	130,000	130,595	2018/5/15
第365回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,936	2018/6/15
第366回利付国債 (2年)	0.1	250,000	251,202	2018/7/15
第367回利付国債 (2年)	0.1	500,000	502,545	2018/8/15
第369回利付国債 (2年)	0.1	500,000	502,695	2018/10/15
第370回利付国債 (2年)	0.1	1,850,000	1,860,471	2018/11/15
第371回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,106,413	2018/12/15
第109回利付国債 (5年)	0.1	660,000	662,811	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	800,000	805,232	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	990,000	997,603	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,760,000	1,775,787	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	1,330,000	1,340,081	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	720,000	726,091	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	1,190,000	1,198,020	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	1,980,000	1,995,186	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	2,030,000	2,046,727	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,200,000	1,210,776	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	760,000	765,000	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	1,040,000	1,050,056	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	530,000	533,720	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	1,930,000	1,944,262	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,500,000	1,511,565	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	1,880,000	1,895,021	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	2,060,000	2,076,933	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	1,320,000	1,331,338	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	1,800,000	1,816,074	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	2,370,000	2,391,922	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	2,620,000	2,644,392	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	700,000	706,699	2021/12/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	220,000	313,601	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	295,000	406,285	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	255,000	353,126	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	420,000	584,711	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	380,000	507,843	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	410,000	537,928	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	430,000	539,250	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	520,000	603,231	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	600,000	499,440	2056/3/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	190,000	193,619	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	230,000	234,121	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	480,000	490,785	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	895,000	920,453	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	570,000	585,418	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	730,000	747,717	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	1,620,000	1,665,538	2018/9/20

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第297回利付国債 (10年)	1.4	760,000	783,035	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	950,000	976,999	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	810,000	835,766	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	100,000	103,610	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	644,806	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	705,574	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,470,000	1,530,960	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	520,000	540,186	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	830,000	865,026	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,120,000	1,174,476	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	455,000	475,697	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	690,000	723,554	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,180,000	1,229,359	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,200,000	1,249,104	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	609,829	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,890,000	1,986,654	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	90,000	95,249	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	609,017	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	780,000	824,670	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	400,000	421,144	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	250,000	263,855	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	550,000	577,923	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	690,000	730,130	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	540,000	568,755	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	720,000	760,082	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	420,000	441,218	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	494,778	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,026,373	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,690,000	1,772,725	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	104,459	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	780,000	819,390	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,290,000	1,341,587	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,230,000	1,296,555	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,240,000	1,308,882	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	770,000	802,532	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,500,000	1,564,140	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,220,000	1,272,216	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,720,000	1,794,235	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,470,000	1,523,228	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	520,000	539,229	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,050,000	1,072,302	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,390,000	1,431,144	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,940,000	1,998,355	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,560,000	1,607,642	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,550,000	1,584,286	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,270,000	1,274,610	2026/3/20

銘柄	第31期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,890,000	1,896,161	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,590,000	2,596,190	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	800,000	801,176	2026/12/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	158,557	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	217,314	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	241,072	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	169,430	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	227,521	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	220,607	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	289,352	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	194,320	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	103,753	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	290,901	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	119,899	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	258,962	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	486,782	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	499,065	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	440,000	585,917	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	345,000	460,195	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	350,000	461,457	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	360,000	468,907	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	290,000	377,893	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	260,000	348,062	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	250,000	325,972	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	285,000	381,874	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	140,000	187,824	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	230,000	308,669	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	205,000	267,631	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	430,000	570,063	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	400,000	539,568	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	415,000	561,835	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	480,000	643,008	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	575,000	761,530	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	435,000	569,180	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	610,000	813,221	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	683,000	870,142	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	685,000	905,549	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	750,000	960,945	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	590,000	757,984	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	830,000	1,049,925	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	505,000	628,416	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	634,340	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	430,000	535,595	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	420,000	513,874	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	450,000	550,728	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	420,000	514,155	2044/6/20



銘柄	第31期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第44回利付国債 (30年)	1.7	450,000	551,020	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	520,000	611,353	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	630,000	740,628	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	590,000	709,026	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	500,000	575,935	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	660,000	760,953	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	580,000	578,631	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	470,000	407,776	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	930,000	853,944	2046/9/20
第39回利付国債 (20年)	2.6	1,120,000	1,156,635	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	290,000	301,939	2018/9/20
第41回利付国債 (20年)	1.5	240,000	248,637	2019/3/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	835,000	884,732	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	360,000	389,185	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	710,000	768,880	2020/3/20
第45回利付国債 (20年)	2.4	100,000	107,979	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	108,484	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	275,440	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	185,583	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	557,930	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	152,926	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	286,535	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	88,579	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	589,434	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	265,749	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	411,628	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	177,137	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	389,140	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	651,542	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	249,913	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	276,967	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	590,301	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	307,395	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	541,617	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	487,108	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	191,404	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	90,876	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	457,157	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	138,026	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	599,739	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	232,242	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	747,032	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	231,004	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	441,894	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	268,522	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	241,766	2025/3/20

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	301,438	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	116,382	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	433,706	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	729,318	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	215,012	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	480,741	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	272,747	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	640,543	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	203,141	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	555,914	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	155,893	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	565,842	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	97,079	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	778,804	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	230,000	273,978	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	312,325	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	600,499	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	144,596	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	402,098	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	410,713	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	755,000	914,674	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	453,560	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	410,000	511,585	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	237,992	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	397,241	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	190,000	231,606	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	427,577	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	410,000	505,562	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	30,000	36,746	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	510,000	612,805	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	570,000	686,416	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	122,799	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	320,000	397,836	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	550,000	677,121	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	310,000	382,602	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	717,547	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	270,000	337,419	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	269,169	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	560,000	693,946	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	314,000	385,673	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	288,556	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	200,000	235,276	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	430,000	523,572	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	310,000	373,370	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	530,000	660,708	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	330,000	406,962	2030/12/20

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第125回利付国債 (20年)	2.2	330,000	416,710	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	330,000	407,447	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	260,000	317,480	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	480,000	586,723	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	410,000	495,497	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	580,000	701,504	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	270,000	322,776	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	270,000	322,947	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	370,000	447,814	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	320,000	387,523	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	220,000	263,254	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	260,000	307,374	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	260,000	311,246	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	270,000	315,333	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	250,000	295,625	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	820,000	981,941	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	940,000	1,126,749	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	50,000	60,683	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	400,000	473,464	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	320,000	373,632	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	920,000	1,103,070	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,080,000	1,294,984	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	730,000	863,108	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	610,000	711,321	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	800,000	932,440	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	910,000	1,045,289	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	770,000	857,787	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	990,000	1,101,553	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	820,000	925,780	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	910,000	1,009,135	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	880,000	943,712	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	870,000	837,253	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	1,020,000	940,970	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,190,000	1,158,905	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	110,000	108,935	2036/12/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,252	2018/11/15
小 計		161,414,000	176,753,808	
<b>地方債証券</b>				
第5回東京都公募公債 (20年)	2.11	100,000	115,827	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	117,119	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	70,000	92,147	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)	2.31	100,000	128,568	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)	1.8	100,000	118,386	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)	1.68	100,000	116,673	2032/12/20
第655回東京都公募公債	1.42	30,000	30,480	2018/3/20
第682回東京都公募公債	1.32	100,000	104,083	2020/3/19

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	104,609	2021/9/17
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	103,270	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	200,000	209,724	2023/3/20
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	115,249	2024/3/19
平成20年度第12回北海道公募公債	1.72	50,000	51,621	2018/12/26
平成21年度第7回北海道公募公債	1.46	50,000	51,909	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	80,000	82,806	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	52,051	2022/10/31
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	98,926	2026/4/28
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	136,481	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	133,274	2038/3/19
第155回神奈川県公募公債	1.61	60,000	61,332	2018/6/20
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	103,684	2023/3/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	121,969	2030/5/28
第311回大阪府公募公債	1.68	50,000	50,904	2018/2/28
第313回大阪府公募公債	1.66	50,000	51,024	2018/4/27
第318回大阪府公募公債	1.7	14,000	14,391	2018/9/28
第322回大阪府公募公債	1.62	60,000	61,920	2019/1/29
第332回大阪府公募公債	1.58	50,000	52,203	2019/11/27
第335回大阪府公募公債	1.48	30,000	31,347	2020/2/25
第336回大阪府公募公債	1.46	50,000	52,282	2020/3/30
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	26,078	2020/9/29
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,832	2020/11/27
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	52,699	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	73,269	2022/2/28
第404回大阪府公募公債	0.4	400,000	407,360	2026/1/28
第408回大阪府公募公債	0.072	118,000	116,599	2026/5/29
平成20年度第3回京都府公募公債	1.57	20,200	20,791	2018/12/19
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	122,059	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	40,000	41,660	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債	1.31	45,900	48,346	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	69,411	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	64,654	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	110,444	2028/5/26
平成20年度第3回兵庫県公募公債	1.76	40,000	40,916	2018/5/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	40,000	41,716	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	52,310	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	103,965	2022/10/19
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	111,180	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	117,330	2032/6/18
平成19年度第9回静岡県公募公債	1.53	50,000	50,879	2018/3/27
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	31,012	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	239,014	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債	1.44	50,000	51,776	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債	1.38	201,000	208,509	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	28,347	2020/6/30

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	73,338	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	105,345	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,085	2022/11/30
平成19年度第4回広島県公募公債	1.53	29,300	29,805	2018/3/19
平成21年度第1回広島県公募公債	1.57	20,000	20,722	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	46,735	2020/9/24
平成27年度第5回広島県公募公債	0.41	200,000	204,036	2026/1/26
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	122,059	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	119,812	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債	1.87	29,000	29,756	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,445	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,047	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	105,711	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	52,722	2021/2/25
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	80,000	82,876	2019/5/24
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	84,095	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	84,338	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	83,992	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	83,930	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,196	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	56,406	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	84,031	2019/11/27
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	140,000	140,387	2026/2/26
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	43,827	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	56,907	2019/10/31
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	34,996	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	83,431	2019/4/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	208,570	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	51,885	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	20,858	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	104,006	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	21,051	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	104,847	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	73,474	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	312,714	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	104,501	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,798	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	624,084	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,418	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,920	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	204,994	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	104,334	2019/11/30
平成20年度第1回新潟市公募公債	1.56	34,190	35,193	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	98,065	2019/12/25
平成21年度第1回浜松市公募公債	1.54	33,900	35,355	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	50,000	52,185	2019/11/25

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	52,506	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	21,062	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	102,944	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	112,995	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	100,000	119,851	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債(30年)	2.095	90,000	113,228	2042/9/19
第3回京都市公募公債(20年)	2.09	100,000	116,889	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	110,000	134,000	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債	1.025	100,000	104,720	2021/10/19
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	116,669	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	250,000	291,437	2025/12/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	104,437	2023/2/20
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	40,000	46,106	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債	1.05	50,000	51,865	2020/9/18
第7回川崎市公募公債(20年)	2.08	100,000	120,525	2029/7/17
平成19年度第5回福岡市公募公債	1.49	20,000	20,343	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	30,000	30,807	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債	1.49	84,500	87,171	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	127,300	134,150	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	50,000	52,313	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	70,000	72,953	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債	1.56	50,000	51,466	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債	1.52	50,000	51,555	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債	1.21	50,000	52,571	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債	1.29	60,000	62,952	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	149,170	155,077	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	162,550	170,380	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債	1.73	130,300	134,380	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債	1.55	36,500	38,080	2019/11/29
平成22年度第1回岡山県公募公債	1.05	50,000	51,968	2020/11/30
平成27年度第1回岡山県公募公債	0.395	189,000	192,564	2026/1/29
小 計		11,641,810	12,524,692	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	107,719	2021/2/26
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	107,865	2021/3/26
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	11,000	11,273	2018/9/28
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	14,000	14,363	2019/1/30
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	102,692	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	30,000	30,828	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	103,143	2019/4/30
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	200,000	207,234	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	124,000	128,333	2019/7/31
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	243,486	2029/10/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	10,000	10,430	2020/2/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,097	2030/4/30
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	127,897	2040/5/31

銘柄	第31期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第114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	119,677	2030/7/31
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	119,570	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	119,751	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	14,000	14,736	2021/6/30
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	124,785	2042/2/28
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	104,770	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	300,000	313,404	2022/10/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	163,000	169,930	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	209,762	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	30,000	31,447	2023/2/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	340,000	352,559	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	105,524	2023/6/30
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	104,105	2024/3/29
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.44	400,000	411,196	2025/8/29
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	105,510	2020/7/15
第11回政府保証東日本高速道路債券	1.6	50,000	50,867	2018/2/27
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	80,000	82,199	2018/10/19
第14回政府保証東日本高速道路債券	1.4	80,000	82,112	2018/12/21
第12回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	109,235	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券(15年)	1.6	200,000	210,820	2020/6/22
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	200,000	207,116	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	200,000	206,850	2019/7/12
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	31,000	32,052	2019/9/13
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	14,000	14,372	2019/2/18
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	200,000	206,486	2019/10/18
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	11,000	11,530	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	20,000	21,063	2021/3/12
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	200,000	210,636	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	35,000	36,596	2022/3/14
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	100,000	104,228	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	38,000	39,825	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	105,313	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	100,000	104,492	2023/12/18
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	108,816	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	104,818	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	94,033	2023/10/20
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	10,000	10,308	2019/4/15
第13回政府保証中部国際空港債券	1.3	72,000	75,836	2021/3/15
第16回政府保証西日本高速道路債券	1.6	75,000	77,152	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券	1.3	75,000	76,938	2019/1/28
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	2.23	30,000	35,851	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	146,838	2045/9/20
第17回道路債券(財投機関債)	1.54	150,000	163,050	2022/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	140,710	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	110,000	152,556	2047/3/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.37	100,000	122,748	2028/9/20

銘柄	第31期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	124,016	2029/4/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.71	100,000	103,623	2019/3/20
第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.3	100,000	105,234	2021/3/19
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	117,513	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	100,000	105,470	2023/6/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	105,811	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	136,905	2034/3/24
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.22	100,000	122,574	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	114,717	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	115,072	2024/3/22
第12回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.38	100,000	104,519	2020/5/28
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	104,275	2020/6/26
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	122,238	2031/1/28
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.84	100,000	118,466	2031/12/26
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	116,131	2032/7/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	208,490	2023/1/27
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	80,005	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	110,977	2022/6/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	103,000	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.26	100,000	117,221	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	105,375	2021/12/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	44,194	46,852	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	46,604	49,640	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	23,314	23,764	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	35,154	36,822	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	53,562	56,036	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	18,695	19,926	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	56,139	59,825	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	23,900	25,338	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	40,035	40,934	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	14,284	14,631	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	15,818	16,054	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	25,542	27,215	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	58,966	61,265	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	60,350	62,847	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	30,243	31,355	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	16,766	17,423	2039/6/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.6	100,000	125,398	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	40,845	43,759	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	21,494	22,428	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	41,899	44,734	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	23,484	24,534	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	94,642	100,584	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	92,964	98,364	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	42,980	45,088	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	53,720	56,112	2045/9/10



銘柄	第31期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	42,510	45,412	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	41,264	44,116	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	180,834	193,087	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	106,102	113,045	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	101,760	108,946	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	50,232	53,446	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	49,960	52,948	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	54,719	58,016	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	47,562	50,926	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	57,210	60,364	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	58,877	62,054	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	64,470	67,886	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	65,849	69,358	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	67,196	70,416	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	131,954	137,897	2047/6/10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.358	100,000	105,186	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	214,806	222,914	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	75,440	78,147	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	151,048	156,224	2049/5/10
第86回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.046	100,000	104,632	2021/9/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.53	100,000	112,433	2026/9/18
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	118,765	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	161,514	165,669	2049/11/10
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	238,530	2032/4/16
第17回国際協力機構債券(財投機関債)	0.72	30,000	31,166	2022/12/26
第13回中日本高速道路	1.49	100,000	104,214	2019/12/20
第38回中日本高速道路	0.677	100,000	101,350	2019/2/28
第21回西日本高速道路	0.754	100,000	104,090	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	103,669	2021/9/17
小計		12,305,901	13,397,032	
<b>金融債券</b>				
い第755号農林債券	0.3	100,000	100,349	2018/4/27
い第758号農林債券	0.4	100,000	100,558	2018/7/27
い第760号農林債券	0.4	100,000	100,616	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	100,000	100,471	2018/10/26
い第765号農林債券	0.3	200,000	201,102	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	130,000	130,846	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,566	2019/11/27
い第778号農林債券	0.25	300,000	302,034	2020/3/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,006	2018/11/27
小計		1,330,000	1,337,548	
<b>普通社債券</b>				
第459回東京電力	2.7	20,000	20,964	2019/1/29
第542回東京電力	1.602	100,000	101,745	2018/4/25
第548回東京電力	2.347	100,000	113,947	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	144,023	2019/10/29

銘柄	第31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497回中部電力	0.986	100,000	102,955	2020/10/23
第499回中部電力	1.194	50,000	52,907	2023/6/23
第518回中部電力	0.19	200,000	199,398	2023/1/25
第478回関西電力	1.448	100,000	103,721	2020/1/24
第365回中国電力	1.405	100,000	103,655	2019/12/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,591	2020/10/23
第431回東北電力	2.05	80,000	81,858	2018/3/23
第400回九州電力	1.777	70,000	73,538	2020/4/24
第296回北海道電力	2.027	100,000	102,757	2018/6/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	100,963	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,231	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,925	2019/9/25
第26回関西国際空港	1.156	100,000	104,078	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	103,951	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,081	2021/6/18
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	201,950	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,399	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,272	2021/9/17
第5回日本電産	0.001	100,000	99,761	2019/11/25
第12回パナソニック	0.387	100,000	100,689	2020/3/19
第15回パナソニック	0.19	100,000	99,896	2021/9/17
第30回ソニー	0.05	100,000	99,775	2019/9/20
第12回デンソー	0.01	100,000	99,395	2021/9/17
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,415	2019/8/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,207	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	103,534	2022/5/20
第3回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.26	100,000	102,373	2018/3/2
第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.5	200,000	210,870	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	106,276	2021/10/29
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	400,000	401,952	2018/4/20
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	120,506	2027/4/20
第6回りそな銀行 (劣後特約付)	2.084	100,000	105,656	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行 (劣後特約付)	1.68	100,000	105,969	2021/4/28
第12回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.373	100,000	104,222	2020/11/11
第15回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	106,512	2022/3/22
第17回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.8	200,000	210,804	2019/2/12
第20回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	100,000	105,049	2019/7/24
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	104,393	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	105,303	2020/12/17
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	114,067	2026/9/11
第19回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.67	100,000	106,621	2022/2/24
第12回芙蓉総合リース	0.12	100,000	99,607	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	100,000	99,564	2019/6/20
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,212	2020/3/19
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,625	2019/12/20
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,825	2020/3/19

銘柄	第31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38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,729	2021/3/19
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	100,015	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,851	2021/6/18
第62回日立キャピタル	0.001	200,000	199,530	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	100,943	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,361	2020/10/30
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,302	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	198,030	2021/7/23
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	105,577	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	115,282	2025/6/24
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	102,499	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	113,673	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	117,144	2027/3/19
第11回エス・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,908	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	21,822	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	111,260	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	114,517	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	116,955	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	106,785	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	122,275	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	110,988	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	104,272	2020/6/11
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,383	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	123,104	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,883	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	205,314	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	103,163	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	101,736	2024/9/20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,449	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	113,497	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	105,220	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,247	2025/12/18
第20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	103,345	2018/5/29
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	200,000	200,074	2017/2/9
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,217	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,466	2019/5/2
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.2	100,000	100,130	2017/3/9
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,420	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,414	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,001	2020/5/22
小 計		9,821,000	10,228,771	
合 計		196,512,711	214,241,853	

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			第31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 899	百万円 —

## 三菱UFJ 国内債券マザーファンド

### 《第16期》決算日2016年5月20日

[計算期間：2015年5月21日～2016年5月20日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月20日に第16期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2012年5月21日)	12,405	3.0	341.171	3.0	99.4	0.1	280,753
13期(2013年5月20日)	12,518	0.9	344.269	0.9	99.0	0.6	316,364
14期(2014年5月20日)	12,874	2.8	354.058	2.8	99.4	—	290,123
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—	256,631
16期(2016年5月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月20日	円 13,192	% —		% —	% 99.3	% —
5月末	13,193	0.0	362.770	0.0	100.3	0.3
6月末	13,186	△0.0	362.542	△0.0	98.6	0.1
7月末	13,224	0.2	363.584	0.2	99.9	—
8月末	13,246	0.4	364.201	0.4	97.7	—
9月末	13,284	0.7	365.235	0.7	97.7	—
10月末	13,335	1.1	366.655	1.1	101.2	0.2
11月末	13,333	1.1	366.578	1.1	99.9	0.2
12月末	13,415	1.7	368.877	1.7	99.0	—
2016年1月末	13,582	3.0	373.520	3.0	97.3	—
2月末	13,814	4.7	379.830	4.7	97.9	—
3月末	13,924	5.5	382.913	5.6	100.5	0.3
4月末	14,047	6.5	386.253	6.5	99.7	0.3
(期 末) 2016年5月20日	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.7%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.7%)とほぼ同程度となりました。

## 基準価額の推移



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

## ●投資環境について

## ◎国内債券市況

- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇（金利は低下）基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことから、債券市況は一段と上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数の構成銘柄を種別や年限など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6.7%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

## ◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
- ・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

## ◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

## ◎その他の要因

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

## ◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年5月21日～2016年5月20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
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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、13,465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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 52,279,840	千円 89,673,403
	地方債証券	1,115,939	4,238,690
	特殊債券	1,415,305	6,020,189
	社債券	1,506,951	( 419,559)
			( 400,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円 4,904	百万円 4,297	百万円 602	百万円 602



## ○利害関係人との取引状況等

(2015年5月21日～2016年5月20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 56,318	百万円 18,303	% 32.5	百万円 104,383	百万円 35,239	% 33.8

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 -	百万円 305	百万円 331

## 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 600

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東京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リース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2016年5月20日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	156,554,000 ( 100,000)	178,095,596 ( 100,649)	81.0 ( 0.0)	— (—)	50.9 ( —)	20.6 ( 0.0)	9.5 ( —)
地方債証券	11,299,900 ( 11,299,900)	12,409,380 ( 12,409,380)	5.6 ( 5.6)	— (—)	3.5 ( 3.5)	1.9 ( 1.9)	0.2 ( 0.2)
特殊債券 (除く金融債)	14,004,337 ( 14,004,337)	15,462,010 ( 15,462,010)	7.0 ( 7.0)	— (—)	5.5 ( 5.5)	1.4 ( 1.4)	0.2 ( 0.2)
金融債券	2,030,000 ( 2,030,000)	2,041,508 ( 2,041,508)	0.9 ( 0.9)	— (—)	— ( —)	0.6 ( 0.6)	0.4 ( 0.4)
普通社債券	9,821,000 ( 9,821,000)	10,380,161 ( 10,380,161)	4.7 ( 4.7)	— (—)	1.6 ( 1.6)	1.8 ( 1.8)	1.2 ( 1.2)
合 計	193,709,237 ( 37,255,237)	218,388,657 ( 40,393,709)	99.3 (18.4)	— (—)	61.6 (10.6)	26.3 ( 5.7)	11.5 ( 2.0)

(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	
国債証券	%	千円	千円	
第355回利付国債 (2年)	0.1	530,000	532,379	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	950,000	954,626	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	850,000	854,454	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	1,320,000	1,327,352	2017/11/15
第360回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,106,446	2018/1/15
第362回利付国債 (2年)	0.1	1,200,000	1,207,620	2018/3/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	1,010,000	1,014,999	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,350,000	3,370,502	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	1,270,000	1,279,232	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	900,000	905,121	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	660,000	664,283	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	800,000	808,120	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	990,000	1,001,860	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	560,000	567,588	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	720,000	729,259	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	1,190,000	1,202,518	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	2,080,000	2,103,982	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	2,880,000	2,916,403	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,200,000	1,216,344	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	780,000	788,205	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	1,060,000	1,075,454	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	530,000	535,946	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	2,030,000	2,054,502	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,760,000	1,782,387	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	2,040,000	2,067,682	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	2,470,000	2,505,049	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	1,160,000	1,177,423	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	1,310,000	1,330,750	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	210,000	340,080	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	245,000	385,240	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	305,000	483,684	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	420,000	671,592	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	440,000	679,747	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	410,000	623,388	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	410,000	598,870	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	450,000	612,535	2055/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	130,000	132,883	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	870,000	890,236	2017/6/20
第288回利付国債 (10年)	1.7	740,000	759,299	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	1,610,000	1,654,677	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	190,000	195,719	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	230,000	236,502	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	480,000	497,083	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	895,000	933,144	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	270,000	280,945	2018/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第295回利付国債 (10年)	1.5	730,000	756,550	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	1,620,000	1,685,934	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	760,000	792,087	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	950,000	987,648	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	810,000	845,194	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	100,000	104,913	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	653,306	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	714,421	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,470,000	1,550,306	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	520,000	546,665	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	830,000	875,616	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,120,000	1,190,616	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	455,000	481,931	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	810,000	860,787	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,270,000	1,339,176	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,200,000	1,263,936	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	616,278	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,890,000	2,014,040	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	90,000	96,666	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	617,311	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,080,000	1,158,980	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	500,000	534,000	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	580,000	621,423	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	700,000	746,221	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	790,000	849,099	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	150,000	160,374	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	720,000	772,027	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	170,000	181,281	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	320,000	342,166	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,041,857	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	990,000	1,054,775	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	220,000	233,503	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	500,000	534,025	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,290,000	1,363,259	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	870,000	933,423	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,110,000	1,192,961	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	620,000	657,119	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,810,000	1,921,369	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,300,000	1,381,536	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,787,352	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,090,000	2,208,252	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	740,000	782,801	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,210,000	1,258,387	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,280,000	1,342,937	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,940,000	2,036,262	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,320,000	2,436,069	2025/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,730,000	1,800,376	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,120,000	1,143,352	2026/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	164,665	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	225,613	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	250,431	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	176,513	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	237,574	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	230,708	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	303,615	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	203,816	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	108,810	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	305,245	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	126,224	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	272,965	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	513,988	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	527,949	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	440,000	620,857	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	345,000	488,295	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	350,000	490,098	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	360,000	498,484	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	290,000	402,259	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	260,000	370,578	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	250,000	347,587	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	285,000	408,031	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	140,000	200,978	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	250,000	359,847	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	205,000	287,799	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	510,000	727,734	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	400,000	582,808	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	445,000	652,187	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	470,000	682,952	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	585,000	842,095	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	435,000	619,909	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	640,000	931,833	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	653,000	910,869	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	625,000	906,662	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	770,000	1,085,769	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	710,000	1,006,496	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	650,000	909,291	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	535,000	737,877	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	704,730	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	430,000	595,906	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	420,000	571,939	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	450,000	614,137	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	530,000	724,939	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	490,000	670,844	2044/9/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
国債証券	%	千円	千円
第45回利付国債 (30年)	1.5	520,000	686,036
第46回利付国債 (30年)	1.5	630,000	831,650
第47回利付国債 (30年)	1.6	620,000	836,652
第48回利付国債 (30年)	1.4	670,000	868,655
第49回利付国債 (30年)	1.4	460,000	597,452
第50回利付国債 (30年)	0.8	410,000	462,943
第36回利付国債 (20年)	3.0	50,000	52,168
第37回利付国債 (20年)	3.1	250,000	261,175
第39回利付国債 (20年)	2.6	1,120,000	1,178,195
第40回利付国債 (20年)	2.3	290,000	307,191
第41回利付国債 (20年)	1.5	240,000	251,827
第42回利付国債 (20年)	2.6	835,000	902,242
第43回利付国債 (20年)	2.9	360,000	397,699
第44回利付国債 (20年)	2.5	710,000	784,429
第45回利付国債 (20年)	2.4	100,000	110,098
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	110,552
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	281,447
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	189,196
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	567,993
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	155,996
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	292,601
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,501
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	602,562
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	271,514
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	420,693
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	180,937
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	397,726
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	665,354
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	254,858
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	281,967
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	600,824
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	314,690
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	555,148
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	499,264
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	196,076
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	93,238
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	469,769
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	141,762
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	617,293
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	238,802
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	768,001
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	237,354
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	454,271
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	276,018
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	248,264
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	309,696

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	119,558	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	445,761	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	749,815	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	220,816	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	493,476	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	280,052	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	658,323	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	208,680	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	571,766	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	160,264	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	581,874	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	99,876	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	800,702	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	230,000	281,915	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	321,521	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	619,605	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	149,061	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	415,044	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	423,745	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	555,000	693,922	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	468,723	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	450,000	580,765	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	360,000	466,570	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	410,848	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	90,000	113,366	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	270,000	341,147	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	190,000	242,419	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	30,000	38,017	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	510,000	633,445	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	620,000	772,526	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	127,170	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	170,000	219,038	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	650,000	828,997	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	310,000	396,486	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	680,000	872,079	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	270,000	349,922	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	279,603	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	560,000	720,552	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	314,000	400,971	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	430,000	537,039	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	160,000	195,340	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	430,000	544,311	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	310,000	387,992	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	530,000	688,210	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	330,000	423,726	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	270,000	355,406	2031/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	424,677	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	260,000	330,766	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	610,000	777,670	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	200,000	251,986	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	610,000	770,015	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	110,000	137,187	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	270,000	337,545	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	370,000	468,260	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	380,000	482,117	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	275,684	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	260,000	321,744	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	390,000	489,489	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	150,000	183,511	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	110,000	136,317	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,106,177	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	960,000	1,208,467	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	490,000	609,574	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	460,000	564,668	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,000,000	1,262,240	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,112,214	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	730,000	911,251	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	690,000	850,211	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	840,000	1,035,896	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	790,000	960,126	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	840,000	991,326	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	920,000	1,085,894	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	910,000	1,091,899	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	1,120,000	1,322,238	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	710,000	811,643	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	540,000	554,250	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,649	2018/11/15
小	計		156,554,000	178,095,596	
<b>地方債証券</b>					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	118,305	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	119,579	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	99,370	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	139,305	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	124,468	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	123,276	2032/12/20
第655回東京都公募公債		1.42	30,000	30,769	2018/3/20
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	105,096	2020/3/19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	105,295	2021/9/17
第718回東京都公募公債		0.6	100,000	103,891	2023/3/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	211,324	2023/3/20
第3回東京都公募公債 (20年)		2.26	100,000	117,413	2024/3/19
平成20年度第12回北海道公募公債		1.72	50,000	52,183	2018/12/26



銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
平成21年度第7回北海道公募公債		1.46	50,000	52,367	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債		0.96	80,000	83,228	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	50,000	52,313	2022/10/31
第2回神奈川県公募公債(30年)		2.87	100,000	145,529	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)		2.62	100,000	143,433	2038/3/19
第155回神奈川県公募公債		1.61	60,000	62,008	2018/6/20
第196回神奈川県公募公債		0.678	100,000	104,565	2023/3/20
第5回大阪府公募公債(20年)		2.16	100,000	126,482	2030/5/28
第311回大阪府公募公債		1.68	50,000	51,442	2018/2/28
第313回大阪府公募公債		1.66	50,000	51,553	2018/4/27
第318回大阪府公募公債		1.7	14,000	14,540	2018/9/28
第322回大阪府公募公債		1.62	60,000	62,510	2019/1/29
第332回大阪府公募公債		1.58	50,000	52,659	2019/11/27
第335回大阪府公募公債		1.48	30,000	31,596	2020/2/25
第336回大阪府公募公債		1.46	50,000	52,686	2020/3/30
第342回大阪府公募公債		1.2	25,000	26,222	2020/9/29
第344回大阪府公募公債		1.06	21,000	21,908	2020/11/27
第346回大阪府公募公債		1.25	140,000	147,555	2021/1/28
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	53,065	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	73,627	2022/2/28
平成20年度第3回京都市公募公債		1.57	20,200	21,011	2018/12/19
平成21年度第3回京都市公募公債(20年)		2.19	100,000	126,031	2029/9/20
平成22年度第2回京都市公募公債		1.16	40,000	42,008	2020/9/24
平成22年度第7回京都市公募公債		1.31	45,900	48,797	2021/3/22
平成23年度第2回京都市公募公債		1.2	66,000	69,960	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)		2.36	50,000	69,741	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債(15年)		1.31	100,000	113,314	2028/5/26
平成20年度第3回兵庫県公募公債		1.76	40,000	41,378	2018/5/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債		1.46	40,000	42,069	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	52,539	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債		0.77	100,000	104,575	2022/10/19
第3回静岡県公募公債(15年)		1.368	100,000	114,169	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)		1.736	100,000	123,936	2032/6/18
平成19年度第9回静岡県公募公債		1.53	50,000	51,412	2018/3/27
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	31,302	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)		2.04	200,000	246,400	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債		1.44	50,000	52,284	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債		1.38	201,000	210,539	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債		1.258	27,200	28,602	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債		1.03	70,000	73,863	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債		1.082	100,000	106,249	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	104,942	2022/11/30
平成19年度第4回広島県公募公債		1.53	29,300	30,110	2018/3/19
平成21年度第1回広島県公募公債		1.57	20,000	20,957	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債		1.08	45,000	47,153	2020/9/24
第8回埼玉県公募公債(20年)		2.19	100,000	126,195	2029/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	124,770	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債	1.87	29,000	30,128	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,565	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,432	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,785	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	53,230	2021/2/25
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	80,000	83,766	2019/5/24
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	84,865	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	85,136	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	84,610	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	84,606	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,918	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	56,940	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	84,988	2019/11/27
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	44,226	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	57,489	2019/10/31
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	50,000	51,324	2017/10/25
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	35,374	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	84,352	2019/4/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	210,854	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,383	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	21,057	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	104,872	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	21,240	2021/3/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	212,000	226,354	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	150,000	158,793	2021/5/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	105,627	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	74,093	2022/3/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	210,274	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,444	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	105,681	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	105,017	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	631,554	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	208,194	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,702	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	207,864	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	105,451	2019/11/30
平成20年度第1回新潟市公募公債	1.56	34,190	35,568	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	99,027	2019/12/25
平成19年度第1回浜松市公募公債	1.81	82,390	84,651	2017/11/28
平成21年度第1回浜松市公募公債	1.54	33,900	35,756	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	50,000	52,721	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	52,924	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	21,253	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	104,224	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	114,831	2023/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
第9回名古屋市公募公債(20年)		2.07	100,000	123,646	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債(30年)		2.095	90,000	124,420	2042/9/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	110,000	136,451	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	105,438	2021/10/19
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	119,537	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	250,000	299,455	2025/12/19
平成24年度第4回横浜市公募公債		0.81	100,000	105,297	2023/2/20
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	40,000	48,844	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債		1.05	50,000	52,310	2020/9/18
第7回川崎市公募公債(20年)		2.08	100,000	124,483	2029/7/17
平成19年度第5回福岡市公募公債		1.49	20,000	20,545	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	30,000	31,151	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債		1.49	84,500	88,020	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	127,300	135,212	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	52,677	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)		0.25	55,000	55,146	2017/6/26
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	73,542	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債		1.56	50,000	51,997	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債		1.52	50,000	52,068	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	53,016	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債		1.29	60,000	63,517	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	149,170	156,240	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	117,600	124,140	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	130,300	136,025	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	36,500	38,514	2019/11/29
平成19年度第1回岡山県公募公債		1.72	60,650	62,235	2017/11/30
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	52,403	2020/11/30
小	計		11,299,900	12,409,380	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
第6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	109,103	2021/2/26
第9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	109,214	2021/3/26
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	11,000	11,386	2018/9/28
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	14,000	14,488	2019/1/30
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	100,000	103,577	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	30,000	31,094	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	104,108	2019/4/30
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	209,292	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	124,000	129,544	2019/7/31
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	251,118	2029/10/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	10,000	10,528	2020/2/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	126,729	2030/4/30
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	140,248	2040/5/31
第114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	124,251	2030/7/31
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	131,456	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	124,445	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,856	2021/6/30

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	200,000	210,648	2022/2/28
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	137,896	2042/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	200,000	210,738	2022/3/18
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	105,629	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.819	300,000	316,044	2022/9/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	300,000	315,615	2022/10/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.734	163,000	171,136	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	211,464	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	31,700	2023/2/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	340,000	355,065	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	106,459	2023/6/30
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	101,000	107,268	2023/8/31
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	105,153	2024/3/29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	106,626	2020/7/15
第11回政府保証東日本高速道路債券		1.6	50,000	51,425	2018/2/27
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	80,000	83,074	2018/10/19
第14回政府保証東日本高速道路債券		1.4	80,000	82,874	2018/12/21
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	110,712	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券(15年)		1.6	200,000	213,058	2020/6/22
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	209,150	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	200,000	208,782	2019/7/12
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	31,000	32,330	2019/9/13
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	113,662	2022/7/15
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	14,000	14,495	2019/2/18
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	200,000	208,160	2019/10/18
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,627	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	21,247	2021/3/12
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	212,268	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	36,875	2022/3/14
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	100,000	104,967	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	40,144	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	106,173	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	105,376	2023/12/18
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	110,310	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	100,000	105,660	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	94,775	2023/10/20
第5回政府保証日本政策投資銀行		1.4	10,000	10,403	2019/4/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	76,518	2021/3/15
第16回政府保証西日本高速道路債券		1.6	75,000	77,972	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券		1.3	75,000	77,607	2019/1/28
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	36,788	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	161,567	2045/9/20
第17回道路債券(財投機関債)		1.54	150,000	164,725	2022/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.75	100,000	155,852	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	168,934	2047/3/20
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.56	100,000	102,474	2017/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
第39回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.37	100,000	126,279	2028/9/20
第47回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	127,821	2029/4/20
第48回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.71	100,000	104,739	2019/3/20
第67回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.3	100,000	106,048	2021/3/19
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	122,658	2032/9/17
第110回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	100,000	106,322	2023/6/20
第3回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	106,718	2023/3/22
第4回	回営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	143,982	2034/3/24
第5回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.22	100,000	126,181	2030/1/28
第7回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	116,598	2024/3/22
第8回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	116,988	2024/3/22
第12回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.38	100,000	105,359	2020/5/28
第13回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	105,049	2020/6/26
第13回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.132	100,000	126,245	2031/1/28
第19回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.84	100,000	123,150	2031/12/26
第23回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	121,323	2032/7/28
第36回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.892	200,000	210,220	2022/5/27
第41回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	200,000	209,716	2022/10/28
第44回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	209,958	2023/1/27
F131回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	82,873	2031/7/30
第1回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	112,501	2022/6/20
第16回	回都市再生債券(財投機関債)	1.76	100,000	102,342	2017/9/20
第100回	回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	104,103	2024/11/20
第7回	回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.26	100,000	119,273	2025/6/20
第29回	福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	106,161	2021/12/20
第1回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	52,952	56,753	2042/5/10
第2回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	56,422	60,783	2042/6/10
第3回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	26,706	27,569	2036/9/10
第3回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	38,828	41,054	2036/5/10
第5回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	59,805	63,158	2036/11/10
第6回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	20,909	22,525	2037/5/10
第7回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	62,919	67,734	2037/5/10
第8回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	28,382	30,384	2042/12/10
第9回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	44,835	46,129	2037/12/10
第10回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	15,949	16,425	2038/2/10
第11回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	17,545	17,868	2038/6/10
第13回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	31,322	33,733	2043/5/10
第16回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	67,486	70,607	2032/11/10
第17回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	69,280	72,685	2032/11/10
第18回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	34,572	36,092	2032/11/10
第19回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	19,211	20,117	2039/6/10
第23回	回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.6	100,000	128,661	2028/9/20
第29回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	46,434	50,143	2044/10/10
第31回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	26,809	28,291	2040/6/10
第31回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	48,555	52,239	2044/12/10
第32回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	29,093	30,719	2040/7/10



銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	113,056	121,095	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	112,682	120,202	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	52,124	55,291	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	65,596	69,079	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	52,264	56,640	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	49,670	53,859	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	214,980	231,761	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	132,970	143,090	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	128,572	139,150	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	64,274	69,120	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	64,107	68,652	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,864	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	55,758	60,342	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,732	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	73,005	77,740	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,428	81,327	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,918	81,881	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	77,502	82,072	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	154,424	163,249	2047/6/10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.358	100,000	106,004	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	243,672	255,845	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	87,869	92,129	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	176,722	185,004	2049/5/10
第86回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.046	100,000	105,349	2021/9/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.53	100,000	113,997	2026/9/18
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	123,434	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	184,808	192,048	2049/11/10
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	248,550	2032/4/16
第17回国際協力機構債券(財投機関債)		0.72	30,000	31,293	2022/12/26
第3回中日本高速道路		1.92	100,000	102,568	2017/9/20
第13回中日本高速道路		1.49	100,000	105,191	2019/12/20
第38回中日本高速道路		0.677	100,000	101,767	2019/2/28
第21回西日本高速道路		0.754	100,000	105,205	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	105,308	2021/9/17
小	計		14,004,337	15,462,010	
<b>金融債券</b>					
い第749号農林債券		0.3	100,000	100,417	2017/10/27
い第752号農林債券		0.3	200,000	200,934	2018/1/26
い第755号農林債券		0.3	100,000	100,484	2018/4/27
い第758号農林債券		0.4	100,000	100,764	2018/7/27
い第760号農林債券		0.4	100,000	100,811	2018/9/27
い第761号農林債券		0.3	100,000	100,583	2018/10/26
い第765号農林債券		0.3	200,000	201,328	2019/2/27
い第769号農林債券		0.3	130,000	131,008	2019/6/27
い第774号農林債券		0.24	100,000	100,628	2019/11/27
い第778号農林債券		0.25	300,000	302,253	2020/3/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
第274回信中金債	0.3	100,000	100,401	2017/9/27
第288回信中金債	0.3	200,000	201,258	2018/11/27
第178号商工債券（3年）	0.15	300,000	300,639	2017/11/27
小 計		2,030,000	2,041,508	
<b>普通社債券</b>				
第459回東京電力	2.7	20,000	21,221	2019/1/29
第522回東京電力	2.06	100,000	100,521	2016/8/31
第526回東京電力	1.78	100,000	101,525	2017/5/31
第532回東京電力	1.75	30,000	30,574	2017/9/28
第536回東京電力	1.672	100,000	102,232	2018/1/29
第542回東京電力	1.602	100,000	102,392	2018/4/25
第548回東京電力	2.347	100,000	112,266	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	144,095	2019/10/29
第497回中部電力	0.986	100,000	103,610	2020/10/23
第499回中部電力	1.194	50,000	53,439	2023/6/23
第410回関西電力	2.0	100,000	104,572	2018/11/22
第460回関西電力	1.77	100,000	102,636	2017/12/20
第478回関西電力	1.448	100,000	104,580	2020/1/24
第365回中国電力	1.405	100,000	104,605	2019/12/25
第287回北陸電力	2.01	50,000	51,082	2017/6/23
第288回北陸電力	1.89	30,000	30,799	2017/10/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,713	2020/10/23
第431回東北電力	2.05	80,000	82,844	2018/3/23
第432回東北電力	2.09	20,000	20,005	2016/5/25
第267回四国電力	1.89	100,000	105,943	2019/9/25
第400回九州電力	1.777	70,000	74,317	2020/4/24
第409回九州電力	1.483	100,000	104,308	2019/8/23
第296回北海道電力	2.027	100,000	103,938	2018/6/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,290	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,900	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	101,131	2019/9/25
第16回沖縄電力	1.83	70,000	71,373	2017/6/20
第26回関西国際空港	1.156	100,000	104,802	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	105,124	2024/2/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	204,318	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	104,907	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,348	2021/9/17
第12回パナソニック	0.387	100,000	100,935	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,103	2017/8/5
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	101,028	2019/8/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,620	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	104,991	2022/5/20
第3回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.26	100,000	103,669	2018/3/2
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.5	200,000	213,866	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	107,200	2021/10/29
第10回みずほコーポレート銀行	1.945	100,000	102,751	2017/10/27

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33回みずほコーポレート銀行	0.41	400,000	402,640	2018/4/20
第12回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.16	100,000	102,471	2017/7/28
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	121,834	2027/4/20
第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	100,000	106,936	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	107,143	2021/4/28
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	104,999	2020/11/11
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	107,842	2022/3/22
第11回三井住友銀行(劣後特約付)	2.17	100,000	103,235	2017/12/20
第17回三井住友銀行(劣後特約付)	2.8	200,000	214,434	2019/2/12
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	106,537	2019/7/24
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	105,269	2020/9/28
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	106,375	2020/12/17
第57回三井住友銀行	0.28	100,000	100,381	2017/10/20
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	116,418	2026/9/11
第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	107,695	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,397	2019/6/20
第69回トヨタファイナンス	0.02	100,000	99,962	2019/4/26
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	101,636	2021/6/18
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	101,579	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,712	2020/10/30
第8回野村ホールディングス	2.12	100,000	102,535	2017/8/14
第10回野村ホールディングス	1.91	100,000	102,798	2017/11/27
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	106,637	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	116,653	2025/6/24
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	103,674	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	116,596	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	120,203	2027/3/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,114	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	22,192	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	113,190	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	116,866	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	119,480	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	108,149	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	132,838	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	112,901	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	105,202	2020/6/11
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,792	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	126,136	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	120,902	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	208,368	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,206	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	103,826	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,636	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	115,077	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	106,484	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,031	2025/12/18



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20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	105,390	2018/5/29
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	200,000	201,716	2017/2/9
第6回ナショナル・オーストラリア銀行	1.03	100,000	100,134	2016/7/8
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,768	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,681	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,971	2019/5/2
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.2	100,000	100,844	2017/3/9
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,928	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,226	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,946	2020/5/22
小 計		9,821,000	10,380,161	
合 計		193,709,237	218,388,657	

## 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 607	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 218,388,657	% 99.1
コール・ローン等、その他	2,060,126	0.9
投資信託財産総額	220,448,783	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	220,448,783,747
コール・ローン等	1,151,083,926
公社債(評価額)	218,388,657,037
未収入金	281,589,100
未収利息	617,374,535
前払費用	5,859,149
差入委託証拠金	4,220,000
(B) 負債	546,120,829
未払金	184,320
未払解約金	545,933,508
未払利息	1,873
その他未払費用	1,128
(C) 純資産総額(A-B)	219,902,662,918
元本	156,236,987,608
次期繰越損益金	63,665,675,310
(D) 受益権総口数	156,236,987,608口
1口当たり基準価額(C/D)	14,075円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 194,532,901,496円  
 期中追加設定元本額 35,141,302,845円  
 期中一部解約元本額 73,437,216,733円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,075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)

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	3,474,461,523円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,013,687,275円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	995,870,644円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	26,078,973,744円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	39,433,106,342円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	9,566,943,379円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	243,447,663円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	156,299,901円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,131,354,864円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,966,065,487円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	8,402,293,348円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	59,767,950,667円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	1,245,106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)	5,287,665円
合計	156,236,987,608円

## 【お知らせ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

## ○損益の状況 (2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,740,172,135
受取利息	2,740,257,904
支払利息	△ 85,769
(B) 有価証券売買損益	12,364,381,209
売買益	12,878,060,435
売買損	△ 513,679,226
(C) 先物取引等取引損益	△ 335,600
取引益	3,727,600
取引損	△ 4,063,200
(D) 保管費用等	△ 1,128
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	15,104,216,616
(F) 前期繰越損益金	62,098,845,367
(G) 追加信託差損益金	11,927,318,479
(H) 解約差損益金	△25,464,705,152
(I) 計(E+F+G+H)	63,665,675,310
次期繰越損益金(I)	63,665,675,310

(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) (G)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) (H)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。