

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の公社債に直接投資することがあります。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※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）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第2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「eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）」は、去る1月26日に第2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。

MUFG

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.mufig.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			合成ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	円	円	%		%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	—	—	—	10,000	—	—	—	1
1期(2016年1月26日)	10,141	0	0	1.4	10,163	1.6	96.9	0.0	537
2期(2017年1月26日)	10,150	0	0	0.1	10,223	0.6	97.7	—	167

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合およびシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(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		合 成 ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年1月26日	円 10,141	% —	10,163	% —	% 96.9	% 0.0
1月末	10,196	0.5	10,221	0.6	98.1	0.1
2月末	10,336	1.9	10,363	2.0	95.1	0.1
3月末	10,386	2.4	10,420	2.5	104.5	0.1
4月末	10,389	2.4	10,429	2.6	97.5	—
5月末	10,437	2.9	10,486	3.2	99.4	0.1
6月末	10,616	4.7	10,666	4.9	94.6	0.1
7月末	10,590	4.4	10,647	4.8	99.2	0.1
8月末	10,547	4.0	10,604	4.3	98.4	0.1
9月末	10,538	3.9	10,598	4.3	97.7	0.1
10月末	10,407	2.6	10,470	3.0	99.7	0.1
11月末	10,272	1.3	10,336	1.7	100.9	0.1
12月末	10,241	1.0	10,309	1.4	99.7	0.1
(期 末) 2017年1月26日	10,150	0.1	10,223	0.6	97.7	—

(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。

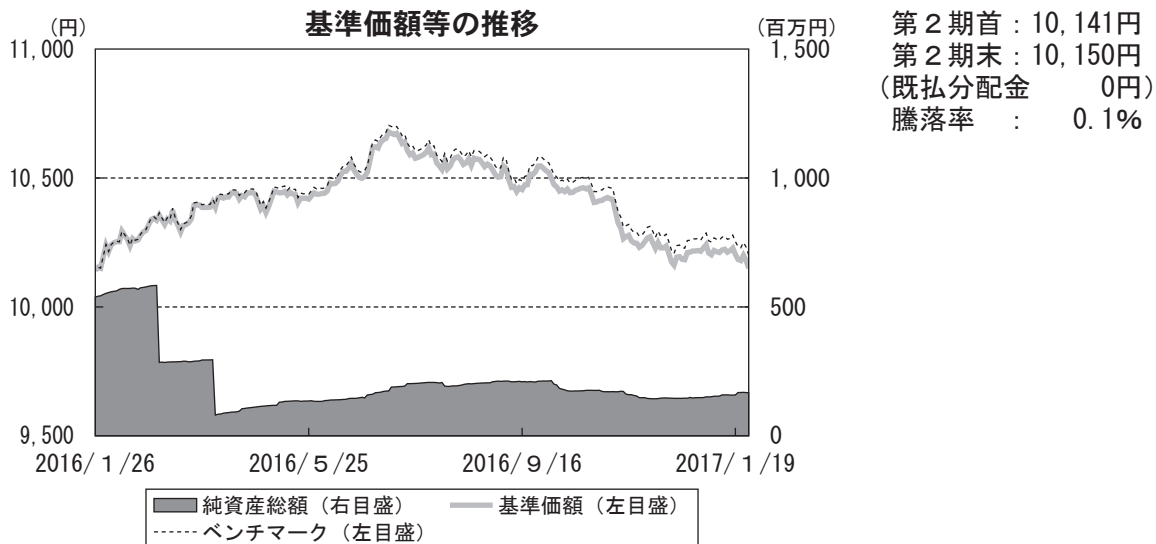
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第2期：2016/1/27～2017/1/26）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.1%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（0.6%）を0.5%下回りました。

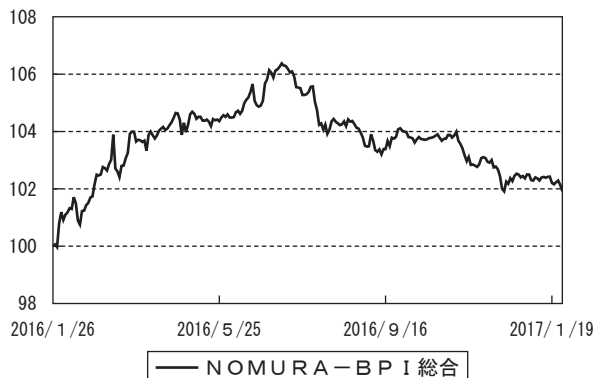


基準価額の主な変動要因

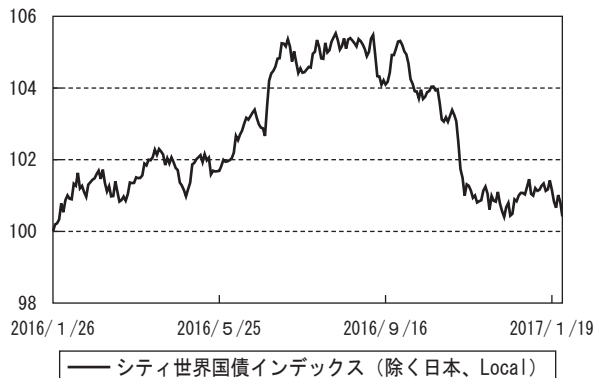
上昇要因	国内債券市況の上昇が、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	信託報酬等コストが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第2期：2016/1/27～2017/1/26）

市況の推移
（期首を100として指数化）

（注）NOMURA-BPI総合とは、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。

市況の推移
（期首を100として指数化）

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎国内債券市況

- ・期の前半は、日本銀行が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、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。

◎外国債券市況

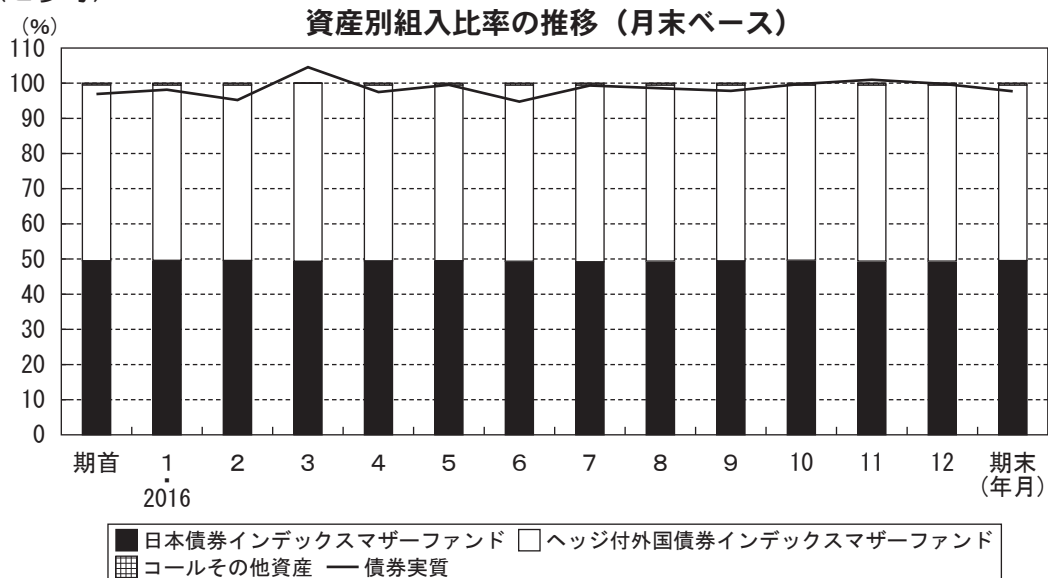
- ・世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

- ・日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

（ご参考）



＜日本債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ1.9%の上昇となりました。

- ・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。
 - ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有していません。
 - ・ベンチマーク（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1月26日）

期末（2017年1月26日）

最終利回り	0.3%	➡	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	8.3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。

＜ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2016年1月26日）

期末（2017年1月26日）

最終利回り	1.2%	➡	最終利回り	1.4%
直接利回り	2.4%		直接利回り	2.4%
デュレーション	6.5年		デュレーション	6.7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

＜eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）＞
 基準価額の騰落率は0.1%の上昇となり、ベンチ
 マークの0.6%の上昇を0.5%下回りました。

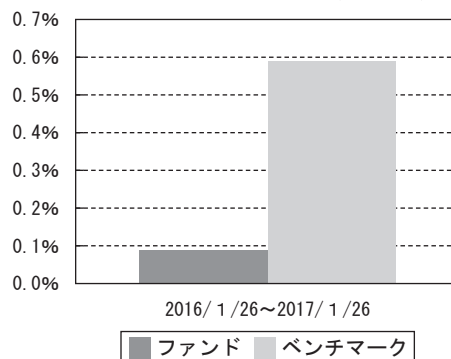
差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

日本債券インデックスマザーファンド 0.0%程度
 ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド 0.0%程度

その他（信託報酬等） Δ 0.5%程度

基準価額（ベビーファンド）と
 ベンチマークの対比（騰落率）



＜日本債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークは1.9%の上昇となったため、カイ離は Δ 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	Δ 0.0%程度	Δ 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、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは 0.8% の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.1% 程度	$\Delta 0.1\%$ 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。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・ 期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は 0.1% 程度でした。

- ・ 為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。
為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・ 為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

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2期
	2016年1月27日～2017年1月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	217

(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

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

◎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。

< ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

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

○ 1万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26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 ）	(18)	(0.176)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(18)	(0.176)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(5)	(0.050)	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	1	0.010	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.006)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	43	0.412	
期中の平均基準価額は、10,412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1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	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	101,485	130,841	247,852	317,981
日本債券インデックスマザーファンド	94,191	126,097	237,693	315,844

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）>

該当事項はございません。

<日本債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 247,298	百万円 57,202	% 23.1	百万円 282,407	百万円 46,162	% 16.3

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 983,021	百万円 474,947	% 48.3	百万円 1,020,009	百万円 511,226	% 50.1
為替直物取引	57,076	39,514	69.2	20,030	10,168	50.8

平均保有割合 0.1%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 801	百万円 1,134	百万円 2,143

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 4,400

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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	千口	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	213,069	66,702	83,437	千円
日本債券インデックスマザーファンド	206,524	63,022	82,792	千円

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 83,437	% 49.4
日本債券インデックスマザーファンド	82,792	49.1
コール・ローン等、その他	2,558	1.5
投資信託財産総額	168,787	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（90,456,093千円）の投資信託財産総額（92,232,535千円）に対する比率は98.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	168,787,887
コール・ローン等	1,756,019
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	83,437,882
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	82,792,458
未収入金	801,528
(B) 負債	1,703,432
未払解約金	1,312,015
未払信託報酬	387,988
未払利息	2
その他未払費用	3,427
(C) 純資産総額(A-B)	167,084,455
元本	164,616,660
次期繰越損益金	2,467,795
(D) 受益権総口数	164,616,660口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,150円

<注記事項>

- ①期首元本額 530,165,987円
 期中追加設定元本額 304,481,927円
 期中一部解約元本額 670,031,254円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0150円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年1月27日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,415,493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	1,913,092円
分配準備積立金額	248,932円
当ファンドの分配対象収益額	3,577,517円
1万口当たり収益分配対象額	217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1月27日～2017年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 314
受取利息	21
支払利息	△ 335
(B) 有価証券売買損益	△2,784,714
売買益	4,313,557
売買損	△7,098,271
(C) 信託報酬等	△ 925,247
(D) 当期損益金(A+B+C)	△3,710,275
(E) 前期繰越損益金	248,932
(F) 追加信託差損益金	5,929,138
(配当等相当額)	(1,574,169)
(売買損益相当額)	(4,354,969)
(G) 計(D+E+F)	2,467,795
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	2,467,795
追加信託差損益金	5,929,138
(配当等相当額)	(1,913,092)
(売買損益相当額)	(4,016,046)
分配準備積立金	1,664,425
繰越損益金	△5,125,768

- (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】

- 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附加され、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）

<日本債券インデックスマザーファンド>

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体（325,711,127千円）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	319,586,000 (100,000)	349,528,665 (100,252)	81.7 (0.0)	— (—)	51.7 (—)	20.3 (—)	9.8 (0.0)	
地方債証券	23,613,370 (23,613,370)	25,080,161 (25,080,161)	5.9 (5.9)	— (—)	3.6 (3.6)	1.7 (1.7)	0.5 (0.5)	
特殊債券 (除く金融債)	26,494,197 (26,494,197)	28,415,579 (28,415,579)	6.6 (6.6)	— (—)	4.5 (4.5)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)	
金融債券	2,690,000 (2,690,000)	2,709,848 (2,709,848)	0.6 (0.6)	— (—)	0.0 (0.0)	0.4 (0.4)	0.2 (0.2)	
普通社債券	19,373,000 (19,373,000)	20,009,260 (20,009,260)	4.7 (4.7)	0.2 (0.2)	1.3 (1.3)	3.0 (3.0)	0.4 (0.4)	
合 計	391,756,567 (72,270,567)	425,743,514 (76,315,101)	99.5 (17.8)	0.2 (0.2)	61.1 (9.4)	26.8 (6.5)	11.6 (1.9)	

(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361回利付国債（2年）	0.1	600,000	602,448
第362回利付国債（2年）	0.1	700,000	702,947
第363回利付国債（2年）	0.1	1,630,000	1,637,188
第364回利付国債（2年）	0.1	2,000,000	2,009,160
第365回利付国債（2年）	0.1	400,000	401,872
第366回利付国債（2年）	0.1	680,000	683,270
第368回利付国債（2年）	0.1	1,400,000	1,407,294
第369回利付国債（2年）	0.1	1,000,000	1,005,390
第370回利付国債（2年）	0.1	1,600,000	1,609,056
第109回利付国債（5年）	0.1	2,350,000	2,360,011
第110回利付国債（5年）	0.3	1,080,000	1,087,063
第111回利付国債（5年）	0.4	1,410,000	1,420,828
第112回利付国債（5年）	0.4	1,400,000	1,412,558
第113回利付国債（5年）	0.3	2,440,000	2,458,495
第114回利付国債（5年）	0.3	2,090,000	2,107,681
第115回利付国債（5年）	0.2	3,670,000	3,694,735
第116回利付国債（5年）	0.2	2,080,000	2,095,953
第117回利付国債（5年）	0.2	3,320,000	3,347,356
第118回利付国債（5年）	0.2	2,260,000	2,280,294
第119回利付国債（5年）	0.1	850,000	855,593
第120回利付国債（5年）	0.2	2,390,000	2,413,111
第121回利付国債（5年）	0.1	1,580,000	1,591,091
第122回利付国債（5年）	0.1	3,970,000	3,999,338
第123回利付国債（5年）	0.1	2,360,000	2,378,195
第124回利付国債（5年）	0.1	4,230,000	4,263,797
第125回利付国債（5年）	0.1	3,560,000	3,589,263
第126回利付国債（5年）	0.1	2,960,000	2,985,426
第127回利付国債（5年）	0.1	2,950,000	2,976,343
第128回利付国債（5年）	0.1	4,700,000	4,743,475
第129回利付国債（5年）	0.1	2,000,000	2,018,620
第130回利付国債（5年）	0.1	1,800,000	1,817,226
第1回利付国債（40年）	2.4	405,000	577,311
第2回利付国債（40年）	2.2	600,000	826,344
第3回利付国債（40年）	2.2	593,000	821,192
第4回利付国債（40年）	2.2	878,000	1,222,325
第5回利付国債（40年）	2.0	835,000	1,115,919
第6回利付国債（40年）	1.9	770,000	1,010,255
第7回利付国債（40年）	1.7	950,000	1,191,366
第8回利付国債（40年）	1.4	940,000	1,090,456
第9回利付国債（40年）	0.4	870,000	724,188
第290回利付国債（10年）	1.4	1,640,000	1,671,242
第291回利付国債（10年）	1.3	940,000	956,844
第292回利付国債（10年）	1.7	794,000	811,841
第293回利付国債（10年）	1.8	1,081,000	1,111,743
第294回利付国債（10年）	1.7	1,570,000	1,612,468

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	1,240,000	1,270,094	2018/6/20
第296回利付国債（10年）	1.5	2,020,000	2,076,782	2018/9/20
第297回利付国債（10年）	1.4	1,636,000	1,685,587	2018/12/20
第298回利付国債（10年）	1.3	2,640,000	2,715,028	2018/12/20
第299回利付国債（10年）	1.3	2,760,000	2,847,795	2019/3/20
第300回利付国債（10年）	1.5	957,000	991,547	2019/3/20
第301回利付国債（10年）	1.5	2,072,000	2,154,900	2019/6/20
第302回利付国債（10年）	1.4	2,250,000	2,334,622	2019/6/20
第303回利付国債（10年）	1.4	2,325,000	2,421,417	2019/9/20
第304回利付国債（10年）	1.3	1,170,000	1,215,419	2019/9/20
第305回利付国債（10年）	1.3	308,000	320,997	2019/12/20
第306回利付国債（10年）	1.4	2,488,000	2,609,016	2020/3/20
第307回利付国債（10年）	1.3	1,610,000	1,683,238	2020/3/20
第308回利付国債（10年）	1.3	1,374,000	1,440,817	2020/6/20
第309回利付国債（10年）	1.1	2,300,000	2,396,209	2020/6/20
第310回利付国債（10年）	1.0	2,886,000	3,004,095	2020/9/20
第311回利付国債（10年）	0.8	1,600,000	1,653,776	2020/9/20
第312回利付国債（10年）	1.2	4,030,000	4,236,094	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	2,969,000	3,142,181	2021/3/20
第314回利付国債（10年）	1.1	1,590,000	1,669,547	2021/3/20
第315回利付国債（10年）	1.2	1,853,000	1,959,121	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	780,000	821,230	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	1,557,000	1,643,288	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	1,730,000	1,817,832	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	1,519,000	1,607,345	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	1,980,000	2,085,435	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	2,515,000	2,655,010	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	1,170,000	1,229,108	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	1,675,000	1,763,306	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	2,650,000	2,775,398	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	2,935,000	3,078,668	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	1,360,000	1,420,642	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	2,440,000	2,563,220	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	2,150,000	2,235,978	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	3,410,000	3,594,515	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	2,930,000	3,092,761	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	1,360,000	1,417,460	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	3,410,000	3,555,811	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	2,620,000	2,732,136	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	3,950,000	4,120,482	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	3,450,000	3,574,924	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	1,530,000	1,586,579	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	2,190,000	2,236,515	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	3,910,000	4,025,736	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	4,100,000	4,223,328	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	3,280,000	3,380,171	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	2,770,000	2,831,272	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	3,770,000	3,783,685	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	3,710,000	3,722,094	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	3,690,000	3,698,819	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	1,100,000	1,101,617	2026/12/20
第1回利付国債（30年）	2.8	76,000	100,419	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	98,000	125,275	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	117,000	148,449	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	127,000	172,140	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	108,000	136,513	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	169,000	219,309	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	164,000	210,905	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	142,000	172,459	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	116,000	133,727	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	204,626	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	164,261	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	277,910	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	255,872	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	647,471	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	460,743	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	402,837	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	431,133	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	556,176	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	394,833	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	495,000	662,656	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	494,174	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	570,000	763,748	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	554,000	743,246	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	411,000	551,578	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	742,000	968,695	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	884,000	1,171,945	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	860,000	1,160,071	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,031,000	1,395,788	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	1,030,000	1,379,788	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,246,000	1,650,202	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	788,000	1,031,066	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,319,000	1,758,424	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,424,000	1,814,176	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,376,000	1,819,030	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	1,599,000	2,048,734	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,419,000	1,823,017	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	1,547,000	1,956,908	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	865,000	1,076,397	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,160,000	1,471,668	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	1,000,000	1,245,570	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	760,000	929,867	2043/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第42回利付国債（30年）	1.7	800,000	979,072	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,010,000	1,236,421	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	1,080,000	1,322,449	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	870,000	1,022,841	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	1,260,000	1,481,256	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,050,000	1,261,827	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,250,000	1,439,837	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	1,290,000	1,487,318	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	1,080,000	1,077,451	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	1,270,000	1,101,864	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	1,170,000	1,074,317	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	300,000	282,798	2046/12/20
第38回利付国債（20年）	2.7	400,000	413,536	2018/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	601,000	625,743	2018/9/20
第42回利付国債（20年）	2.6	869,000	920,757	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	74,000	79,999	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	480,000	519,806	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	114,000	123,671	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	209,000	230,267	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	515,000	562,210	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	200,000	218,466	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	214,000	235,840	2021/9/21
第54回利付国債（20年）	2.2	480,000	533,827	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	241,000	266,856	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	449,000	499,516	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	147,000	163,439	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	589,000	650,438	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	289,000	307,860	2023/3/20
第63回利付国債（20年）	1.8	442,000	494,067	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	441,000	497,611	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	318,000	360,233	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	500,000	562,955	2023/12/20
第68回利付国債（20年）	2.2	846,000	979,126	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	422,000	496,255	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	160,000	185,793	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	534,000	618,473	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	620,000	716,112	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	318,000	369,795	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	575,000	671,306	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	200,000	230,254	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	210,000	243,469	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	410,000	473,738	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	50,000	58,191	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	315,000	369,236	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	350,000	408,702	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	662,000	778,723	2025/9/20

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第83回利付国債（20年）	2.1	413,000	487,914
第84回利付国債（20年）	2.0	670,000	785,601
第85回利付国債（20年）	2.1	490,000	581,071
第86回利付国債（20年）	2.3	515,000	620,075
第87回利付国債（20年）	2.2	450,000	537,727
第88回利付国債（20年）	2.3	804,000	971,642
第89回利付国債（20年）	2.2	410,000	491,663
第90回利付国債（20年）	2.2	1,100,000	1,324,312
第91回利付国債（20年）	2.3	468,000	567,913
第92回利付国債（20年）	2.1	1,432,000	1,715,765
第93回利付国債（20年）	2.0	510,000	607,517
第94回利付国債（20年）	2.1	715,000	858,893
第95回利付国債（20年）	2.3	917,000	1,123,792
第96回利付国債（20年）	2.1	520,000	626,584
第97回利付国債（20年）	2.2	743,000	905,330
第98回利付国債（20年）	2.1	70,000	84,558
第99回利付国債（20年）	2.1	1,345,000	1,629,454
第100回利付国債（20年）	2.2	910,000	1,115,514
第101回利付国債（20年）	2.4	573,000	714,972
第102回利付国債（20年）	2.4	530,000	663,872
第103回利付国債（20年）	2.3	550,000	682,759
第104回利付国債（20年）	2.1	520,000	633,869
第105回利付国債（20年）	2.1	1,110,000	1,356,031
第106回利付国債（20年）	2.2	431,000	531,457
第107回利付国債（20年）	2.1	687,000	841,492
第108回利付国債（20年）	1.9	580,000	696,916
第109回利付国債（20年）	1.9	700,000	842,968
第110回利付国債（20年）	2.1	976,000	1,198,518
第111回利付国債（20年）	2.2	711,000	883,943
第112回利付国債（20年）	2.1	740,000	911,036
第113回利付国債（20年）	2.1	1,432,000	1,767,374
第114回利付国債（20年）	2.1	880,000	1,088,692
第115回利付国債（20年）	2.2	654,000	817,303
第116回利付国債（20年）	2.2	606,000	758,681
第117回利付国債（20年）	2.1	1,160,000	1,437,460
第118回利付国債（20年）	2.0	666,000	818,021
第119回利付国債（20年）	1.8	660,000	793,531
第120回利付国債（20年）	1.6	530,000	623,481
第121回利付国債（20年）	1.9	819,000	997,222
第122回利付国債（20年）	1.8	760,000	915,359
第123回利付国債（20年）	2.1	1,048,000	1,306,457
第124回利付国債（20年）	2.0	700,000	863,254
第125回利付国債（20年）	2.2	734,000	926,865
第126回利付国債（20年）	2.0	810,000	1,000,098
第127回利付国債（20年）	1.9	590,000	720,437
第128回利付国債（20年）	1.9	1,064,000	1,300,569

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129回利付国債（20年）	1.8	100,000	120,853	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	1,112,000	1,344,952	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	580,000	693,372	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	477,000	570,539	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	1,190,000	1,440,268	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	85,000	102,935	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	600,000	717,966	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	550,000	650,215	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	472,000	565,031	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	450,000	525,555	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	480,000	567,600	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	1,297,000	1,553,144	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	1,550,000	1,857,938	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	840,000	1,019,474	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	880,000	1,041,620	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	830,000	969,108	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	2,160,000	2,589,818	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	1,780,000	2,134,326	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	2,030,000	2,400,150	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	1,520,000	1,772,472	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	2,060,000	2,401,033	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	1,990,000	2,285,853	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	2,100,000	2,339,421	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	1,930,000	2,147,472	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	1,900,000	2,145,100	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	2,220,000	2,461,846	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	1,810,000	1,941,044	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	1,530,000	1,472,410	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	2,230,000	2,057,219	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	1,690,000	1,645,840	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	100,000	99,032	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		319,586,000	349,528,665	
地方債証券				
第1回東京都公募公債（20年）	1.54	20,000	21,872	2023/6/20
第7回東京都公募公債（30年）	2.51	10,000	13,163	2038/9/17
第8回東京都公募公債（30年）	2.23	80,000	100,884	2038/9/17
第16回東京都公募公債（20年）	2.01	100,000	119,300	2028/12/20
第20回東京都公募公債（20年）	2.09	80,000	96,796	2029/9/20
第21回東京都公募公債（20年）	2.19	80,000	97,979	2029/12/20
第22回東京都公募公債（20年）	1.92	120,000	143,367	2030/6/20
第24回東京都公募公債（20年）	1.98	70,000	84,535	2031/6/20
第28回東京都公募公債（20年）	1.59	100,000	115,326	2033/3/18
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	154,612	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	51,929	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	103,925	2019/12/20

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680回東京都公募公債	1.39	100,000	104,303	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	104,334	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	103,579	2020/6/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	105,155	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	105,609	2021/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	178,938	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	103,956	2022/6/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	104,172	2022/12/20
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	103,270	2023/3/20
第721回東京都公募公債	0.84	100,000	104,900	2023/6/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	104,645	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	103,841	2023/12/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	104,076	2024/3/19
第750回東京都公募公債	0.444	300,000	307,341	2025/12/19
第751回東京都公募公債	0.37	300,000	305,391	2025/12/19
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	101,799	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	55,444	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	103,828	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,061	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,508	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,102	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	204,626	2024/12/26
第1回神奈川県公募公債（20年）	2.55	100,000	117,702	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債（20年）	2.23	80,000	92,629	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債（30年）	2.87	80,000	109,184	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債（20年）	2.11	100,000	116,172	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	111,739	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	111,901	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	145,834	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	117,769	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	56,650	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	250,260	2020/3/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	104,369	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	134,224	2020/9/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,169	2022/6/20
第5回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	121,969	2030/5/28
第11回大阪府公募公債（20年）	1.693	200,000	233,258	2033/9/27
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	100,139	2018/3/28
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	102,048	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	30,713	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	102,753	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	158,622	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,382	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	103,815	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	74,755	2019/11/27
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,068	2020/4/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,506	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,539	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,238	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,615	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,696	2022/3/29
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	102,797	2024/10/30
第404回大阪府公募公債	0.4	113,000	115,079	2026/1/28
平成21年度第5回京都市公募公債	1.35	20,000	20,770	2019/12/24
平成22年度第5回京都市公募公債	1.26	110,000	115,295	2020/12/21
平成23年度第9回京都市公募公債	1.01	140,000	146,918	2022/3/16
平成24年度第3回京都市公募公債 (20年)	1.63	200,000	231,406	2027/8/13
平成24年度第10回京都市公募公債	0.67	100,000	103,638	2023/3/22
平成25年度第1回京都市公募公債	0.58	100,000	103,137	2023/4/28
平成25年度第2回京都市公募公債 (15年)	1.05	100,000	107,851	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債 (18年)	1.26	200,000	219,484	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	51,723	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,257	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	108,149	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債 (20年)	1.64	300,000	346,146	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	116,288	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,334	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	124,286	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	197,035	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	104,264	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	14,830	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	102,671	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	102,578	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,302	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,004	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	106,405	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,015	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	103,695	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	103,131	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	105,441	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	135,288	2023/10/24
平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年)	0.204	100,000	100,386	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	103,449	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	124,763	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	104,881	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	104,640	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	104,744	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,861	2022/1/31
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26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	103,195	2024/8/26
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	61,873	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,095	2021/3/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,042	2021/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,618	2025/11/25
平成21年度第1回埼玉県公募公債	1.53	200,000	206,740	2019/4/23
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	100,000	103,711	2019/12/25
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23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,279	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	104,215	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	154,594	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,383	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債	2.62	70,000	92,970	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債	2.28	80,000	101,716	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	104,371	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	103,875	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,686	2020/10/28
平成25年度第11回福岡県公募公債	0.694	300,000	312,132	2024/2/26
第9回千葉県公募公債（20年）	1.84	80,000	94,714	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	92,124	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	82,099	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	82,094	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,011	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	83,945	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,982	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,049	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	104,296	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,084	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	192,619	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	23,804	2019/7/29
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	104,489	2022/10/31
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	102,280	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	205,246	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	102,624	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	92,262	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	103,595	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	103,903	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,389	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,089	2019/9/25
第79回共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	207,216	2019/10/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	113,628	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,201	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,119	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	105,311	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,685	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	104,618	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	209,836	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	178,918	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,441	2022/5/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,948	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,255	2022/9/22
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,820	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,703	2023/3/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	240,352	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	207,596	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	207,618	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,456	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	206,310	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	300,000	308,127	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	100,000	102,497	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,960	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,372	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	309,672	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	308,709	2025/9/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	500,000	513,960	2025/11/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,578	2025/12/25
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,104	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,525	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	63,749	2024/1/24
第1回大阪市公募公債（15年）	1.753	200,000	229,212	2026/7/17
第5回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	124,154	2028/9/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	130,462	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,465	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,360	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債（12年）	1.033	100,000	107,195	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債（20年）	2.56	100,000	117,775	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債（20年）	2.26	80,000	98,256	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,935	2021/12/20
第484回名古屋市公募公債	0.801	100,000	104,732	2023/9/20
第5回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	60,193	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	104,683	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,205	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	2.54	120,000	146,182	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債（20年）	2.09	80,000	97,527	2031/1/24
第7回横浜市公募公債（20年）	2.06	200,000	233,150	2025/12/19
第17回横浜市公募公債（20年）	2.07	80,000	95,880	2028/12/20
平成20年度第3回横浜市公募公債	1.56	200,000	204,954	2018/9/7
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	103,040	2018/11/16
第20回横浜市公募公債（20年）	2.1	80,000	96,817	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	104,437	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	103,873	2022/12/22
第25回横浜市公募公債（20年）	1.72	100,000	117,092	2032/7/16
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	60,000	69,159	2033/5/20

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	
平成21年度第5回札幌市公募公債		1.36	112,000	115,959	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）		2.277	80,000	102,664	2040/9/20
第3回川崎市公募公債（15年）		1.82	100,000	106,998	2020/12/21
第44回川崎市公募公債（5年）		0.162	130,400	131,005	2020/6/19
第82回川崎市公募公債		1.52	100,000	103,958	2019/9/20
第17回北九州市公募公債（20年）		1.529	100,000	114,085	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債		1.52	100,000	102,095	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	91,000	93,447	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	106,500	112,230	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	100,000	104,626	2021/10/28
平成25年度第3回福岡市公募公債（5年）		0.31	31,500	31,649	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債		0.68	50,000	51,970	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）		1.371	100,000	111,311	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	104,259	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	104,290	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	102,711	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	90,497	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,150	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,388	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,127	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	103,703	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	102,634	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,127	2018/12/25
小	計		23,613,370	25,080,161	
特殊債券(除く金融債)					
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	101,515	2018/1/31
第54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	101,609	2018/3/23
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	102,272	2018/5/30
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	34,000	34,869	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	206,000	211,207	2018/8/29
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	224,000	229,577	2018/9/28
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	50,000	51,400	2018/10/31
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	115,000	118,359	2018/11/28
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	159,000	163,280	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	141,000	144,895	2019/3/19
第80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	206,998	2019/5/31
第81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	242,702	2029/5/31
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	210,000	217,595	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	100,000	103,495	2019/7/31
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	79,000	81,727	2019/9/30
第90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	121,669	2029/9/28
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	100,000	121,743	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	139,000	143,827	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	210,000	218,179	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	129,732	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	50,000	52,035	2020/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第106回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110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	200,000	208,834	2020/6/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	103,638	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	115,830	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	71,000	74,311	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	121,309	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	95,306	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	60,000	62,946	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	127,543	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,704	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	237,662	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	142,515	2021/11/30
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	112,000	117,070	2022/2/28
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	109,000	113,981	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.977	100,000	105,064	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	117,953	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	242,058	2042/5/30
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	12,000	12,572	2022/6/30
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.805	100,000	104,612	2022/11/30
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	103,961	2023/3/17
第188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	112,841	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	157,960	2023/4/28
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195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	223,000	235,869	2023/7/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	228,000	237,808	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	188,000	196,403	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	322,000	335,218	2024/3/29
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	104,162	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	103,853	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	112,560	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	100,000	103,423	2024/10/31
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	101,750	2025/1/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.391	100,000	102,342	2025/4/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	130,000	132,291	2026/1/30
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	105,510	2020/7/15
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	28,769	2018/10/19
第20回政府保証中日本高速道路債券		1.4	10,000	10,158	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	90,000	92,189	2018/9/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	25,000	25,856	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	207,618	2019/8/16
第4回政府保証公営企業債券(15年)		2.0	100,000	110,406	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	200,000	205,128	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	111,938	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.25	300,000	301,260	2018/10/29
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	103,083	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.5	148,000	153,135	2019/5/24

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9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.32	100,000	100,699	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,046	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	200,000	208,570	2020/5/22
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	103,782	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	103,594	2020/9/14
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	104,421	2020/11/17
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	104,825	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	31,595	2021/3/12
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,212	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,981	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,659	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,739	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	104,360	2022/8/15
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,673	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,321	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	157,969	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	167,187	2023/12/18
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,832	2024/7/16
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	200,000	205,806	2024/12/13
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	400,000	409,280	2025/12/12
第84回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	138,000	136,578	2026/5/22
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	101,595	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	115,944	2018/4/17
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5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	127,190	2019/9/17
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37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,695	2025/9/16
第194回政府保証中小企業債券	1.5	120,000	122,940	2018/9/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	200,364	2019/2/13
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	51,541	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	104,265	2020/2/17
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	200,880	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,898	2023/12/18
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	50,959	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	114,206	2022/6/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	20,000	24,055	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	134,067	2032/5/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	43,067	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	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	130,000	180,294	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	60,000	72,801	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	121,148	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	101,826	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	368,856	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	151,374	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	103,054	2018/12/20

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	150,000	186,024	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	60,898	2030/5/10
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	59,643	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	116,639	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,254	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	104,237	2022/12/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	104,557	2023/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	121,761	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	103,949	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	61,256	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	82,772	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,162	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	109,248	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	113,231	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,173	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	121,582	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	98,476	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,177	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	94,830	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	118,879	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,446	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	104,981	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	232,480	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	101,416	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	105,873	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	348,393	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	76,843	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,521	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	58,905	2033/1/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	100,000	104,311	2022/11/28
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.678	100,000	103,665	2023/3/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	339,858	2027/8/20
F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,219	2019/4/25
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	114,837	2030/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	114,293	2031/7/30
F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	150,000	165,514	2027/3/19
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	108,325	2029/2/28
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	116,121	2025/3/21
第3回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.43	200,000	207,468	2019/9/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	97,655	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	95,256	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	102,803	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)	0.854	100,000	104,472	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	103,000	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	22,097	23,426	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	20,401	21,745	2037/11/10

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2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	23,302	24,820	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.27	20,909	22,458	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	23,108	24,708	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	17,854	18,678	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6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	22,294	23,686	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	21,673	22,972	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	18,713	19,941	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	13,854	14,243	2037/10/10
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	13,345	13,644	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	19,507	20,803	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	23,254	24,834	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	28,568	29,263	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	20,121	21,456	2037/5/10
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14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	15,468	15,969	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	26,986	27,979	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	29,483	30,632	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	30,175	31,423	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	90,729	94,065	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20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	17,990	18,943	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.92	100,000	103,133	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	19,751	20,526	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	42,988	44,857	2040/6/10
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33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	42,708	45,605	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	45,961	48,958	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	47,321	50,292	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	22,462	23,617	2040/12/10
第37回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.4	200,000	207,310	2019/9/20
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	49,850	52,588	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	21,490	22,544	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
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	23,094	24,513	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	21,255	22,706	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	60,639	64,207	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	60,278	64,362	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	53,051	56,522	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	48,497	51,891	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	152,640	163,419	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公庫債券		2.21	20,633	21,974	2042/2/10
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

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56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	64,142	67,476	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	193,410	203,658	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62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	68,148	71,044	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.13	50,000	61,051	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	68,975	71,533	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	71,602	74,304	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	67,496	70,624	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	72,677	76,447	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	97,192	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	452,606	472,783	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	34,277	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	68,267	70,836	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	145,324	150,754	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	72,331	75,052	2049/2/10
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85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	154,156	159,526	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	118,765	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	80,069	82,512	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	242,271	248,504	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	165,546	169,399	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	83,018	84,641	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	169,812	171,484	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	268,212	274,858	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	271,221	279,476	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	181,362	186,585	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.892	100,000	119,265	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441	200,000	223,658	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	471,465	484,185	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.472	100,000	111,856	2027/6/18
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	164,559	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.801	100,000	117,917	2032/9/17
第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.748	300,000	313,218	2023/12/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	57,700	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	84,335	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)	1.14	30,000	31,605	2021/12/20
第21回東日本高速道路	0.58	100,000	100,788	2018/6/20
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,538	2018/6/20
第28回東日本高速道路	0.248	100,000	100,616	2019/12/20
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	52,355	2021/9/17
第18回西日本高速道路	0.893	100,000	104,647	2023/3/20
第20回西日本高速道路	0.759	100,000	104,076	2023/9/20

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29回西日本高速道路	0.31	400,000	401,832	2026/2/12
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,431	2024/3/19
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	1.86	200,000	206,068	2018/9/20
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	0.193	100,000	100,248	2018/6/20
小 計		26,494,197	28,415,579	
金融債券				
い第773号商工債券	0.2	100,000	100,452	2019/10/25
い第775号商工債券	0.2	400,000	401,928	2019/12/27
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,411	2020/1/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	251,177	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	341,751	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,551	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,651	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,566	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,256	2020/5/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,542	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,006	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,457	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,497	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,230	2020/3/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	103,101	2018/12/20
第11号商工債券(10年)	0.66	100,000	103,272	2024/9/20
小 計		2,690,000	2,709,848	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	83,856	2019/1/29
第534回東京電力	2.055	100,000	104,726	2019/10/29
第544回東京電力	1.976	100,000	102,469	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	153,702	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,724	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,364	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	109,287	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,745	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	72,309	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,907	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	103,861	2024/5/24
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	200,000	207,442	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,011	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,002	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	101,621	2021/1/25
第381回中国電力	0.953	100,000	104,335	2024/4/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,294	2021/5/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	104,610	2023/10/25
第456回東北電力	1.176	100,000	103,611	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,476	2021/4/23
第245回四国電力	2.0	100,000	107,895	2021/6/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第371回九州電力	1.43	100,000	106,369	2022/12/22
第400回九州電力	1.777	100,000	105,055	2020/4/24
第422回九州電力	1.164	100,000	103,213	2020/6/25
第429回九州電力	0.909	100,000	103,477	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,261	2021/10/25
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,057	2020/12/25
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	400,000	412,924	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	201,850	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	83,395	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	108,964	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	112,829	2024/3/8
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,555	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,612	2021/9/17
第12回成田国際空港	0.879	100,000	104,436	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	104,021	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	102,011	2025/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	200,000	198,162	2021/6/18
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	102,676	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,572	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	302,925	2022/6/20
第21回三菱ケミカルホールディングス	0.12	100,000	99,647	2021/6/9
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9回資生堂	0.001	100,000	99,885	2019/12/17
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	300,000	299,283	2019/11/25
第12回パナソニック	0.387	300,000	302,067	2020/3/19
第15回パナソニック	0.19	300,000	299,688	2021/9/17
第30回ソニー	0.05	400,000	399,100	2019/9/20
第12回デンソー	0.01	100,000	99,395	2021/9/17
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	100,846	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,415	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,204	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	105,135	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	104,760	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	104,456	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,207	2022/3/9
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9回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.2	100,000	114,753	2026/10/30
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	108,202	2020/2/27
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	105,230	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	121,943	2031/1/20
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,081	2021/4/16
第5回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.285	200,000	200,988	2018/11/28
第6回住友信託銀行（劣後特約付）	2.78	100,000	119,586	2026/4/27
第13回住友信託銀行（劣後特約付）	2.341	100,000	115,729	2026/6/15

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25回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	200,000	230,032	2026/6/1
第5回みずほ銀行（劣後特約付）	2.49	100,000	116,465	2026/1/30
第9回みずほ銀行（劣後特約付）	2.52	100,000	118,369	2027/4/27
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	114,067	2026/9/11
第11回芙蓉総合リース	0.21	100,000	99,363	2021/5/7
第12回芙蓉総合リース	0.12	300,000	298,821	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,128	2019/6/20
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	500,000	498,030	2020/3/19
第41回日産フィナンシャルサービス	0.03	200,000	198,686	2021/9/17
第10回東京センチュリーリース	0.298	100,000	100,287	2019/11/21
第15回東京センチュリーリース	0.11	100,000	99,949	2019/4/12
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	201,082	2021/3/19
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
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	299,187	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47回日立キャピタル	0.874	100,000	102,986	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,702	2021/6/18
第56回日立キャピタル	0.197	100,000	100,018	2019/12/20
第62回日立キャピタル	0.001	300,000	299,295	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	201,886	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	200,000	200,722	2020/10/30
第34回三菱UFJリース	0.301	100,000	100,187	2020/9/3
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	100,275	2022/1/21
第38回三菱UFJリース	0.16	200,000	199,028	2021/4/21
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47回三菱UFJリース	0.001	100,000	99,865	2020/1/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	113,584	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	100,862	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,160	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,240	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	100,903	2020/6/10
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51回三井不動産	0.001	100,000	100,015	2019/12/6
第98回三菱地所	1.165	100,000	103,175	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	104,249	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	202,380	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	101,392	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,908	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	101,074	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	109,111	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,987	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	224,272	2023/9/20

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79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	104,695	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	113,211	2026/12/22
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	123,000	136,515	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,883	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	121,978	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	115,382	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	104,956	2021/12/9
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	103,720	2020/9/10
第60回日本電信電話	1.31	200,000	208,860	2020/12/18
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,657	2023/3/20
第19回KDD I	1.151	100,000	103,163	2020/6/19
第21回KDD I	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38回電源開発	0.978	100,000	104,487	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	207,786	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	210,440	2023/6/9
第25回エス・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	103,933	2020/3/19
第2回ファーストリテイリング	0.291	300,000	300,363	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	100,835	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,247	2025/12/18
第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	100,854	2018/12/13
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.55	100,000	100,477	2019/7/10
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	106,499	2020/11/20
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	100,037	2017/2/9
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,531	2019/1/17
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	300,000	301,398	2019/5/2
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	105,584	2021/1/28
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		19,373,000	20,009,260	
合 計		391,756,567	425,743,514	

日本債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日〕

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	NOMURA-BPI総合インデックスと連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合インデックスの動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主要運用対象	NOMURA-BPI総合インデックスに採用されている公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 イン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456

(注) NOMURA-BPI総合インデックスとは、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総合インデックス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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	12,572	—	361.38	—	99.4	0.3
5月末	12,620	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月末	12,613	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月末	12,649	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月末	12,670	0.8	364.20	0.8	99.3	0.4
9月末	12,707	1.1	365.24	1.1	99.0	0.1
10月末	12,755	1.5	366.65	1.5	98.9	0.1
11月末	12,754	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月末	12,832	2.1	368.88	2.1	99.4	—
2016年1月末	12,991	3.3	373.52	3.4	99.0	0.1
2月末	13,214	5.1	379.83	5.1	98.8	0.3
3月末	13,320	5.9	382.91	6.0	101.6	0.1
4月末	13,437	6.9	386.25	6.9	99.8	—
(期 末) 2016年5月12日						
	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—

(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7.2%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(7.2%)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（利回りは低下）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。

・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。

・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合インデックス）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7.2%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、高い運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	$\Delta 0.0\%$ 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、ベンチマークとの運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運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（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

・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックス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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(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、12,880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13日～2016年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 240,143,108	千円 110,760,622
	地方債証券	14,052,879	4,085,436
	特殊債券	20,627,787	5,898,067 (523,705)
	社債券	11,239,981	5,506,287 (980,000)

(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 11,739	百万円 12,952	百万円 -	百万円 -
債券先物取引				

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 286,063	百万円 84,760	% 29.6	百万円 126,250	百万円 49,856	% 39.5

(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 1,136	百万円 302	百万円 1,990

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 1,600

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12日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	380,496,000 (100,000)	430,939,878 (100,703)	81.4 (0.0)	— (—)	50.7 (—)	21.3 (0.0)	9.3 (—)
地方債証券	28,006,180 (28,006,180)	30,032,413 (30,032,413)	5.7 (5.7)	— (—)	4.0 (4.0)	1.4 (1.4)	0.2 (0.2)
特殊債券 (除く金融債)	36,130,167 (36,130,167)	39,037,654 (39,037,654)	7.4 (7.4)	— (—)	5.3 (5.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
金融債券	4,340,000 (4,340,000)	4,372,982 (4,372,982)	0.8 (0.8)	— (—)	0.0 (0.0)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)
普通社債券	21,917,000 (21,917,000)	22,919,698 (22,919,698)	4.3 (4.3)	0.2 (0.2)	1.3 (1.3)	2.1 (2.1)	0.9 (0.9)
合 計	470,889,347 (90,493,347)	527,302,626 (96,463,451)	99.6 (18.2)	0.2 (0.2)	61.3 (10.5)	27.0 (5.6)	11.4 (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	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第353回利付国債 (2年)	0.1	1,190,000	1,194,843	2017/6/15
第354回利付国債 (2年)	0.1	680,000	682,978	2017/7/15
第355回利付国債 (2年)	0.1	4,850,000	4,872,795	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	2,250,000	2,261,430	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	2,750,000	2,764,850	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	3,800,000	3,821,736	2017/11/15
第359回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,012,080	2017/12/15
第360回利付国債 (2年)	0.1	1,150,000	1,157,130	2018/1/15
第361回利付国債 (2年)	0.1	600,000	603,852	2018/2/15
第362回利付国債 (2年)	0.1	2,200,000	2,214,762	2018/3/15
第363回利付国債 (2年)	0.1	2,630,000	2,648,199	2018/4/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	240,000	241,226	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,130,000	3,149,875	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	3,120,000	3,143,493	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	1,530,000	1,539,072	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,350,000	2,365,886	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,091,296	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,427,371	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,400,000	1,419,460	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	6,040,000	6,111,272	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	1,390,000	1,408,375	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	3,670,000	3,709,856	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	4,280,000	4,330,889	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	4,970,000	5,034,013	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	2,560,000	2,595,532	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	520,000	525,595	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,690,000	2,730,403	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	2,580,000	2,610,031	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	4,310,000	4,363,961	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	6,170,000	6,251,382	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	5,430,000	5,506,345	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	4,260,000	4,322,664	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	4,460,000	4,529,397	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	4,570,000	4,644,993	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	385,000	624,543	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	620,000	976,574	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	653,000	1,037,381	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	948,000	1,518,601	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	935,000	1,449,418	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,070,000	1,635,270	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,110,000	1,629,824	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,320,000	1,809,403	2055/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	1,070,000	1,094,342	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	2,400,000	2,457,240	2017/6/20

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288回利付国債 (10年)	1.7	2,026,000	2,079,992	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	2,453,000	2,522,444	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	1,640,000	1,690,266	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	940,000	967,072	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	794,000	822,750	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	1,081,000	1,127,807	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	1,570,000	1,634,668	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	1,240,000	1,285,855	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,020,000	2,103,486	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	836,000	871,830	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	2,640,000	2,746,233	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,881,688	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	1,004,677	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	1,872,000	1,973,892	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,850,000	2,996,233	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,453,688	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,230,804	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,808,000	4,020,029	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,646,286	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,706,181	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,461,221	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,426,983	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	3,041,872	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,700,000	2,822,121	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,297,753	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,191,496	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,693,572	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	2,253,000	2,420,352	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	980,000	1,047,747	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,670,022	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	2,490,000	2,657,253	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,634,474	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	2,850,000	3,050,497	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,699,827	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,770,000	1,889,581	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,793,121	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	3,440,000	3,661,295	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,435,000	3,665,248	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,445,204	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,240,000	2,395,344	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	740,000	782,979	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,447,251	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,390,000	2,572,070	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,570,635	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,110,000	3,304,468	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第333回利付国債 (10年)	0.6	4,060,000	4,318,825	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,200,000	4,472,790	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	4,240,000	4,484,351	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,360,000	1,439,492	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	3,980,000	4,143,180	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	4,440,000	4,663,021	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	5,380,000	5,652,819	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	5,330,000	5,602,576	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	4,820,000	5,018,969	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,680,000	3,758,752	2026/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	104,404	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	130,290	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	154,486	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	179,675	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	142,701	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	229,611	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	221,729	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	181,231	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	140,505	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	215,108	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	173,261	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	293,774	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	270,716	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	686,965	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	488,818	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	427,961	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	458,454	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	591,984	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	420,809	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	495,000	707,726	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	528,094	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	570,000	817,875	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	554,000	796,319	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	411,000	592,349	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	742,000	1,043,021	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	1,064,000	1,520,211	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	910,000	1,327,635	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,191,000	1,747,852	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	1,400,000	2,037,070	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,336,000	1,925,763	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	1,228,000	1,752,380	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,509,000	2,197,677	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,834,000	2,561,786	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,626,000	2,359,374	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,769,000	2,495,032	2041/9/20

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36回利付国債 (30年)	2.0	1,809,000	2,565,035	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,827,000	2,559,517	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,425,000	1,970,703	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,200,000	1,693,860	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	970,000	1,347,960	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	1,060,000	1,445,596	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	1,010,000	1,380,447	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,270,000	1,739,722	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,250,000	1,716,162	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,130,000	1,493,035	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	1,530,000	2,025,459	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,380,000	1,867,567	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,580,000	2,054,331	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,520,000	1,977,185	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	890,000	1,007,747	2046/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	209,890	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	421,936	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	637,120	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	939,797	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	81,828	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	530,817	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,145	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	235,526	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	573,704	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	223,124	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	241,075	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	546,288	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	272,930	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	511,060	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	167,224	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	665,145	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	313,715	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	506,359	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	510,633	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	369,659	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	577,365	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	1,007,391	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	511,447	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	191,284	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	636,645	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	736,739	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	380,646	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	690,644	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	236,640	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	250,353	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78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	486,834	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	59,830	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	379,833	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	420,546	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	801,695	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	501,530	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	807,122	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	597,167	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	637,879	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	552,892	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	1,000,795	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	506,173	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	980,000	1,214,406	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	584,831	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,212,000	1,495,183	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	510,000	626,035	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	965,000	1,195,113	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	917,000	1,160,674	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	472,476	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,073,875	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	620,000	773,450	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,695,000	2,122,563	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,395,702	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	740,699	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	882,204	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	706,860	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	353,043	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	1,790,000	2,263,938	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	531,000	678,177	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	770,483	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	1,230,000	1,530,169	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	700,000	873,061	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	966,000	1,229,708	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	531,000	684,878	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,210,000	1,544,782	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,792,000	2,294,297	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,810,000	2,325,234	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	654,000	849,055	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	746,000	971,858	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,260,000	1,624,051	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	666,000	851,953	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	825,712	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	978,352	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,369,000	1,735,974	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	952,857	2030/9/20

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123回利付国債 (20年)		2.1	1,748,000	2,273,868	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	700,000	900,417	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	734,000	967,947	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	810,000	1,044,268	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	560,000	713,697	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	1,214,000	1,551,649	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	600,000	757,884	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	1,182,000	1,495,903	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	890,000	1,112,820	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	827,000	1,035,776	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	1,190,000	1,508,789	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	965,000	1,225,636	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	370,000	464,139	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	770,000	953,860	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	472,000	593,039	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	890,000	1,089,965	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	480,000	595,468	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	2,427,000	3,056,515	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	1,550,000	1,954,891	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	840,000	1,073,133	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	1,380,000	1,720,032	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	1,020,000	1,254,467	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	2,790,000	3,528,457	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	2,070,000	2,621,344	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	2,360,000	2,951,746	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	2,170,000	2,679,103	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	2,500,000	3,086,425	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	2,420,000	2,946,979	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	2,620,000	3,098,097	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	2,920,000	3,453,367	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	2,400,000	2,885,568	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	2,290,000	2,708,978	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	2,530,000	2,895,306	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	1,510,000	1,552,808	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,703	2018/11/15
小	計		380,496,000	430,939,878	
地方債証券					
第1回東京都公募公債 (20年)		1.54	20,000	22,141	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	10,000	14,225	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)		2.23	80,000	109,130	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)		2.01	100,000	123,399	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)		2.09	80,000	100,457	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)		2.19	80,000	101,831	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)		1.92	120,000	149,548	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)		1.98	70,000	88,857	2031/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	122,170	2033/3/18
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	156,177	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	52,511	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	104,916	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,319	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,349	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	104,369	2020/6/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,165	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,670	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	126,288	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	180,438	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	104,731	2022/6/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	105,018	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	104,217	2023/3/20
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	104,012	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	250,000	264,480	2023/3/20
第723回東京都公募公債	0.76	200,000	210,802	2023/9/20
第728回東京都公募公債	0.65	300,000	314,115	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	105,089	2024/3/19
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	114,084	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,435	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	102,857	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,059	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	104,893	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,897	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,939	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,506	2022/10/31
平成24年度第13回北海道公募公債 (5年)	0.23	100,000	100,318	2018/1/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	206,354	2024/12/26
第1回神奈川県公募公債 (20年)	2.55	100,000	120,230	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	80,000	94,514	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	80,000	116,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債 (20年)	2.11	100,000	118,721	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	119,313	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	113,100	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	147,450	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	118,902	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,210	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	252,619	2020/3/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	105,374	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,261	2020/9/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,876	2022/6/20
第192回神奈川県公募公債	0.805	200,000	209,782	2022/9/20
第5回大阪府公募公債 (20年)	2.16	100,000	126,762	2030/5/28
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	200,000	246,444	2033/9/27

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89回大阪府公募公債 (5年)	0.2	100,000	100,219	2017/12/27
第92回大阪府公募公債 (5年)	0.14	100,000	100,131	2018/3/28
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,727	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,120	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,063	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	103,951	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,184	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,482	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,606	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,386	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,561	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,897	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,688	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,605	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,761	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,844	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,948	2022/3/29
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	163,112	2022/11/29
第386回大阪府公募公債	0.585	100,000	104,249	2024/7/30
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,915	2024/10/30
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,950	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,176	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	147,919	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	244,844	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	104,352	2023/3/22
平成25年度第1回京都府公募公債	0.58	100,000	103,752	2023/4/28
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	110,713	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	55,785	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	113,124	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	111,085	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	122,916	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,984	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	125,515	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	198,975	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	105,176	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,009	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	104,035	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	103,788	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,427	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,604	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	107,458	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,831	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,429	2020/8/25
平成23年度第6回静岡県公募公債	1.201	170,000	180,285	2021/7/23
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	104,442	2023/3/22

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25年度第1回静岡県公募公債		0.581	100,000	103,782	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債		0.926	100,000	106,325	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	100,000	104,897	2023/10/24
平成25年度第9回静岡県公募公債		0.679	300,000	314,514	2023/11/22
平成25年度第11回静岡県公募公債	(5年)	0.204	100,000	100,557	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債		0.61	100,000	104,574	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債		0.544	121,000	126,367	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債		1.11	100,000	105,595	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債		1.019	100,000	105,289	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債		1.006	100,000	105,381	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債		0.996	100,000	105,489	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	104,819	2022/11/30
平成25年度第2回愛知県公募公債		0.576	200,000	207,514	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債		0.849	240,000	253,852	2023/7/25
平成25年度第15回愛知県公募公債		0.699	600,000	629,394	2023/10/25
平成26年度第9回愛知県公募公債		0.576	100,000	104,385	2024/8/26
平成19年度第2回広島県公募公債		1.94	46,050	47,202	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債		1.73	60,000	62,601	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債		1.33	26,650	28,340	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債		1.19	100,000	105,867	2021/5/27
平成25年度第3回広島県公募公債		0.8	100,000	105,589	2023/9/25
平成19年度第3回埼玉県公募公債		1.94	39,100	40,081	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債		1.63	100,000	102,786	2018/1/30
平成21年度第8回埼玉県公募公債		1.3	100,000	104,633	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	106,688	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債		1.2	100,000	106,057	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債		0.801	100,000	104,938	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	150,000	156,303	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	102,491	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債	(30年)	2.62	70,000	100,073	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債	(30年)	2.28	80,000	109,944	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債		1.44	100,000	105,464	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債		1.11	100,000	104,734	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債		0.94	20,000	20,825	2020/10/28
平成24年度第11回福岡県公募公債		0.8	550,000	578,946	2023/2/27
平成25年度第11回福岡県公募公債		0.694	300,000	315,363	2024/2/26
第9回千葉県公募公債(20年)		1.84	80,000	98,802	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債		1.8	90,000	93,280	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債		1.78	80,000	83,119	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債		1.6	80,000	83,026	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債		0.92	120,000	124,717	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債		1.26	80,000	84,612	2021/1/25
平成23年度第6回千葉県公募公債		1.11	200,000	212,056	2021/12/24
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	21,130	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	21,206	2022/4/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	105,057	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,621	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	195,057	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,053	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	125,530	2021/11/30
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	105,214	2022/10/31
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,568	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	103,619	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,533	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	207,950	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	103,856	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	93,321	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	104,726	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	105,084	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,500	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,401	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	114,673	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,434	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,974	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	106,124	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,385	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	105,281	2021/10/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	211,058	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	211,334	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	180,305	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	105,149	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	104,648	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	105,024	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	262,565	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,554	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	210,776	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,663	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,459	2023/3/24
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	314,214	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	242,721	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	209,724	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	400,000	420,408	2024/4/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	210,018	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	104,624	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	400,000	417,364	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	300,000	312,732	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	300,000	311,736	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,324	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	103,752	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	103,218	2025/4/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	209,040	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	313,971	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	313,041	2025/9/25
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	102,753	2017/12/19
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,483	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,959	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,343	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	64,376	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	232,506	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	127,775	2028/9/21
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	30,622	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	131,766	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,519	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	104,529	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	108,957	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	120,310	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	101,690	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	105,561	2021/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	61,661	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	105,299	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,861	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	148,916	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	101,530	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	239,212	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	99,007	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	104,222	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	100,220	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	105,209	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	104,509	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	123,821	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	73,401	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,075	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	111,830	2040/9/20
第44回川崎市公募公債(5年)	0.162	130,400	131,131	2020/6/19
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,070	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	121,211	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債	1.52	100,000	103,166	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	94,502	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	113,040	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	105,261	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.25	34,700	34,796	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.25	42,500	42,645	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,731	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	52,378	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.371	100,000	118,430	2034/9/20

銘柄	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25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	105,210	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	105,085	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	103,826	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,089	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,787	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	140,660	147,602	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,988	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,586	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	104,495	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	103,831	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,691	2018/12/25
小 計			28,006,180	30,032,413	
特殊債券(除く金融債)					
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	200,000	204,682	2017/7/31
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	106,000	108,832	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	102,590	2018/1/31
第54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	102,616	2018/3/23
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	103,476	2018/5/30
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	34,000	35,280	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	206,000	213,535	2018/8/29
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	224,000	231,945	2018/9/28
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	50,000	51,963	2018/10/31
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	115,000	119,656	2018/11/28
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	159,000	164,736	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	141,000	146,187	2019/3/19
第80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	209,120	2019/5/31
第81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	250,406	2029/5/31
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	210,000	219,819	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	79,000	82,464	2019/9/30
第90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	125,662	2029/9/28
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	100,000	125,749	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	139,000	144,989	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	210,000	220,096	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	142,066	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	50,000	52,494	2020/3/19
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	126,997	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	200,000	210,680	2020/6/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,342	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	116,538	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	71,000	74,912	2020/12/28
第127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	126,565	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	96,051	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	60,000	63,432	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	128,503	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	105,464	2021/10/29

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148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	249,240	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	143,553	2021/11/30
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	112,000	117,816	2022/2/28
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	370,000	389,425	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.977	100,000	105,770	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	124,167	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	268,736	2042/5/30
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	12,000	12,658	2022/6/30
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.839	300,000	315,585	2022/7/29
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	350,000	367,808	2022/10/31
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.805	100,000	105,275	2022/11/30
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	222,000	232,802	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	211,194	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	104,576	2023/3/17
第188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	119,209	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	158,765	2023/4/28
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	474,000	494,026	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	106,292	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	121,000	128,913	2023/7/31
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	398,000	422,126	2023/8/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	228,000	239,431	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	188,000	197,864	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	322,000	338,093	2024/3/29
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	105,148	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	104,852	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	119,327	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	100,000	104,477	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	241,000	250,478	2024/12/27
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	106,646	2020/7/15
第4回政府保証首都高速道路債券		1.7	179,000	183,226	2017/9/25
第7回政府保証東日本高速道路債券		1.9	34,000	34,838	2017/8/24
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	29,085	2018/10/19
第17回政府保証中日本高速道路債券		1.7	100,000	102,315	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券		1.4	10,000	10,257	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	90,000	93,139	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	280,000	292,913	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	25,000	26,104	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	209,750	2019/8/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.4	200,000	201,394	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券(15年)		2.0	100,000	111,858	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	200,000	206,932	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	113,551	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.25	300,000	301,743	2018/10/29
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	104,062	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.5	148,000	154,689	2019/5/24

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9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.32	100,000	100,906	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,965	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	200,000	210,410	2020/5/22
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	104,298	2020/9/14
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	105,069	2020/11/17
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	15,000	15,939	2021/3/12
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	106,125	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,141	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	53,075	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	105,511	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	105,012	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	354,000	373,516	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,777	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	345,000	357,965	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,526	2023/5/16
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	168,000	178,914	2023/7/14
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	159,033	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	168,364	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	200,000	210,030	2024/3/15
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	104,828	2024/7/16
第63回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.556	200,000	209,014	2024/8/16
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	104,380	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,589	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	117,073	2018/4/17
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	110,341	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	128,334	2019/9/17
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	134,000	140,488	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	105,526	2023/2/24
第26回政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	484,000	515,503	2023/7/19
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	215,884	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	197,000	207,173	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,048	2017/12/18
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	202,000	214,833	2023/6/27
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	52,031	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,252	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	179,000	188,556	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,222	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	21,045	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	200,988	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	154,871	2018/1/24
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	31,821	2017/11/28
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	51,558	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,309	2022/6/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	20,000	24,525	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	140,278	2032/5/20

銘柄	利 率	当 期 末		
		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13回道路債券(財投機関債)	2.28	200,000	228,644	2022/9/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	47,873	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	156,430	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	130,000	200,379	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	60,000	74,791	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	204,994	2017/9/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	124,568	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	102,956	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	379,848	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	154,186	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	104,169	2018/12/20
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	150,000	191,812	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	62,980	2030/5/10
第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.17	100,000	105,862	2021/6/18
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.14	100,000	105,709	2021/6/18
第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.08	100,000	105,907	2021/12/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	62,296	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	121,765	2032/6/18
第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.834	110,000	115,425	2022/6/20
第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.796	300,000	314,700	2022/9/20
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,972	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	104,952	2022/12/20
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	300,000	319,131	2023/6/20
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.85	200,000	211,478	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	105,416	2023/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	140,439	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	105,090	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	63,094	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	83,538	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,363	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	111,897	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	114,961	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	59,351	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	125,913	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	102,351	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,938	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	98,595	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	123,616	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,852	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,846	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	243,238	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,159	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,877	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	364,578	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	77,872	2023/3/17

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27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	105,334	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	61,772	2033/1/28
第28回公営企業債券(財投機関債)	1.89	100,000	102,734	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	200,000	211,680	2022/4/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	100,000	105,039	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	210,198	2023/1/27
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.678	100,000	104,417	2023/3/28
第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.887	200,000	212,040	2023/6/28
第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.922	300,000	319,026	2023/7/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	348,126	2027/8/20
F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,590	2019/4/25
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	118,194	2030/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	118,743	2031/7/30
F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	150,000	168,373	2027/3/19
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	110,914	2029/2/28
第10回首都高速道路	0.336	400,000	401,884	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,681	2019/9/20
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	118,254	2025/3/21
第14回阪神高速道路	0.1	300,000	300,375	2019/12/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	100,969	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	98,762	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	103,996	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)	0.854	100,000	105,269	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	104,184	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	26,476	28,389	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	22,792	24,547	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	28,211	30,404	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	23,341	25,355	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	27,832	30,105	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	19,935	21,068	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	20,909	22,542	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	27,579	29,673	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	24,467	26,167	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	20,973	22,595	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	15,357	15,883	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	28,382	30,398	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	70,000	71,650	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	14,945	15,377	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	21,625	23,302	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	26,057	28,002	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	31,898	32,856	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	22,330	24,061	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	31,322	33,746	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	17,578	18,292	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	31,268	32,657	2032/5/10

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16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	33,743	35,326	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	34,640	36,368	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	103,716	108,350	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	19,211	20,124	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	20,163	21,359	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.92	100,000	104,468	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	24,293	25,519	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	53,618	56,605	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	29,093	30,730	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	49,627	53,407	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	54,543	58,581	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	56,528	60,561	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	27,506	29,274	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	59,344	63,107	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,062	27,656	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	69,098	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	28,071	30,162	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,132	28,331	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	71,444	76,374	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	71,660	77,275	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	66,485	71,562	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	63,447	68,618	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	192,858	208,768	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	69,136	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	68,668	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	25,898	28,036	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,882	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,754	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	77,763	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	76,026	80,855	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	229,284	244,065	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	81,909	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	82,101	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	78,949	83,290	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	50,000	63,146	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	79,408	83,325	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	81,224	85,318	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	81,265	85,946	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	84,702	90,108	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	101,050	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	240,858	254,290	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	34,833	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	83,286	87,347	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	172,376	180,820	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	85,891	90,232	2049/2/10

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83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	87,869	92,178	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	185,105	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	179,296	187,957	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	123,667	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	92,290	96,385	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	277,212	288,250	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	187,136	194,220	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	93,706	96,615	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	188,382	192,366	2050/2/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	289,818	302,445	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	193,764	201,933	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	124,488	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	226,976	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	490,020	510,850	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.472	100,000	114,067	2027/6/18
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	179,354	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	123,405	2032/9/17
第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.748	300,000	315,747	2023/12/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	58,697	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	88,039	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,855	2021/12/20
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,546	2017/9/20
第21回東日本高速道路		0.58	100,000	101,180	2018/6/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,803	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,767	2019/12/20
第3回中日本高速道路		1.92	300,000	307,779	2017/9/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	100,818	2017/9/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	52,829	2021/9/17
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	105,358	2022/3/18
第43回中日本高速道路		0.362	100,000	100,521	2017/9/20
第45回中日本高速道路		0.904	300,000	316,758	2022/9/20
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	200,950	2017/9/20
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	101,590	2021/12/20
第18回西日本高速道路		0.893	100,000	105,873	2023/3/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	105,239	2023/9/20
第21回西日本高速道路		0.754	400,000	421,180	2023/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	104,909	2024/3/19
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.86	200,000	208,652	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.026	100,000	105,348	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.193	100,000	100,365	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	102,579	2017/9/20
小	計		36,130,167	39,037,654	
金融債券					
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,388	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,562	2019/10/25

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	
い第775号商工債券	0.2	400,000	402,248	2019/12/27
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,471	2020/1/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,742	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	400,000	403,372	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	251,562	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	342,227	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,698	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,811	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,659	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,796	2020/5/27
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,388	2017/6/27
第279回信金中金債	0.25	300,000	301,293	2018/2/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,748	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,346	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,586	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,640	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,466	2020/3/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	104,221	2018/12/20
第11号商工債券(10年)	0.66	100,000	104,338	2024/9/20
第179号商工債券(3年)	0.14	300,000	300,657	2017/12/27
第184号商工債券(3年)	0.15	300,000	300,762	2018/5/25
小 計		4,340,000	4,372,982	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,946	2019/1/29
第532回東京電力	1.75	120,000	122,343	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	105,307	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	102,283	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	103,434	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	154,881	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,788	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,512	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	108,825	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,730	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	73,003	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	53,392	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	104,921	2024/5/24
第448回関西電力	2.16	100,000	104,233	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	102,331	2017/7/25
第472回関西電力	1.79	100,000	104,096	2018/11/22
第473回関西電力	1.665	100,000	104,322	2019/4/25
第478回関西電力	1.448	200,000	209,038	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,733	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,595	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	102,153	2021/1/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,759	2021/5/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第288回北陸電力	1.89	100,000	102,720	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	102,040	2019/6/25
第448回東北電力	1.608	100,000	104,523	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	104,320	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,846	2021/4/23
第245回四国電力	2.0	100,000	109,374	2021/6/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,090	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	104,662	2019/6/25
第422回九州電力	1.164	100,000	103,770	2020/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,644	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	104,039	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,369	2021/10/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	24,981	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,379	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,334	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,854	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	202,100	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,532	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	110,709	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	115,310	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	400,000	421,824	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	53,043	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	169,137	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	106,007	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	105,427	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	105,164	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	103,325	2025/2/20
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	104,029	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,973	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	307,149	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	105,160	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,453	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,541	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,474	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	300,000	303,033	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金	1.12	400,000	404,592	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,584	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	101,082	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,811	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	106,558	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,935	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,897	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,825	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行(同順位特約付)	2.08	100,000	102,493	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.5	300,000	321,141	2019/6/3

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8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	107,406	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.2	100,000	117,435	2026/10/30
第10回みずほコーポレート銀行	1.945	400,000	411,264	2017/10/27
第30回みずほコーポレート銀行	0.34	100,000	100,383	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行	0.33	200,000	200,910	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行	0.27	800,000	803,312	2018/1/24
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	600,000	604,272	2018/4/20
第7回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.11	400,000	428,364	2019/12/20
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	110,062	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.16	100,000	102,523	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.56	100,000	106,455	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.46	100,000	127,012	2031/1/20
第93回三菱東京UFJ銀行	1.985	200,000	205,632	2017/10/17
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	107,020	2021/4/16
第6回りそな銀行 (劣後特約付)	2.084	400,000	428,204	2020/3/4
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.345	100,000	100,352	2017/6/7
第2回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.26	100,000	100,391	2017/12/20
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.285	200,000	201,270	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.78	100,000	122,963	2026/4/27
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.341	100,000	118,768	2026/6/15
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,439	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	105,443	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	106,536	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	236,008	2026/6/1
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,790	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	119,382	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	121,555	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	116,686	2026/9/11
第8回芙蓉総合リース	0.318	100,000	100,702	2019/7/30
第11回芙蓉総合リース	0.21	100,000	99,990	2021/5/7
第4回興銀リース	0.36	100,000	100,788	2019/5/23
第5回興銀リース	0.272	100,000	100,581	2019/12/5
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,446	2019/6/20
第10回東京センチュリーリース	0.298	100,000	100,666	2019/11/21
第15回東京センチュリーリース	0.11	100,000	100,031	2019/4/12
第29回ホンダファイナンス	0.428	100,000	101,280	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス	0.203	100,000	100,496	2019/12/20
第69回トヨタファイナンス	0.02	200,000	199,982	2019/4/26
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	104,591	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	203,656	2021/6/18
第56回日立キャピタル	0.197	100,000	100,390	2019/12/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	203,426	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	200,000	201,674	2020/10/30
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	100,979	2022/1/21
第37回三菱UFJリース	0.07	100,000	99,959	2019/2/21

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38回三菱UFJリース	0.16	200,000	200,128	2021/4/21
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	115,205	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,372	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,874	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,317	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	101,192	2020/6/10
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	103,754	2018/6/20
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,297	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,998	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	204,178	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	103,301	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,306	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	102,948	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	111,052	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	107,436	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	228,408	2023/9/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	104,469	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	104,632	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,774	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	115,017	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	133,127	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	139,051	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	121,166	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	125,840	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	126,488	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	106,203	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	105,391	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	105,008	2020/9/10
第59回日本電信電話	1.69	100,000	105,119	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	104,271	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,368	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	104,026	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,831	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,645	2019/11/20
第38回電源開発	0.978	100,000	105,160	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	209,240	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	213,162	2023/6/9
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,519	2020/3/19
第2回ファーストリテイリング	0.291	100,000	101,003	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	102,191	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,191	2025/12/18
第5回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	101,548	2018/12/13
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	108,615	2020/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,148	2016/9/20
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	100,894	2017/2/9

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8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,801	2017/1/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,814	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,445	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	300,000	302,295	2019/5/2
第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	100,220	2016/8/12
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	107,163	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,971	2017/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,164	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,048	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,559	2020/5/22
小 計		21,917,000	22,919,698	
合 計		470,889,347	527,302,626	

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 527,302,626	% 99.2
コール・ローン等、その他	4,274,375	0.8
投資信託財産総額	531,577,001	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	531,577,001,301	
コール・ローン等	2,989,676,014	
公社債(評価額)	527,302,626,956	
未収利息	1,167,439,286	
前払費用	117,259,045	
(B) 負債	2,120,379,248	
未払金	1,319,510,540	
未払解約金	800,861,372	
未払利息	6,070	
その他未払費用	1,266	
(C) 純資産総額(A-B)	529,456,622,053	
元本	392,963,515,092	
次期繰越損益金	136,493,106,961	
(D) 受益権総口数	392,963,515.092口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,473円	

<注記事項>

- ①期首元本額 273,489,284,775円
 期中追加設定元本額 230,928,667,279円
 期中一部解約元本額 111,454,436,962円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,473円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	4,626,521,224	
受取利息	4,626,717,898	
その他収益金	11,000	
支払利息	△ 207,674	
(B) 有価証券売買損益	27,196,907,264	
売買益	27,869,990,260	
売買損	△ 673,082,996	
(C) 先物取引等取引損益	40,030,720	
取引益	42,200,160	
取引損	△ 2,169,440	
(D) 保管費用等	△ 1,266	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	31,863,457,942	
(F) 前期繰越損益金	70,345,224,180	
(G) 追加信託差損益金	66,710,614,776	
(H) 解約差損益金	△ 32,426,189,937	
(I) 計(E+F+G+H)	136,493,106,961	
次期繰越損益金(I)	136,493,106,961	

- (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。

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）	
ファンド・マネジャー（国内債券）	24,560,538,321円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,932,463,018円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,513,899,345円
eMAXIS バランス（波乗り型）	318,764,587円
コアバランス	2,495,021円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	24,663,146,879円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	28,138,690,875円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	227,589,648円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	29,184,652,524円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,740,056,498円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,087,892,777円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	6,373,056,468円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	199,687,055,080円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	6,632,302,396円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	2,642,591,636円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,901,143,295円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	552,810,923円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	174,759,098円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,411,642,373円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,201,886,464円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	35,492,792円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	58,782,800円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	90,216,225円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	118,748,080円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	73,430,230円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	23,134,363円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	267,175,876円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	641,170,860円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	261,546,394円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	645,178,699円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,887,689,697円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,614,469,539円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,107,456,915円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,646,858,018円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	907,309,775円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,129,391,967円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	617,588,982円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	713,503,002円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	406,651,573円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	420,126円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	272,141円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	191,413円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	49,079,772円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	22,122,406円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールデンキーパー）	5,351,778円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	16,871,400円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	3,342,258円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	2,016,780円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	54,241円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,670,099,620円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	466,044円
合計	392,963,515,092円

【お 知 ら せ】

- ①2015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)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、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うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2017年1月26日

[計算期間：2016年1月27日～2017年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第8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8期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2013年1月28日)	11,375	4.5	343.56	4.6	103.8	—	22,835
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△ 0.8	378.81	△ 0.8	96.9	—	92,179

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）とは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (<small>係(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	%			
(期 首) 2016年1月26日	12,613	—	381.71	—	95.6	—	—
1月末	12,655	0.3	382.97	0.3	98.1	—	—
2月末	12,795	1.4	387.13	1.4	92.4	—	—
3月末	12,830	1.7	388.21	1.7	107.4	—	—
4月末	12,736	1.0	385.50	1.0	96.1	—	—
5月末	12,820	1.6	388.38	1.7	99.6	—	—
6月末	13,114	4.0	396.92	4.0	91.2	—	—
7月末	13,170	4.4	398.69	4.4	99.9	—	—
8月末	13,197	4.6	399.55	4.7	98.3	—	—
9月末	13,176	4.5	398.82	4.5	96.9	—	—
10月末	12,894	2.2	390.37	2.3	100.9	—	—
11月末	12,650	0.3	382.83	0.3	103.3	—	—
12月末	12,654	0.3	383.04	0.3	101.0	—	—
(期 末) 2017年1月26日	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.8%)と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

◎外国債券市況

- ・世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.8%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.0$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト 等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.1\%$ 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。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は0.1%程度でした。

- ・為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、12,890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

(2016年1月27日～2017年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 279,435	千アメリカドル 120,266
	カナダ	千カナダドル 17,490	千カナダドル 6,868
	メキシコ	千メキシコペソ 99,071	千メキシコペソ 38,380
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 40,312	17,258
	イタリア	国債証券 50,523	18,223
	フランス	国債証券 53,619	19,926
	オランダ	国債証券 11,808	5,021
	スペイン	国債証券 30,025	12,180
	ベルギー	国債証券 13,012	4,852
	オーストリア	国債証券 7,420	2,579
	フィンランド	国債証券 3,449	1,488
	アイルランド	国債証券 3,540	998
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 32,091	千イギリスポンド 13,508
スイス	国債証券 千スイスフラン 1,124	千スイスフラン 446	
国	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 22,854	千スウェーデンクローネ 8,388
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 12,841	千ノルウェークローネ 5,278
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 25,466	千デンマーククローネ 8,974
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 15,461	千ポーランドズロチ 5,272
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 16,817	千オーストラリアドル 5,369
	シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 5,380	千シンガポールドル 2,233
	南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 38,085	千南アフリカランド 11,938

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	983,021	474,947	48.3	1,020,009	511,226	50.1
為替直物取引	57,076	39,514	69.2	20,030	10,168	50.8

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 348,590	千アメリカドル 349,914	千円 39,592,791	% 43.0	% —	% 17.5	% 16.9	% 8.6
カナダ	千カナダドル 20,640	千カナダドル 22,414	1,942,427	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 125,700	千メキシコペソ 126,598	679,832	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	45,850	54,088	6,585,842	7.1	—	3.9	2.3	0.9
イタリア	61,520	70,105	8,535,986	9.3	—	5.5	3.1	0.7
フランス	61,350	71,986	8,765,105	9.5	—	5.9	2.7	0.9
オランダ	14,650	17,187	2,092,732	2.3	—	1.3	0.5	0.4
スペイン	34,660	40,530	4,934,985	5.4	—	3.3	1.6	0.5
ベルギー	15,210	18,331	2,232,030	2.4	—	1.8	0.4	0.2
オーストリア	9,490	11,268	1,372,087	1.5	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	4,000	4,490	546,721	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	4,950	5,671	690,600	0.7	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 36,550	千イギリスポンド 45,180	6,460,380	7.0	—	5.0	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 1,550	千スイスフラン 1,842	208,924	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 28,300	千スウェーデンクローネ 32,542	418,172	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 17,080	千ノルウェークローネ 18,230	248,663	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 28,100	千デンマーククローネ 35,298	577,843	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 19,210	千ポーランドズロチ 19,546	546,918	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 20,610	千オーストラリアドル 22,190	1,903,293	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,410	千シンガポールドル 6,637	532,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 62,100	千南アフリカランド 57,568	492,212	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	89,359,623	96.9	—	50.5	32.6	13.9

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,390	270,435	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	2,500	2,486	281,339	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,300	1,298	146,962	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	1,500	1,498	169,559	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,100	2,096	237,243	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,996	225,849	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	600	598	67,728	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	300	299	33,858	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	700	696	78,843	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	400	397	44,936	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,781	201,561	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,083	122,563	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	3,700	3,640	411,868	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	500	500	56,603	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	3,400	3,395	384,153	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	101,608	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,200	2,189	247,792	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,088	123,137	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	494	55,931	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	55,854	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,675	189,612	2019/9/15
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	113,309	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,700	2,702	305,803	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	3,800	3,800	430,053	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	135,780	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	1,700	1,698	192,152	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,896	214,573	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,200	1,192	134,947	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	396	44,871	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,000	1,978	223,886	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,483	167,802	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,282	145,118	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,203	249,328	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,000	1,995	225,831	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,293	146,342	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,780	201,434	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,200	2,167	245,196	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,011	340,790	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,126	240,645	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,800	2,702	305,805	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,700	305,558	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,200	1,155	130,741	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,600	1,602	181,308	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,400	3,404	385,205	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	400	45,307	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	147,204	2018/12/15

銘柄		当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,800	1,800	203,677	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,000	1,996	225,919	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	298	33,768	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	892	100,967	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	500	495	56,062	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,658	187,621	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	700	656	74,304	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	603	68,232	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	803	90,965	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	1,800	1,807	204,529	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	2,400	2,407	272,419	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	4,300	4,313	488,122	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	501	56,692	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	400	398	45,061	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,590	179,979	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	893	101,150	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,100	1,091	123,502	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,800	1,784	201,903	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,284	145,336	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	986	111,673	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,100	2,070	234,254	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	5,700	5,599	633,617	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,546	288,099	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,445	276,753	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,900	1,798	203,530	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,888	213,676	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	800	754	85,407	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,700	2,717	307,509	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	703	79,631	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	600	603	68,229	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	400	401	45,475	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	401	45,442	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	802	90,827	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,900	3,903	441,733	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	2,000	226,379	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,393	157,655	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	780	88,313	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,700	1,630	184,450	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,100	2,010	227,479	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	3,000	2,739	309,986	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,409	159,486	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,012	227,767	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,200	1,207	136,586	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,608	182,015	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,513	284,355	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,605	181,619	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,497	169,459	2020/6/30

銘柄		当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,600	2,593	293,477	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,490	168,703	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	400	389	44,071	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,200	3,105	351,330	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	4,700	4,529	512,527	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,406	272,289	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,200	4,827	546,274	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,600	2,408	272,516	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	303	34,293	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	1,500	1,512	171,104	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,100	3,099	350,682	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,696	191,949	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	690	78,122	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,000	985	111,470	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,476	167,020	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,180	133,547	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,369	154,957	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	500	487	55,107	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,455	164,726	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,006	113,910	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	696	78,771	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,700	2,671	302,330	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,675	189,634	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,100	1,082	122,461	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,500	1,516	171,554	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,200	2,220	251,263	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,209	136,851	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,100	2,112	239,044	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,506	170,441	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,001	113,370	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,100	124,533	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,900	328,237	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,600	1,598	180,849	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	4,000	3,975	449,877	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	197	22,400	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,272	257,113	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,400	2,321	262,691	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,400	3,274	370,463	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,432	162,047	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,013	114,679	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	707	80,089	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,300	1,311	148,416	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,000	1,007	114,011	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,006	113,927	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,500	1,509	170,759	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,100	1,101	124,610	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,977	223,736	2023/11/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,200	3,118	352,886	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	1,250	1,039	117,647	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	600	610	69,101	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,827	206,836	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	913	103,362	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	709	80,275	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,000	3,952	447,190	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,400	3,333	377,166	2025/11/15
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	2,300	2,342	265,012	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	917	103,764	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	715	80,931	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	3,300	3,298	373,190	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	100	88	9,998	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	1,600	1,408	159,400	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	1,400	1,232	139,437	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,500	1,519	171,952	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,700	2,727	308,631	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	200	203	23,031	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	500	510	57,766	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,444	163,434	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	2,900	2,991	338,440	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,300	1,220	138,085	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,500	1,406	159,103	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	200	203	23,081	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	500	514	58,243	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	2,200	2,261	255,853	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,300	3,391	383,721	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,300	2,205	249,591	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	3,100	2,956	334,514	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	100	95	10,806	2046/11/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,900	1,943	219,855	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	7,000	6,896	780,354	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	1,200	1,176	133,096	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	3,600	3,521	398,493	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,450	2,394	270,936	2045/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	4,800	4,837	547,320	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	3,050	3,065	346,859	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	300	301	34,109	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	717	81,236	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,366	154,564	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,600	1,684	190,601	2044/5/15	
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,115	126,174	2019/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	400	433	49,046	2039/2/15	
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	970	996	112,756	2018/2/15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,166	131,937	2020/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,350	1,483	167,896	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,500	1,648	186,538	2044/2/15	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	759	85,977	2019/8/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,730	195,803	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,000	3,211	363,423	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,119	126,621	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,799	203,599	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,500	2,614	295,814	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	103,206	2040/8/15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,130	1,172	132,639	2018/5/15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	700	79,296	2018/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	600	722	81,722	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	963	109,062	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	611	69,242	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	796	90,107	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	900	1,105	125,105	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,128	127,651	2036/2/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	622	70,457	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,140	128,996	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	300	388	43,913	2041/2/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,138	128,876	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	200	254	28,745	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	500	661	74,842	2031/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	300	385	43,655	2028/8/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	1,220	1,568	177,428	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	390	519	58,837	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,560	1,943	219,939	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	188	21,322	2026/11/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	500	637	72,186	2021/11/15	
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	187	21,161	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,113	239,136	2020/8/15	
小 計					39,592,791		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	894	77,559	2018/5/1	
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	900	896	77,696	2018/8/1	
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	550	547	47,426	2018/11/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	500	494	42,862	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	700	689	59,755	2021/3/1	
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	350	343	29,766	2021/9/1	
	1 CAN GOVT 270601	1.0	450	411	35,619	2027/6/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	900	905	78,475	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	805	69,776	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	352	30,554	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	400	406	35,194	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	760	762	66,066	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	750	729	63,210	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	700	713	61,837	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,000	1,022	88,582	2019/9/1	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	650	676	58,620	2025/6/1	
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	750	796	69,011	2024/6/1	
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	980	1,053	91,272	2022/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	500	533	46,194	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	218	18,899	2064/12/1	
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,250	1,361	117,945	2021/6/1	
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	950	1,026	88,989	2020/6/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	900	1,088	94,325	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	1,024	88,803	2019/6/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,085	94,047	2041/6/1	
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	600	628	54,444	2018/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	650	917	79,497	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	440	613	53,181	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	710	1,040	90,191	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	240	376	32,618	2027/6/1	
小計					1,942,427		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	13,600	15,604	83,796	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,400	4,046	21,729	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,500	10,225	54,911	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	13,400	12,712	68,265	2019/12/11	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,900	4,304	23,113	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,100	14,672	78,791	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,100	5,871	31,529	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,028	27,002	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,700	7,554	40,565	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,100	4,952	26,593	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,500	8,221	44,150	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,200	6,366	34,189	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,200	5,345	28,703	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,100	11,426	61,362	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,700	4,945	26,557	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	5,100	5,320	28,571	2038/11/18	
小計					679,832		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	900	866	105,555	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,100	1,121	136,573	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	800	815	99,300	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	500	509	61,977	2021/10/8
		0 SCHATS 180316	—	1,800	1,813	220,846	2018/3/16
		0 SCHATS 180615	—	200	201	24,581	2018/6/15
		0.25 OBL 180413	0.25	800	809	98,524	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	717	87,343	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	900	926	112,824	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	800	823	100,277	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
		0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,113	135,633	2018/2/23

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 OBL 190412	0.5	500	513	62,490	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	500	535	65,235	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,650	1,760	214,348	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	500	514	62,625	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	900	989	120,442	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	661	80,535	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,000	1,104	134,458	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	443	53,986	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,500	1,665	202,840	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,013	123,382	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,100	1,227	149,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	1,025	124,838	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	771	93,983	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,679	204,534	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,000	1,306	159,096	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,050	1,382	168,298	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,000	1,124	136,892	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,100	1,226	149,380	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,515	184,559	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,170	142,486	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,330	2,569	312,844	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,190	1,293	157,436	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	700	730	89,003	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,300	2,014	245,326	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	664	80,883	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	590	967	117,836	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	350	513	62,500	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,050	1,712	208,528	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	810	1,427	173,829	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	800	1,310	159,519	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	650	1,005	122,480	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	980	1,408	171,475	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	750	1,274	155,203	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	630	1,020	124,288	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	500	500	60,972	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	400	402	48,969	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	800	805	98,068	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	800	796	97,038	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	700	708	86,278	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	286	34,892	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	406	49,455	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	987	120,254	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	513	62,472	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	750	694	84,526	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,000	1,022	124,515	2022/4/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	512	62,351	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	126,043	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	975	118,734	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	964	117,424	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,050	943	114,892	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,000	1,003	122,209	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,387	168,939	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	400	370	45,101	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,700	1,793	218,397	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	800	846	103,095	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	650	583	71,105	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	300	250	30,440	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	550	552	67,308	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	900	944	115,012	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,000	1,066	129,833	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,565	190,649	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,814	220,902	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,450	1,645	200,404	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,530	1,744	212,376	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,950	2,240	272,792	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,800	2,037	248,074	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,400	1,642	200,042	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,500	1,629	198,393	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	1,400	1,549	188,711	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,271	154,764	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	838	102,095	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,410	1,508	183,733	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,100	1,203	146,508	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,807	220,035	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,700	2,034	247,737	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,400	1,682	204,819	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	963	117,328	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,422	173,234	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,230	1,498	182,440	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	800	996	121,283	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,000	1,279	155,802	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	969	118,105	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,300	1,710	208,245	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,150	1,519	184,962	2039/8/1
5 ITALY GOVT 400901	5.0	920	1,208	147,101	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,650	2,163	263,375	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	550	684	83,357	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	623	75,930	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,247	151,838	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,053	250,091	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,300	1,834	223,376	2027/11/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	657	80,044	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	680	1,015	123,594	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	1,200	1,207	146,982	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	100	101	12,302	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,300	1,313	159,942	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	800	805	98,027	2021/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,200	1,222	148,897	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	500	466	56,795	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,700	1,743	212,244	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,800	1,775	216,196	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	800	772	94,017	2026/5/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,100	1,122	136,699	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	950	976	118,893	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	800	827	100,724	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,500	1,527	185,933	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	850	786	95,816	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,600	1,620	197,353	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,079	253,226	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,950	2,130	259,390	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	200	167	20,402	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,700	1,907	232,280	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,583	192,829	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,100	2,319	282,420	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,350	1,548	188,544	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,550	1,814	220,931	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,800	2,082	253,588	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,300	2,664	324,435	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,380	1,756	213,929	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,260	153,430	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,900	3,586	436,642	2026/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,684	205,058	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	2,700	3,155	384,176	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,900	2,007	244,478	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,550	2,183	265,915	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	800	1,191	145,050	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	610	918	111,806	2060/4/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	1,680	1,821	221,748	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	1,570	1,737	211,527	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	2,300	2,909	354,270	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	1,200	1,819	221,535	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,100	1,655	201,525	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	1,750	2,617	318,732	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,820	2,933	357,124	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	910	1,322	161,056	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	1,200	1,496	182,169	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	900	1,363	166,048	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	705	85,853	2018/4/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	716	87,246	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	393	47,966	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	992	120,858	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	800	814	99,165	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	725	88,321	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,221	148,672	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,073	130,721	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	566	68,926	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	859	104,614	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	600	811	98,788	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	900	1,046	127,369	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	911	111,038	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	245	29,934	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	760	1,175	143,183	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	850	907	110,499	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	850	946	115,262	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	800	1,223	148,931	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	640	966	117,740	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	581	70,744	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,006	122,603	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	700	706	85,996	2019/1/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,328	161,719	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,142	139,127	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	685	83,442	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	900	938	114,303	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,539	187,461	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,146	139,547	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,050	1,045	127,313	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	800	850	103,512	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,599	194,754	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,200	1,341	163,382	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	400	403	49,086	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	156	19,005	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	450	482	58,726	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,431	174,240	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,080	1,219	148,519	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	880	938	114,212	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	900	1,149	139,971	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,300	158,292	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,150	1,417	172,600	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,000	1,048	127,666	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,200	1,342	163,409	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,040	1,317	160,388	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	820	1,121	136,575	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	750	946	115,275	2024/1/31
4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,100	1,295	157,763	2020/10/31		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		銘柄	当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	850	1,188	144,709	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	678	82,666	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	600	870	106,032	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,151	140,203	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,347	164,050	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,100	1,631	198,604	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,300	1,650	200,942	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	850	1,179	143,650	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,330	1,931	235,227	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	850	861	104,929	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	750	762	92,900	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	500	478	58,213	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	900	922	112,354	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	275	33,588	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	350	365	44,483	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	172	20,968	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	908	110,611	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	850	987	120,213	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	764	93,124	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	600	743	90,531	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	900	1,036	126,188	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	480	680	82,814	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	737	89,801	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	200	219	26,741	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	850	1,032	125,761	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	500	683	83,278	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,088	132,574	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	800	993	120,999	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	750	1,128	137,405	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	669	81,519	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	800	1,258	153,242	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,050	1,558	189,784	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	306	37,291	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	302	36,856	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	250	257	31,357	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	650	689	83,974	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	146	17,878	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	67,141	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	600	666	81,170	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	477	58,085	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	330	394	48,091	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	550	66,996	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	500	600	73,112	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	870	1,022	124,512	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	719	87,556	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	190	309	37,721	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	870	1,000	121,841	2020/7/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	600	907	110,522	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	550	607	73,997	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	630	662	80,611	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	450	624	76,041	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	470	57,324	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	346	42,173	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	192	23,395	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	51	6,280	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	250	257	31,301	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	328	40,046	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	20,548	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	319	38,905	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	365	44,507	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	250	280	34,211	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	290	35,339	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	649	79,123	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	392	47,777	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	207	25,224	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	288	35,105	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	440	484	59,047	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	350	416	50,700	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	450	545	66,448	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	620	691	84,167	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	350	380	46,288	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	679	82,787	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	418	50,928	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	600	812	98,881	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	351	42,738	2019/10/18		
小 計						35,756,092	
イギリス							
イギリス	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	300	294	42,067	2022/7/22
		1.25 GILT 180722	1.25	1,600	1,626	232,514	2018/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	1,600	1,658	237,136	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	700	702	100,407	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	400	352	50,375	2047/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,500	1,554	222,342	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,300	1,365	195,237	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	1,500	1,579	225,844	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	900	949	135,801	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,150	1,242	177,710	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	650	775	110,820	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,100	1,227	175,487	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,200	1,484	212,279	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,130	1,464	209,338	2045/1/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	910	1,388	198,522	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	820	894	127,935	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	900	1,006	143,973	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	960	1,096	156,787	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	500	726	103,909	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	900	1,049	150,024	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	850	1,374	196,593	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	700	887	126,889	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	840	1,110	158,727	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,300	1,766	252,568	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	710	1,000	143,025	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,000	1,484	212,214	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	870	1,336	191,167	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,000	1,635	233,867	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	1,000	1,090	155,976	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,050	1,451	207,501	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,110	1,650	236,057	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,136	162,463	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	900	1,231	176,158	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	670	991	141,735	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	650	684	97,942	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,100	1,421	203,204	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	380	560	80,216	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	350	462	66,144	2021/6/7
	小 計					6,460,380	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	200	223	25,344	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	166	18,832	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	350	363	41,186	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	280	305	34,631	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	250	319	36,189	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	320	465	52,739	2028/4/8
	小 計					208,924	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	3,250	3,330	42,791	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,200	4,541	58,360	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,700	4,295	55,195	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,000	5,919	76,066	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,400	3,191	41,012	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,650	5,129	65,911	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	5,100	6,134	78,834	2020/12/1
	小 計					418,172	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,000	1,972	26,905	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,100	2,130	29,058	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,950	3,068	41,848	2023/5/24

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,400	2,652	36,184	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,000	4,457	60,794	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,630	3,949	53,871	2019/5/22
小計					248,663	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	2,500	2,538	41,563	2018/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,750	3,008	49,249	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,000	5,549	90,849	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	4,800	5,533	90,581	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	5,310	5,968	97,703	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,650	11,035	180,650	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	1,090	1,664	27,246	2024/11/10
小計					577,843	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,500	1,454	40,689	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	1,200	1,143	31,991	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,450	1,400	39,191	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,300	1,171	32,767	2026/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,200	1,229	34,388	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,250	2,184	61,108	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	950	974	27,274	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,300	1,341	37,539	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	900	981	27,453	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,110	1,204	33,688	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	850	953	26,679	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,580	44,221	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	945	26,459	2029/4/25
	POLAND 181025	—	1,100	1,062	29,739	2018/10/25
小計					546,918	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	800	790	67,831	2020/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	300	282	24,261	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,400	1,431	122,742	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,400	1,421	121,883	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	600	597	51,243	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	350	320	27,460	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	300	258	22,172	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	850	871	74,740	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,300	1,360	116,730	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,200	1,239	106,327	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	250	237	20,369	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	520	541	46,438	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,700	1,918	164,541	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,509	129,479	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	600	699	60,005	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,700	2,004	171,957	2027/4/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,330	1,424	122,149	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	829	71,114	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,200	1,415	121,415	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,310	1,504	129,042	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,300	1,531	131,385	2022/7/15
小	計					1,903,293	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	100	99	7,961	2018/4/1
		1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	100	97	7,827	2021/10/1
		1.625 SINGAPORGOVT 191001	1.625	250	251	20,156	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	370	375	30,068	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOVT 260601	2.125	250	245	19,704	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOVT 250601	2.375	150	150	12,096	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	550	570	45,754	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	370	372	29,837	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	200	200	16,112	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOVT 290701	2.875	350	361	28,967	2029/7/1
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	205	16,459	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	527	42,244	2024/9/1
		3.125 SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	424	33,987	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	260	274	22,027	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOVT 330901	3.375	450	490	39,282	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	370	405	32,491	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	490	511	41,041	2018/9/1
小	計					532,070	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド			
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	9,200	10,266	87,778	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,410	29,156	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,600	2,606	22,284	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,400	3,247	27,761	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	5,600	4,651	39,769	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,851	24,383	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,200	3,109	26,585	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,900	1,908	16,313	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,700	4,295	36,727	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,800	3,480	29,760	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	5,100	4,668	39,918	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,700	4,369	37,362	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,500	6,027	51,531	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	1,600	1,528	13,068	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,200	1,147	9,810	2040/1/31
小	計					492,212	
合	計					89,359,623	

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

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 89,359,623	% 96.9
コール・ローン等、その他	2,872,912	3.1
投資信託財産総額	92,232,535	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (90,456,093千円) の投資信託財産総額 (92,232,535千円) に対する比率は98.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	183,544,025,876
コール・ローン等	450,478,854
公社債(評価額)	89,359,623,726
未収入金	92,933,013,317
未収利息	746,061,431
前払費用	54,848,548
(B) 負債	91,364,407,437
未払金	91,360,321,640
未払解約金	4,085,578
未払利息	219
(C) 純資産総額(A-B)	92,179,618,439
元本	73,688,743,763
次期繰越損益金	18,490,874,676
(D) 受益権総口数	73,688,743,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,509円

<注記事項>

- ①期首元本額 45,472,741,060円
 期中追加設定元本額 36,627,504,520円
 期中一部解約元本額 8,411,501,817円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,509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)

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	17,724,985円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,193,352,179円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,182,431,336円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	19,509,450円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	139,439,658円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,596,138,745円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	66,702,280円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	41,815,849,105円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,503,171,426円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	429,836,891円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	499,408,174円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,230,227,777円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	179,490,028円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	211,829,180円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,603,632,549円
合計	73,688,743,763円

[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ため(分散型に分類)、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3月16日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,987,199,908
受取利息	1,987,449,349
支払利息	△ 249,441
(B) 有価証券売買損益	△ 3,590,820,610
売買益	18,213,147,829
売買損	△21,803,968,439
(C) 保管費用等	△ 12,474,555
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,616,095,257
(E) 前期繰越損益金	11,882,079,061
(F) 追加信託差損益金	10,686,056,557
(G) 解約差損益金	△ 2,461,165,685
(H) 計(D+E+F+G)	18,490,874,676
次期繰越損益金(H)	18,490,874,676

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