

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（2012年10月29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への投資を通じて、わが国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI 総合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	ベビーフンド	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。なお、わが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	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	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の金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。	

※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。

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 （確定拠出年金）



第5期（決算日：2017年2月20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（確定拠出年金）」は、去る2月20日に第5期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
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

お客様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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金	期騰落	中率	期騰落			
(設定日)	円	円		%		%	%	%	百万円
2012年10月29日	10,000	—		—	343.586	—	—	—	1
1期(2013年2月20日)	10,035	0		0.4	344.906	0.4	98.7	0.7	1
2期(2014年2月20日)	10,266	0		2.3	353.352	2.4	99.5	—	359
3期(2015年2月20日)	10,497	0		2.3	361.744	2.4	99.4	0.1	1,356
4期(2016年2月22日)	10,923	0		4.1	376.857	4.2	99.5	—	9,897
5期(2017年2月20日)	10,906	0		△0.2	376.740	△0.0	99.0	0.4	15,426

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、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総合は野村證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、野村證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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年2月22日	10,923	—	376.857	—	99.5	—
2月末	11,008	0.8	379.830	0.8	97.9	—
3月末	11,095	1.6	382.913	1.6	100.5	0.3
4月末	11,192	2.5	386.253	2.5	99.7	0.3
5月末	11,229	2.8	387.599	2.9	99.6	0.3
6月末	11,365	4.0	392.355	4.1	96.3	0.3
7月末	11,268	3.2	389.242	3.3	100.9	0.4
8月末	11,158	2.2	385.240	2.2	99.2	0.3
9月末	11,165	2.2	385.504	2.3	99.6	0.3
10月末	11,133	1.9	384.444	2.0	100.7	0.3
11月末	11,060	1.3	381.967	1.4	101.1	0.5
12月末	10,997	0.7	379.825	0.8	100.8	0.4
2017年1月末	10,936	0.1	377.739	0.2	99.8	0.4
(期 末) 2017年2月20日	10,906	△0.2	376.740	△0.0	99.0	0.4

(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

当期中の基準価額等の推移について

（第5期：2016/2/23～2017/2/20）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.2%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.0%）を0.2%下回りました。



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、国内債券市況がわずかに下落したほか、信託報酬等のコストが基準価額の下落要因となりました。
------	--

投資環境について

（第5期：2016/2/23～2017/2/20）

◎国内債券市況

- ・ 期の前半は、イギリスの欧州連合（EU）離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、国内債券市況は上昇しました。
- ・ 期の後半は、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（確定拠出年金）>

- ・ 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、基準価額はマザーファンド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>

基準価額は期首に比べほぼ横ばいとなりました。

- ・ 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。

（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）

期首（2016年2月22日）

期末（2017年2月20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	8.4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

＜三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）＞

ベンチマークとの乖離は、 $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

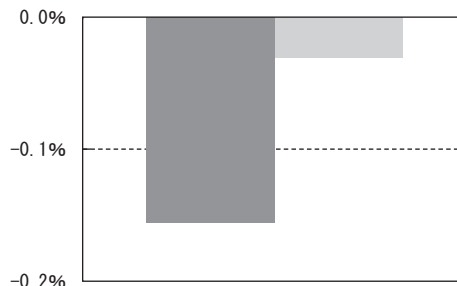
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合計
ベンチマーク との乖離	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

（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による影響は $\Delta 0.1\%$ 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）



2016/2/22～2017/2/20

■ ファンド ■ ベンチマーク

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

ベンチマークはほぼ横ばいとなったため、カイ離は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	0.0%程度	△0.0%程度	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0.0%程度でした。

- ・ 年限構成、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5期
	2016年2月23日～2017年2月20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	905

(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

<三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）>

- ・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。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

- ・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

（2016年2月23日～2017年2月20日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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 ）	(6)	(0. 054)	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 ）	(6)	(0. 054)	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 ）	(2)	(0. 021)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0. 000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0. 000)	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	0	0. 003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0. 003)	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	14	0. 132	
期中の平均基準価額は、11,133円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年2月23日～2017年2月20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
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 4,565,783	千円 6,395,978	千口 528,756	千円 735,620

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月23日～2017年2月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 62,919	百万円 16,218	% 25.8	百万円 74,777	百万円 12,893	% 17.2

平均保有割合 6.3%

※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。

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

利害関係人の発行する有価証券等

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 300	百万円 102	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

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種類	買付額
公社債	百万円 2,400

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年2月20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
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 7,220,178	千口 11,257,204	千円 15,425,747

○投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千円 15,425,747	% 99.8
コール・ローン等、その他	23,286	0.2
投資信託財産総額	15,449,033	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	15,449,033,472
コール・ローン等	23,286,094
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	15,425,747,378
(B) 負債	22,279,535
未払解約金	12,494,236
未払信託報酬	9,577,808
未払利息	29
その他未払費用	207,462
(C) 純資産総額(A-B)	15,426,753,937
元本	14,145,557,818
次期繰越損益金	1,281,196,119
(D) 受益権総口数	14,145,557,818口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,906円

<注記事項>

- ①期首元本額 9,060,776,672円
 期中追加設定元本額 7,598,701,244円
 期中一部解約元本額 2,513,920,098円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0906円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年2月23日～ 2017年2月20日
費用控除後の配当等収益額	128,583,554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	872,351,378円
分配準備積立金額	280,261,187円
当ファンドの分配対象収益額	1,281,196,119円
1万口当たり収益分配対象額	905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（2016年2月23日～2017年2月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,794
受取利息	272
支払利息	△ 9,066
(B) 有価証券売買損益	△ 153,960,043
売買益	6,143,610
売買損	△ 160,103,653
(C) 信託報酬等	△ 17,963,957
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 171,932,794
(E) 前期繰越損益金	280,261,187
(F) 追加信託差損益金	1,172,867,726
(配当等相当額)	(628,533,831)
(売買損益相当額)	(544,333,895)
(G) 計(D+E+F)	1,281,196,119
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,281,196,119
追加信託差損益金	1,172,867,726
(配当等相当額)	(633,392,162)
(売買損益相当額)	(539,475,564)
分配準備積立金	408,844,741
繰越損益金	△ 300,516,348

- (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】

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11月22日)

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年2月20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(156,727,266千円)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	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	160,434,000 (100,000)	174,989,326 (100,241)	81.5 (0.0)	— (—)	51.3 (—)	20.3 (—)	9.9 (0.0)	
地方債証券	11,841,810 (11,841,810)	12,705,803 (12,705,803)	5.9 (5.9)	— (—)	3.7 (3.7)	1.9 (1.9)	0.4 (0.4)	
特殊債券 (除く金融債)	12,414,380 (12,414,380)	13,477,297 (13,477,297)	6.3 (6.3)	— (—)	4.5 (4.5)	1.6 (1.6)	0.2 (0.2)	
金融債券	1,530,000 (1,530,000)	1,537,473 (1,537,473)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)	
普通社債券	9,621,000 (9,621,000)	10,022,886 (10,022,886)	4.7 (4.7)	— (—)	1.5 (1.5)	2.4 (2.4)	0.8 (0.8)	
合 計	195,841,190 (35,507,190)	212,732,787 (37,843,702)	99.1 (17.6)	— (—)	61.1 (9.8)	26.5 (6.2)	11.5 (1.6)	

(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	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第364回利付国債（2年）	0.1	130,000	130,582
第365回利付国債（2年）	0.1	200,000	200,958
第366回利付国債（2年）	0.1	250,000	251,272
第367回利付国債（2年）	0.1	500,000	502,740
第369回利付国債（2年）	0.1	500,000	503,010
第370回利付国債（2年）	0.1	1,850,000	1,861,877
第371回利付国債（2年）	0.1	1,100,000	1,107,304
第109回利付国債（5年）	0.1	160,000	160,652
第110回利付国債（5年）	0.3	300,000	301,869
第111回利付国債（5年）	0.4	990,000	997,227
第112回利付国債（5年）	0.4	1,760,000	1,775,646
第113回利付国債（5年）	0.3	1,330,000	1,340,054
第114回利付国債（5年）	0.3	720,000	726,314
第115回利付国債（5年）	0.2	1,190,000	1,198,556
第116回利付国債（5年）	0.2	1,980,000	1,996,513
第117回利付国債（5年）	0.2	2,030,000	2,047,721
第118回利付国債（5年）	0.2	1,200,000	1,211,196
第119回利付国債（5年）	0.1	760,000	765,320
第120回利付国債（5年）	0.2	1,040,000	1,050,358
第121回利付国債（5年）	0.1	530,000	533,906
第122回利付国債（5年）	0.1	1,930,000	1,944,783
第123回利付国債（5年）	0.1	1,500,000	1,512,030
第124回利付国債（5年）	0.1	1,880,000	1,895,378
第125回利付国債（5年）	0.1	2,060,000	2,077,757
第126回利付国債（5年）	0.1	1,320,000	1,331,668
第127回利付国債（5年）	0.1	1,800,000	1,816,560
第128回利付国債（5年）	0.1	2,370,000	2,392,135
第129回利付国債（5年）	0.1	2,440,000	2,462,984
第130回利付国債（5年）	0.1	1,100,000	1,110,659
第1回利付国債（40年）	2.4	220,000	308,748
第2回利付国債（40年）	2.2	295,000	399,896
第3回利付国債（40年）	2.2	255,000	347,452
第4回利付国債（40年）	2.2	420,000	575,118
第5回利付国債（40年）	2.0	380,000	500,091
第6回利付国債（40年）	1.9	410,000	528,846
第7回利付国債（40年）	1.7	430,000	529,299
第8回利付国債（40年）	1.4	520,000	592,040
第9回利付国債（40年）	0.4	670,000	545,560
第290回利付国債（10年）	1.4	190,000	193,429
第291回利付国債（10年）	1.3	230,000	233,903
第292回利付国債（10年）	1.7	480,000	490,209
第293回利付国債（10年）	1.8	895,000	919,657
第294回利付国債（10年）	1.7	570,000	584,951
第295回利付国債（10年）	1.5	730,000	747,206
第296回利付国債（10年）	1.5	1,620,000	1,664,955

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

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297回利付国債 (10年)	1.4	760,000	782,914	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	950,000	976,894	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	810,000	835,612	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	100,000	103,578	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	644,601	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	705,391	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,470,000	1,530,475	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	520,000	540,051	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	830,000	864,627	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,120,000	1,173,916	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	455,000	475,502	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	690,000	723,168	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,180,000	1,228,852	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,200,000	1,248,708	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	609,706	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,890,000	1,986,238	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	90,000	95,208	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	608,820	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	780,000	824,382	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	400,000	421,024	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	250,000	263,787	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	550,000	577,808	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	690,000	729,785	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	540,000	568,517	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	720,000	759,592	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	420,000	440,958	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	494,355	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,025,550	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,690,000	1,771,796	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	104,411	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	580,000	608,976	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,290,000	1,341,058	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,230,000	1,295,903	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,240,000	1,308,658	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	770,000	802,486	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,650,000	1,721,082	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	820,000	855,391	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,720,000	1,794,252	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,470,000	1,523,361	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	520,000	539,073	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,050,000	1,072,123	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,560,000	1,605,177	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,940,000	1,996,279	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,560,000	1,605,926	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,480,000	1,510,502	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,270,000	1,273,429	2026/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第343回利付国債（10年）	0.1	1,890,000	1,894,365	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	2,390,000	2,394,541	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	1,300,000	1,301,261	2026/12/20
第1回利付国債（30年）	2.8	120,000	157,884	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	170,000	216,272	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	190,000	239,757	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	125,000	168,450	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	180,000	226,389	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	170,000	219,317	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	225,000	287,433	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	160,000	193,041	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	90,000	103,086	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	263,000	288,618	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	100,000	119,007	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	205,000	256,776	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	390,000	483,034	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	380,000	495,900	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	440,000	582,146	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	345,000	456,472	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	350,000	457,334	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	360,000	465,084	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	290,000	374,787	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	260,000	344,864	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	250,000	322,977	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	285,000	378,636	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	140,000	186,221	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	230,000	306,015	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	205,000	265,567	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	430,000	565,110	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	400,000	535,268	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	415,000	557,282	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	480,000	637,132	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	575,000	754,486	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	435,000	563,851	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	540,000	713,032	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	683,000	860,060	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	685,000	894,822	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	770,000	974,781	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	590,000	748,792	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	800,000	999,568	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	505,000	620,629	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	500,000	626,400	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	430,000	528,874	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	350,000	422,366	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	450,000	543,141	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	420,000	507,028	2044/6/20

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44回利付国債（30年）	1.7	450,000	543,334	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	520,000	602,154	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	630,000	729,414	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	590,000	698,182	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	500,000	567,135	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	630,000	714,350	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	580,000	569,258	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	470,000	400,393	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	930,000	839,185	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	180,000	166,714	2046/12/20
第39回利付国債（20年）	2.6	1,120,000	1,154,585	2018/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	290,000	301,669	2018/9/20
第41回利付国債（20年）	1.5	240,000	248,536	2019/3/20
第42回利付国債（20年）	2.6	835,000	883,805	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	360,000	388,735	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	710,000	768,049	2020/3/20
第45回利付国債（20年）	2.4	100,000	107,867	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	100,000	108,375	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	250,000	275,185	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	170,000	185,385	2021/3/22
第50回利付国債（20年）	1.9	515,000	557,389	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	140,000	152,773	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	260,000	286,174	2021/9/21
第53回利付国債（20年）	2.1	80,000	88,489	2021/12/20
第54回利付国債（20年）	2.2	530,000	588,808	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	240,000	265,500	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	370,000	410,922	2022/6/20
第57回利付国債（20年）	1.9	160,000	176,841	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	350,000	388,374	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	590,000	650,693	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	230,000	249,625	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	260,000	276,707	2023/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	560,000	590,004	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	275,000	307,076	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	480,000	541,032	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	430,000	486,583	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	170,000	191,209	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	80,000	90,812	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	395,000	456,770	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	120,000	137,916	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	510,000	599,193	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	200,000	232,052	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	645,000	746,471	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	200,000	230,756	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	380,000	441,404	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	230,000	268,117	2025/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第76回利付国債（20年）	1.9	210,000	241,424	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	260,000	300,996	2025/3/20
第79回利付国債（20年）	2.0	100,000	116,211	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	370,000	433,048	2025/6/20
第82回利付国債（20年）	2.1	620,000	728,214	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	182,000	214,496	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	410,000	479,609	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	230,000	272,085	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	532,000	638,937	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	170,000	202,638	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	460,000	555,017	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	130,000	155,647	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	470,000	564,949	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	80,000	96,922	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	650,000	777,608	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	160,000	190,404	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	260,000	312,002	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	490,000	599,534	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	120,000	144,374	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	330,000	401,679	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	340,000	410,298	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	755,000	913,278	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	370,000	452,846	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	410,000	510,741	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	190,000	237,332	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	320,000	396,160	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	190,000	230,994	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	350,000	426,440	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	260,000	319,732	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	30,000	36,647	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	510,000	611,209	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	570,000	684,615	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	100,000	122,466	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	320,000	396,732	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	550,000	675,273	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	310,000	381,315	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	580,000	715,105	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	270,000	336,258	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	215,000	268,236	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	560,000	691,566	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	314,000	384,354	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	240,000	287,407	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	200,000	234,360	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	430,000	521,099	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	310,000	371,621	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	530,000	657,507	2030/12/20

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

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124回利付国債（20年）	2.0	330,000	405,002	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	330,000	414,371	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	330,000	405,467	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	260,000	315,952	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	480,000	583,862	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	410,000	492,766	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	580,000	697,595	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	270,000	320,992	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	270,000	321,143	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	370,000	445,295	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	320,000	385,321	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	220,000	261,769	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	260,000	305,432	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	260,000	309,470	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	270,000	313,332	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	250,000	293,950	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	820,000	976,292	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	820,000	977,194	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	50,000	60,328	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	400,000	470,348	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	320,000	371,468	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	920,000	1,095,701	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	1,020,000	1,214,789	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	730,000	857,275	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	610,000	706,495	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	800,000	926,056	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	910,000	1,037,281	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	770,000	850,549	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	920,000	1,014,953	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	820,000	917,785	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	910,000	1,001,245	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	880,000	935,580	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	870,000	829,571	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	1,020,000	932,392	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	1,190,000	1,149,016	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	360,000	353,422	2036/12/20
第14回ポーランド共和国円貨債券（2013）	0.67	100,000	100,241	2018/11/15
小 計		160,434,000	174,989,326	
地方債証券				
第5回東京都公募公債（20年）	2.11	100,000	115,679	2025/3/19
第7回東京都公募公債（20年）	2.16	100,000	116,923	2025/9/19
第7回東京都公募公債（30年）	2.51	70,000	91,349	2038/9/17
第10回東京都公募公債（30年）	2.31	100,000	127,177	2039/9/20
第25回東京都公募公債（20年）	1.8	100,000	117,616	2031/12/19
第27回東京都公募公債（20年）	1.68	100,000	115,948	2032/12/20
第655回東京都公募公債	1.42	30,000	30,455	2018/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	104,009	2020/3/19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	104,593	2021/9/17
第718回東京都公募公債		0.6	100,000	103,269	2023/3/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	209,686	2023/3/20
第3回東京都公募公債（20年）		2.26	100,000	115,170	2024/3/19
平成20年度第12回北海道公募公債		1.72	50,000	51,579	2018/12/26
平成21年度第7回北海道公募公債		1.46	50,000	51,881	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債		0.96	80,000	82,786	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	50,000	52,049	2022/10/31
平成28年度第1回北海道公募公債		0.085	100,000	98,873	2026/4/28
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	100,000	135,332	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	132,225	2038/3/19
第155回神奈川県公募公債		1.61	60,000	61,275	2018/6/20
第196回神奈川県公募公債		0.678	100,000	103,678	2023/3/20
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	121,259	2030/5/28
第311回大阪府公募公債		1.68	50,000	50,853	2018/2/28
第313回大阪府公募公債		1.66	50,000	50,974	2018/4/27
第318回大阪府公募公債		1.7	14,000	14,379	2018/9/28
第322回大阪府公募公債		1.62	60,000	61,873	2019/1/29
第332回大阪府公募公債		1.58	50,000	52,171	2019/11/27
第335回大阪府公募公債		1.48	30,000	31,324	2020/2/25
第336回大阪府公募公債		1.46	50,000	52,241	2020/3/30
第342回大阪府公募公債		1.2	25,000	26,067	2020/9/29
第344回大阪府公募公債		1.06	21,000	21,826	2020/11/27
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	52,676	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	73,221	2022/2/28
第404回大阪府公募公債		0.4	400,000	406,844	2026/1/28
第408回大阪府公募公債		0.072	118,000	116,466	2026/5/29
平成20年度第3回京都市公募公債		1.57	20,200	20,775	2018/12/19
平成21年度第3回京都市公募公債（20年）		2.19	100,000	121,591	2029/9/20
平成22年度第2回京都市公募公債		1.16	40,000	41,644	2020/9/24
平成22年度第7回京都市公募公債		1.31	45,900	48,324	2021/3/22
平成23年度第2回京都市公募公債		1.2	66,000	69,387	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	50,000	64,008	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債（15年）		1.31	100,000	110,235	2028/5/26
平成20年度第3回兵庫県公募公債		1.76	40,000	40,874	2018/5/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債		1.46	40,000	41,691	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	52,206	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債		0.77	100,000	103,966	2022/10/19
第3回静岡県公募公債（15年）		1.368	100,000	111,059	2027/10/29
第14回静岡県公募公債（20年）		1.736	100,000	116,599	2032/6/18
平成19年度第9回静岡県公募公債		1.53	50,000	50,833	2018/3/27
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	31,003	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	238,268	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債		1.44	50,000	51,743	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債		1.38	201,000	208,408	2019/10/30

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	28,334	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	73,273	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	105,278	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,074	2022/11/30
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	200,000	201,114	2027/2/12
平成19年度第4回広島県公募公債	1.53	29,300	29,778	2018/3/19
平成21年度第1回広島県公募公債	1.57	20,000	20,706	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	46,720	2020/9/24
平成27年度第5回広島県公募公債	0.41	200,000	203,774	2026/1/26
第8回埼玉県公募公債（20年）	2.19	100,000	121,591	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債（20年）	1.94	100,000	119,104	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債	1.87	29,000	29,724	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,440	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,029	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	105,662	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	52,698	2021/2/25
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	80,000	82,814	2019/5/24
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	84,059	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	84,300	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	83,896	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	83,880	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,129	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	56,371	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	83,982	2019/11/27
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	140,000	140,247	2026/2/26
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	43,810	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	56,880	2019/10/31
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	34,971	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	83,370	2019/4/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	208,448	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	51,861	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	20,843	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	103,970	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	200,000	21,042	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	104,728	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	73,430	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	312,681	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	104,504	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,832	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	624,060	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,366	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,894	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	204,946	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	104,273	2019/11/30
平成20年度第1回新潟市公募公債	1.56	34,190	35,168	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	98,020	2019/12/25

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成21年度第1回浜松市公募公債		1.54	33,900	35,334	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債		1.57	50,000	52,153	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債		1.28	50,000	52,484	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	200,000	21,053	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	102,917	2024/11/28
第1回名古屋市長官公債（20年）		1.99	100,000	112,896	2023/12/20
第9回名古屋市長官公債（20年）		2.07	100,000	119,475	2028/12/20
第9回名古屋市長官公債（30年）		2.095	90,000	111,780	2042/9/19
第3回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	116,596	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	133,749	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	104,654	2021/10/19
第5回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	116,472	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	250,000	290,837	2025/12/19
平成24年度第4回横浜市公募公債		0.81	100,000	104,421	2023/2/20
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	40,000	45,778	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債		1.05	50,000	51,849	2020/9/18
第7回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	120,140	2029/7/17
平成19年度第5回福岡市公募公債		1.49	20,000	20,325	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	30,000	30,783	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債		1.49	84,500	87,113	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	127,300	134,091	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	52,268	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	72,949	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債		1.56	50,000	51,429	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債		1.52	50,000	51,520	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	52,552	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債		1.29	60,000	62,924	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	149,170	155,029	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	170,188	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	130,300	134,265	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	36,500	38,058	2019/11/29
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	51,952	2020/11/30
平成27年度第1回岡山県公募公債		0.395	189,000	192,320	2026/1/29
小	計		11,841,810	12,705,803	
特殊債券(除く金融債)					
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	107,653	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	107,799	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	11,266	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	14,356	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	102,644	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	30,814	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	103,087	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	207,100	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	128,268	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	242,546	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	10,424	2020/2/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
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	121,454	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	126,476	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	119,058	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	118,277	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	119,125	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	14,735	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	123,093	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	104,852	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	313,470	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	169,951	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	209,792	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	31,453	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	352,590	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	105,514	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	104,136	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	410,448	2025/8/29
第344回	政府保証道路債券	1.6	100,000	105,451	2020/7/15
第13回	政府保証東日本高速道路債券	1.6	80,000	82,137	2018/10/19
第14回	政府保証東日本高速道路債券	1.4	80,000	82,066	2018/12/21
第12回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	109,160	2021/6/28
第1回	政府保証公営企業債券(15年)	1.6	200,000	210,702	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	206,986	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	206,740	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	32,040	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	14,365	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	206,432	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	11,528	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	21,058	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	210,634	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	36,611	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	104,242	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	39,831	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	105,262	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	104,479	2023/12/18
第2回	政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	108,736	2021/4/16
第25回	政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	104,836	2023/2/24
第16回	政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	94,003	2023/10/20
第5回	政府保証日本政策投資銀行	1.4	10,000	10,302	2019/4/15
第13回	政府保証中部国際空港債券	1.3	72,000	75,818	2021/3/15
第16回	政府保証西日本高速道路債券	1.6	75,000	77,097	2018/11/16
第17回	政府保証西日本高速道路債券	1.3	75,000	76,902	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	35,789	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	144,716	2045/9/20
第17回	道路債券(財投機関債)	1.54	150,000	162,897	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	139,367	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	151,111	2047/3/20

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.37	100,000	122,338	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	123,602	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	103,542	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	105,189	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	116,859	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	105,355	2023/6/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	105,718	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	135,895	2034/3/24
第5回地方公団金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.22	100,000	121,941	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	114,564	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	114,915	2024/3/22
第12回地方公団金融機構債券(財投機関債)	1.38	100,000	104,456	2020/5/28
第13回地方公団金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	104,223	2020/6/26
第13回地方公団金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.132	100,000	121,419	2031/1/28
第19回地方公団金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.84	100,000	117,783	2031/12/26
第23回地方公団金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	115,495	2032/7/28
第44回地方公団金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	208,398	2023/1/27
F131回地方公団金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	79,539	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	110,836	2022/6/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	102,932	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.26	100,000	116,876	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	105,350	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	199,680	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	43,482	46,107	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	45,844	48,840	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	23,088	23,513	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	34,640	36,294	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	52,776	55,230	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	18,496	19,713	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	55,725	59,370	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	23,600	25,019	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	39,573	40,462	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	14,137	14,485	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	15,637	15,878	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	25,214	26,864	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	58,230	60,501	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	59,412	61,878	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	29,781	30,879	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	16,518	17,172	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	124,965	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	40,294	43,170	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	21,166	22,090	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	41,413	44,209	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	23,077	24,114	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	93,382	99,243	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	91,136	96,460	2045/6/10

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	42,096	44,179	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	52,715	55,066	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	41,736	44,601	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	40,454	43,271	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	178,257	190,310	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	103,658	110,500	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	99,724	106,812	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	49,102	52,271	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	48,903	51,848	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	53,569	56,815	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	46,928	50,246	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	56,262	59,362	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	57,859	60,978	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	63,294	66,640	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	64,957	68,392	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	66,228	69,375	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	130,054	135,855	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	105,134	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	211,794	219,660	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	74,497	77,108	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	149,182	154,167	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	104,615	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	112,179	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	118,064	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	159,490	163,429	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	237,046	2032/4/16
第17回国際協力機構債券(財投機関債)		0.72	30,000	31,153	2022/12/26
第13回中日本高速道路		1.49	100,000	104,158	2019/12/20
第38回中日本高速道路		0.677	100,000	101,338	2019/2/28
第21回西日本高速道路		0.754	100,000	104,012	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	103,644	2021/9/17
小	計		12,414,380	13,477,297	
金融債券					
い第755号農林債券		0.3	100,000	100,343	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	100,623	2018/9/27
い第761号農林債券		0.3	100,000	100,487	2018/10/26
い第765号農林債券		0.3	200,000	201,150	2019/2/27
い第769号農林債券		0.3	130,000	130,869	2019/6/27
い第774号農林債券		0.24	100,000	100,608	2019/11/27
い第778号農林債券		0.25	300,000	302,037	2020/3/27
第288回信中金債		0.3	200,000	201,024	2018/11/27
第321回信中金債		0.03	200,000	199,774	2021/8/27
小	計		1,530,000	1,537,473	
普通社債券					
第459回東京電力		2.7	20,000	20,949	2019/1/29

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第542回東京電力	1.602	100,000	101,638	2018/4/25
第548回東京電力	2.347	100,000	113,583	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	143,999	2019/10/29
第497回中部電力	0.986	100,000	102,939	2020/10/23
第499回中部電力	1.194	50,000	52,898	2023/6/23
第518回中部電力	0.19	200,000	199,472	2023/1/25
第478回関西電力	1.448	100,000	103,669	2020/1/24
第365回中国電力	1.405	100,000	103,611	2019/12/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,588	2020/10/23
第431回東北電力	2.05	80,000	81,726	2018/3/23
第400回九州電力	1.777	70,000	73,479	2020/4/24
第296回北海道電力	2.027	100,000	102,646	2018/6/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	100,899	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,200	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,966	2019/9/25
第26回関西国際空港	1.156	100,000	104,040	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	103,899	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,177	2021/6/18
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	201,940	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,402	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,237	2021/9/17
第5回日本電産	0.001	100,000	99,801	2019/11/25
第12回パナソニック	0.387	100,000	100,716	2020/3/19
第15回パナソニック	0.19	100,000	99,964	2021/9/17
第30回ソニー	0.05	100,000	99,819	2019/9/20
第12回デンソー	0.01	100,000	99,431	2021/9/17
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,395	2019/8/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,179	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	103,520	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	102,186	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	210,674	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	106,233	2021/10/29
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	400,000	401,864	2018/4/20
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	120,275	2027/4/20
第6回りそな銀行（劣後特約付）	2.084	100,000	105,575	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行（劣後特約付）	1.68	100,000	105,954	2021/4/28
第12回住友信託銀行（劣後特約付）	1.373	100,000	104,211	2020/11/11
第15回住友信託銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	106,454	2022/3/22
第17回三井住友銀行（劣後特約付）	2.8	200,000	210,586	2019/2/12
第20回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	100,000	104,976	2019/7/24
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	104,372	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	105,300	2020/12/17
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	113,974	2026/9/11
第19回みずほ銀行（劣後特約付）	1.67	100,000	106,559	2022/2/24
第12回芙蓉総合リース	0.12	100,000	99,672	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	100,000	99,635	2019/6/20

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,314	2020/3/19
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,670	2019/12/20
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,871	2020/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,829	2021/3/19
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	100,051	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,920	2021/6/18
第62回日立キャピタル	0.001	200,000	199,654	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	101,018	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,435	2020/10/30
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,394	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	198,186	2021/7/23
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	105,518	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	115,064	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	102,394	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	113,549	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	117,035	2027/3/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,919	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	21,795	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	111,100	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	114,446	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	116,826	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	106,726	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	120,563	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	110,844	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	104,218	2020/6/11
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,348	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	122,697	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,199	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	205,328	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	103,150	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	101,725	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,419	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	113,378	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	105,207	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,153	2025/12/18
第20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	103,171	2018/5/29
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,207	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	100,451	2019/5/2
第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.2	100,000	100,057	2017/3/9
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,381	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,397	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	99,994	2020/5/22
小 計		9,621,000	10,022,886	
合 計		195,841,190	212,732,787	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			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	期中率	期騰落	期中率			
	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 (419,559)
	社債券	1,506,951	4,451,059 (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	債券先物取引	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
国債証券		%	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	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第45回利付国債 (30年)		1.5	520,000	686,036	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	630,000	831,650	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	620,000	836,652	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	670,000	868,655	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	460,000	597,452	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	410,000	462,943	2046/3/20
第36回利付国債 (20年)		3.0	50,000	52,168	2017/9/20
第37回利付国債 (20年)		3.1	250,000	261,175	2017/9/20
第39回利付国債 (20年)		2.6	1,120,000	1,178,195	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)		2.3	290,000	307,191	2018/9/20
第41回利付国債 (20年)		1.5	240,000	251,827	2019/3/20
第42回利付国債 (20年)		2.6	835,000	902,242	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)		2.9	360,000	397,699	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)		2.5	710,000	784,429	2020/3/20
第45回利付国債 (20年)		2.4	100,000	110,098	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)		2.2	100,000	110,552	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)		2.5	250,000	281,447	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)		2.1	170,000	189,196	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)		1.9	515,000	567,993	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)		2.0	140,000	155,996	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)		2.1	260,000	292,601	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)		2.1	80,000	90,501	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	530,000	602,562	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	240,000	271,514	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	420,693	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	180,937	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	397,726	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	665,354	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	254,858	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	281,967	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	600,824	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	314,690	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	555,148	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	499,264	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	196,076	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	93,238	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	469,769	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	141,762	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	617,293	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	238,802	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	768,001	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	237,354	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	454,271	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	276,018	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	248,264	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	309,696	2025/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第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
国債証券		%	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	
地方債証券					
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
地方債証券		%	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回京都府公募公債		1.57	20,200	21,011	2018/12/19
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)		2.19	100,000	126,031	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債		1.16	40,000	42,008	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債		1.31	45,900	48,797	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債		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
地方債証券	%	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
地方債証券		%	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	
特殊債券(除く金融債)					
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
特殊債券(除く金融債)		%	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
特殊債券(除く金融債)		%	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
特殊債券(除く金融債)		%	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	
金融債券					
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
金融債券	%	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	
普通社債券				
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
	千円	%
公社債	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
1万口当たり基準価額(C/D)	14,075円

<注記事項>

- 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 プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	26,078,973,744円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	39,433,106,342円
三菱UFJ プライムバランス(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 プライムバランス(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。