

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2007年10月31日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じてNOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	国内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、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の利子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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

ファンド・マネジャー （国内債券）



第15期（決算日：2022年3月25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「ファンド・マネジャー（国内債券）」は、去る3月25日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込分配	み金騰落	中率	期騰落	中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
11期(2018年3月26日)	12,146	0	0.7	382.33	0.9	99.7	0.3	115,430	
12期(2019年3月25日)	12,325	0	1.5	388.94	1.7	98.9	0.1	140,816	
13期(2020年3月25日)	12,275	0	△0.4	388.41	△0.1	96.7	0.1	195,494	
14期(2021年3月25日)	12,187	0	△0.7	386.37	△0.5	99.1	0.3	40	
15期(2022年3月25日)	11,951	0	△1.9	379.90	△1.7	99.5	0.1	37	

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年3月25日	12,187	—	386.37	—	99.1	0.3
3月末	12,167	△0.2	385.72	△0.2	98.8	0.2
4月末	12,186	△0.0	386.44	0.0	98.7	0.1
5月末	12,189	0.0	386.62	0.1	99.5	0.3
6月末	12,194	0.1	386.90	0.1	100.1	0.1
7月末	12,251	0.5	388.81	0.6	99.4	0.4
8月末	12,238	0.4	388.46	0.5	99.5	0.4
9月末	12,195	0.1	387.12	0.2	99.2	0.4
10月末	12,178	△0.1	386.72	0.1	99.5	0.4
11月末	12,204	0.1	387.65	0.3	98.8	0.4
12月末	12,176	△0.1	386.84	0.1	99.8	0.2
2022年1月末	12,086	△0.8	384.06	△0.6	100.9	0.2
2月末	12,024	△1.3	382.13	△1.1	99.4	0.2
(期 末) 2022年3月25日	11,951	△1.9	379.90	△1.7	99.5	0.1

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第15期：2021年3月26日～2022年3月25日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第15期首	12,187円
第15期末	11,951円
既払分配金	0円
騰落率	-1.9%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.9%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（-1.7%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

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

第15期：2021年3月26日～2022年3月25日

投資環境について

▶ 国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

国内債券市況は期の前半から2021年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市

況は下落しました。期末にかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ファンド・マネジャー（国内債券）

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

▶ 国内債券インデックスマザーファンド

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

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ ファンド・マネジャー（国内債券）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

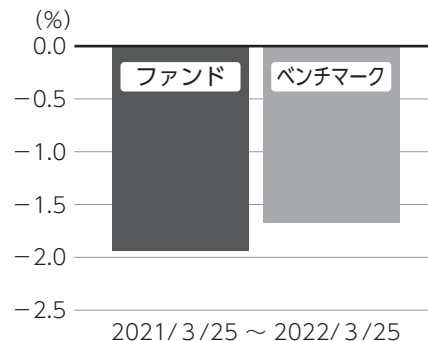
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因[※]によるものです。

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

主なマイナス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶ 分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第15期 2021年3月26日～2022年3月25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	4,572

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

▶ **ファンド・マネジャー（国内債券）**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **国内債券インデックスマザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年3月26日～2022年3月25日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	31	0.253	(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）	(20)	(0.165)	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）	(7)	(0.055)	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）	(4)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.003	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	31	0.256	

期中の平均基準価額は、12,171円です。

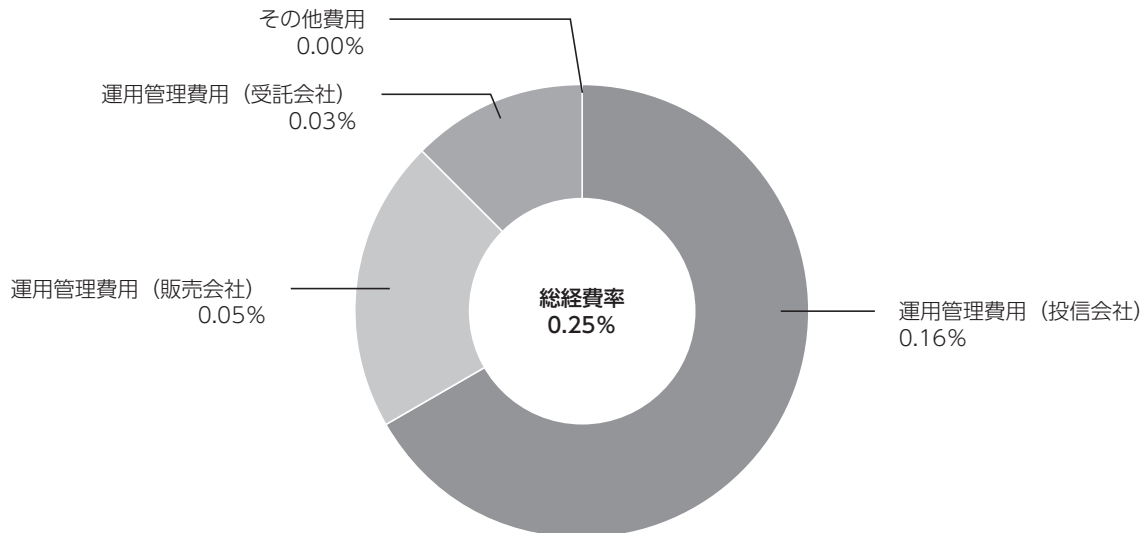
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.25%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2021年3月26日～2022年3月25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
国内債券インデックスマザーファンド	千口 1	千円 1	千口 2,360	千円 2,311

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月26日～2022年3月25日)

利害関係人との取引状況

<ファンド・マネジャー（国内債券）>

該当事項はございません。

<国内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 252,383	百万円 82,355	% 32.6	百万円 167,843	百万円 49,889	% 29.7

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。

利害関係人の発行する有価証券等

<国内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 401	百万円 102	百万円 898

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

<国内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 1,800

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年3月26日～2022年3月25日)

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 15	百万円 —	百万円 —	百万円 15	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

(2022年3月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券インデックスマザーファンド	千口 41,579	千口 39,220	千円 37,695

○投資信託財産の構成

(2022年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックスマザーファンド	千円 37,695	% 99.9
コール・ローン等、その他	51	0.1
投資信託財産総額	37,746	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年3月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	37,746,668
コール・ローン等	50,064
国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	37,695,005
未収入金	1,599
(B) 負債	48,701
未払信託報酬	48,206
その他未払費用	495
(C) 純資産総額(A－B)	37,697,967
元本	31,544,315
次期繰越損益金	6,153,652
(D) 受益権総口数	31,544,315口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,951円

<注記事項>

- ①期首元本額 33,356,266円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 1,811,951円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1951円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年3月26日～ 2022年3月25日
費用控除後の配当等収益額	149,806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	13,801,440円
分配準備積立金額	472,869円
当ファンドの分配対象収益額	14,424,115円
1万口当たり収益分配対象額	4,572円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金額	－円

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

○損益の状況（2021年3月26日～2022年3月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 645,378
売買益	4,579
売買損	△ 649,957
(B) 信託報酬等	△ 99,950
(C) 当期損益金(A+B)	△ 745,328
(D) 前期繰越損益金	△ 242,640
(E) 追加信託差損益金	7,141,620
(配当等相当額)	(13,801,440)
(売買損益相当額)	(△ 6,659,820)
(F) 計(C+D+E)	6,153,652
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	6,153,652
追加信託差損益金	7,141,620
(配当等相当額)	(13,801,440)
(売買損益相当額)	(△ 6,659,820)
分配準備積立金	622,675
繰越損益金	△ 1,610,643

- (注) (A) 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) (B) 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) (E) 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。

国内債券インデックスマザーファンド

《第2期》決算日2021年5月12日

[計算期間：2020年5月13日～2021年5月12日]

「国内債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第2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2期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日) 2020年3月2日	円	%		%	%	%	百万円 999
1期(2020年5月12日)	9,835	△1.7	388.75	△1.5	99.5	—	71,305
2期(2021年5月12日)	9,791	△0.4	386.93	△0.5	100.6	0.1	145,774

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年5月12日	円 9,835	% —	388.75	% —	% 99.5	% —
5月末	9,818	△0.2	388.13	△0.2	99.6	—
6月末	9,779	△0.6	386.56	△0.6	99.6	—
7月末	9,813	△0.2	387.91	△0.2	99.5	—
8月末	9,768	△0.7	386.09	△0.7	98.6	0.9
9月末	9,795	△0.4	387.22	△0.4	99.7	0.1
10月末	9,780	△0.6	386.63	△0.5	100.3	0.1
11月末	9,793	△0.4	387.12	△0.4	99.6	0.0
12月末	9,795	△0.4	387.20	△0.4	99.7	0.0
2021年1月末	9,774	△0.6	386.25	△0.6	100.2	0.2
2月末	9,692	△1.5	383.06	△1.5	99.3	0.4
3月末	9,760	△0.8	385.72	△0.8	98.8	0.2
4月末	9,778	△0.6	386.44	△0.6	98.7	0.1
(期 末) 2021年5月12日	9,791	△0.4	386.93	△0.5	100.6	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

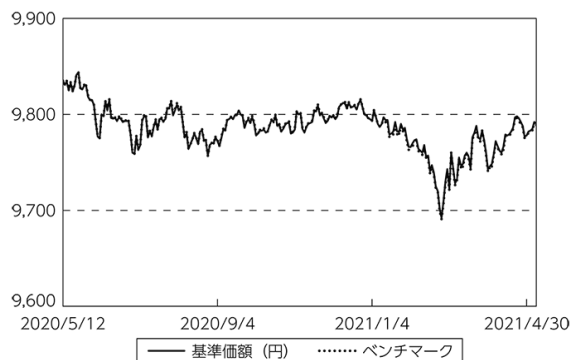
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.4%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(−0.5%)を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 国内債券市況

- ・ 国内債券市況は下落しました。
- ・ 国内債券市況は、期の前半はやや下落したあと概ね横ばいで推移しましたが、期の後半にインフレや米債増発への懸念による米金利の上昇、日本銀行の金融政策点検に対する警戒感などから下落しました。公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感から、国内債券市況は反発したものの、期を通してみると国内債券市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは0.5%の下落になったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年5月13日～2021年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,785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

(2020年5月13日～2021年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	413,135,281	348,127,768
	地方債証券	20,467,102	17,130,435
	特殊債券	23,313,437	19,474,820
	社債券	25,713,174	(198,596) 20,739,542

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 8,501	百万円 8,348	百万円 —	百万円 —

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月13日～2021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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	482,628	58,808	12.2	405,472	126,408	31.2

(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
	百万円	百万円	百万円
公社債	2,321	2,028	603

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
	百万円
公社債	5,600

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UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021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	115,945,000	123,658,988	84.8	—	57.5	17.4	10.0
地方債証券	6,422,000	6,880,032	4.7	—	2.4	1.7	0.6
	(6,422,000)	(6,880,032)	(4.7)	(—)	(2.4)	(1.7)	(0.6)
特殊債券 (除く金融債)	7,163,592	7,530,924	5.2	—	2.7	1.6	0.9
	(7,163,592)	(7,530,924)	(5.2)	(—)	(2.7)	(1.6)	(0.9)
金融債券	710,000	712,500	0.5	—	—	0.4	0.1
	(710,000)	(712,500)	(0.5)	(—)	(—)	(0.4)	(0.1)
普通社債券	7,810,000	7,911,669	5.4	—	1.5	3.5	0.3
	(7,810,000)	(7,911,669)	(5.4)	(—)	(1.5)	(3.5)	(0.3)
合 計	138,050,592	146,694,116	100.6	—	64.1	24.5	12.0
	(22,105,592)	(23,035,127)	(15.8)	(—)	(6.6)	(7.1)	(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413回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,484	2022/6/1
第414回利付国債 (2年)	0.1	800,000	802,176	2022/7/1
第415回利付国債 (2年)	0.1	250,000	250,732	2022/8/1
第416回利付国債 (2年)	0.1	1,250,000	1,253,912	2022/9/1
第417回利付国債 (2年)	0.1	1,030,000	1,033,429	2022/10/1
第418回利付国債 (2年)	0.1	400,000	401,412	2022/11/1
第419回利付国債 (2年)	0.1	1,400,000	1,405,222	2022/12/1
第420回利付国債 (2年)	0.1	480,000	481,848	2023/1/1
第421回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,810	2023/2/1
第422回利付国債 (2年)	0.1	20,000	20,086	2023/3/1
第423回利付国債 (2年)	0.005	1,680,000	1,684,435	2023/4/1
第132回利付国債 (5年)	0.1	300,000	300,744	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	280,000	280,854	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	400,000	401,480	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,500,000	1,506,540	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	360,000	361,782	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,750,000	1,759,922	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	2,020,000	2,032,928	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	700,000	704,907	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	1,690,000	1,702,641	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	1,120,000	1,128,870	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	1,743,000	1,757,519	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	1,390,000	1,402,371	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	1,080,000	1,090,022	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,350,000	1,363,000	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	2,090,000	2,109,813	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	1,100,000	1,105,357	2026/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	50,000	72,661	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	40,000	56,417	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	80,000	113,292	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	250,000	355,772	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	230,000	317,128	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	251,000	340,991	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	320,000	418,896	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	330,000	404,279	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	580,000	533,489	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	470,000	506,368	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	420,000	439,383	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	401,000	379,269	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	510,000	481,786	2060/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	700,000	707,931	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	500,000	505,110	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,500,000	1,518,840	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	200,000	202,654	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	300,000	304,464	2022/12/20

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328回利付国債 (10年)	0.6	900,000	912,195	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	400,000	407,888	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	200,000	204,444	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	300,000	305,247	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	100,000	101,935	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,400,000	1,429,862	2024/3/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	370,000	377,918	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	600,000	613,692	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	400,000	408,204	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,230,000	1,256,629	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	750,000	767,077	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	300,000	305,691	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	110,000	111,072	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,190,000	1,201,590	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	1,610,000	1,626,019	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,580,000	1,596,005	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	850,000	858,738	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	950,000	959,899	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	1,360,000	1,374,320	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,220,000	1,232,944	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,370,000	1,384,124	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,160,000	1,171,565	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	740,000	747,089	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	1,043,000	1,052,533	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	1,160,000	1,170,022	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	990,000	998,019	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	1,250,000	1,259,387	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	970,000	976,663	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	870,000	875,376	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	1,150,000	1,156,256	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	1,300,000	1,306,045	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	1,380,000	1,384,609	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	660,000	661,610	2031/3/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	50,000	60,565	2031/5/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	50,000	61,921	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	50,000	55,531	2033/3/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	100,000	123,581	2033/9/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	190,000	243,289	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	100,000	129,784	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	100,000	130,173	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	250,000	323,060	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	100,000	128,218	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	100,000	128,541	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	100,000	131,729	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	100,000	129,250	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	160,000	212,008	2036/3/20

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第23回利付国債 (30年)	2.5	320,000	425,100
第24回利付国債 (30年)	2.5	100,000	133,175
第25回利付国債 (30年)	2.3	410,000	535,033
第26回利付国債 (30年)	2.4	300,000	397,137
第27回利付国債 (30年)	2.5	100,000	134,615
第28回利付国債 (30年)	2.5	100,000	135,290
第29回利付国債 (30年)	2.4	370,000	496,543
第30回利付国債 (30年)	2.3	300,000	399,297
第31回利付国債 (30年)	2.2	100,000	131,795
第32回利付国債 (30年)	2.3	330,000	442,629
第33回利付国債 (30年)	2.0	450,000	581,436
第34回利付国債 (30年)	2.2	520,000	694,059
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	651,200
第36回利付国債 (30年)	2.0	390,000	509,609
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	645,655
第38回利付国債 (30年)	1.8	340,000	433,476
第39回利付国債 (30年)	1.9	310,000	402,389
第40回利付国債 (30年)	1.8	341,000	435,835
第41回利付国債 (30年)	1.7	280,000	352,536
第42回利付国債 (30年)	1.7	310,000	390,699
第43回利付国債 (30年)	1.7	330,000	416,328
第44回利付国債 (30年)	1.7	300,000	378,855
第45回利付国債 (30年)	1.5	360,000	439,254
第46回利付国債 (30年)	1.5	420,000	512,782
第47回利付国債 (30年)	1.6	400,000	497,860
第48回利付国債 (30年)	1.4	396,000	475,445
第49回利付国債 (30年)	1.4	350,000	420,395
第50回利付国債 (30年)	0.8	400,000	424,648
第51回利付国債 (30年)	0.3	400,000	377,524
第52回利付国債 (30年)	0.5	400,000	395,548
第53回利付国債 (30年)	0.6	370,000	374,151
第54回利付国債 (30年)	0.8	410,000	434,181
第55回利付国債 (30年)	0.8	370,000	391,559
第56回利付国債 (30年)	0.8	320,000	338,412
第57回利付国債 (30年)	0.8	400,000	422,716
第58回利付国債 (30年)	0.8	610,000	644,172
第59回利付国債 (30年)	0.7	370,000	381,292
第60回利付国債 (30年)	0.9	230,000	248,255
第61回利付国債 (30年)	0.7	338,000	347,237
第62回利付国債 (30年)	0.5	480,000	467,985
第63回利付国債 (30年)	0.4	390,000	369,462
第64回利付国債 (30年)	0.4	300,000	283,398
第65回利付国債 (30年)	0.4	360,000	339,519
第66回利付国債 (30年)	0.4	450,000	423,693
第67回利付国債 (30年)	0.6	420,000	416,900
第68回利付国債 (30年)	0.6	390,000	386,618

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第69回利付国債 (30年)	0.7	420,000	427,333
第70回利付国債 (30年)	0.7	160,000	162,609
第56回利付国債 (20年)	2.0	100,000	102,349
第59回利付国債 (20年)	1.7	100,000	102,935
第63回利付国債 (20年)	1.8	100,000	104,072
第64回利付国債 (20年)	1.9	100,000	104,810
第65回利付国債 (20年)	1.9	270,000	284,364
第66回利付国債 (20年)	1.8	430,000	451,753
第68回利付国債 (20年)	2.2	200,000	213,370
第70回利付国債 (20年)	2.4	50,000	53,951
第72回利付国債 (20年)	2.1	100,000	107,535
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	108,612
第77回利付国債 (20年)	2.0	150,000	162,337
第78回利付国債 (20年)	1.9	100,000	108,331
第80回利付国債 (20年)	2.1	100,000	109,156
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	109,259
第83回利付国債 (20年)	2.1	200,000	220,408
第84回利付国債 (20年)	2.0	200,000	219,482
第86回利付国債 (20年)	2.3	140,000	156,343
第89回利付国債 (20年)	2.2	200,000	223,484
第90回利付国債 (20年)	2.2	300,000	336,882
第92回利付国債 (20年)	2.1	300,000	336,822
第93回利付国債 (20年)	2.0	50,000	56,098
第94回利付国債 (20年)	2.1	60,000	67,670
第95回利付国債 (20年)	2.3	400,000	458,112
第96回利付国債 (20年)	2.1	100,000	113,302
第97回利付国債 (20年)	2.2	100,000	114,456
第98回利付国債 (20年)	2.1	200,000	227,636
第99回利付国債 (20年)	2.1	300,000	342,972
第100回利付国債 (20年)	2.2	50,000	57,735
第101回利付国債 (20年)	2.4	200,000	233,690
第102回利付国債 (20年)	2.4	200,000	234,766
第103回利付国債 (20年)	2.3	200,000	233,340
第105回利付国債 (20年)	2.1	90,000	104,132
第106回利付国債 (20年)	2.2	140,000	163,016
第107回利付国債 (20年)	2.1	100,000	116,148
第108回利付国債 (20年)	1.9	300,000	343,872
第109回利付国債 (20年)	1.9	300,000	345,027
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	116,580
第111回利付国債 (20年)	2.2	40,000	47,131
第112回利付国債 (20年)	2.1	500,000	585,090
第113回利付国債 (20年)	2.1	620,000	728,183
第114回利付国債 (20年)	2.1	100,000	117,868
第115回利付国債 (20年)	2.2	100,000	118,727
第116回利付国債 (20年)	2.2	150,000	178,737
第117回利付国債 (20年)	2.1	700,000	827,925

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118回利付国債 (20年)	2.0	350,000	412,412	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	100,000	116,017	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	250,000	285,505	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	230,000	269,748	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	160,000	186,161	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	180,000	215,067	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	400,000	474,108	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	510,000	616,289	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	110,000	130,772	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	40,000	47,162	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	190,000	224,659	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	190,000	222,754	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	180,000	211,581	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	290,000	337,905	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	290,000	338,691	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	422,000	497,284	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	510,000	602,427	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	100,000	117,051	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	100,000	115,978	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	430,000	504,445	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	70,000	80,585	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	240,000	278,920	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	510,000	599,938	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	240,000	282,916	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	600,000	714,150	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	440,000	514,593	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	220,000	254,733	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	644,000	762,663	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	550,000	652,624	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	710,000	835,293	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	610,000	711,589	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	800,000	934,592	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	640,000	740,384	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	540,000	611,118	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	500,000	566,245	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	590,000	676,700	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	730,000	827,827	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	740,000	818,780	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	602,000	613,612	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	500,000	494,200	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	520,000	536,447	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	210,000	219,718	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	480,000	509,049	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	580,000	605,798	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	660,000	688,716	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	600,000	625,500	2037/12/20

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164回利付国債 (20年)		0.5	884,000	906,542	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	610,000	624,762	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	360,000	380,304	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	620,000	633,317	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	420,000	421,402	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	540,000	531,327	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	690,000	677,614	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	500,000	490,490	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	430,000	428,869	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)		0.4	590,000	587,392	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)		0.4	630,000	626,616	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)		0.5	610,000	617,716	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)		0.5	120,000	121,424	2041/3/20
小	計		115,945,000	123,658,988	
地方債証券					
第6回東京都公募公債 (20年)		2.0	100,000	107,659	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	109,339	2025/9/19
第8回東京都公募公債 (30年)		2.23	80,000	103,844	2038/9/17
第11回東京都公募公債 (20年)		2.22	100,000	112,597	2027/3/19
第31回東京都公募公債 (5年)		0.005	100,000	99,984	2024/6/20
第721回東京都公募公債		0.84	100,000	101,748	2023/6/20
第732回東京都公募公債		0.645	100,000	101,972	2024/6/20
第792回東京都公募公債		0.05	100,000	99,602	2029/3/19
第1回神奈川県公募公債 (30年)		2.54	100,000	130,501	2035/6/20
第26回神奈川県公募公債 (20年)		1.477	20,000	23,071	2034/6/20
第11回大阪府公募公債 (20年)		1.693	100,000	117,316	2033/9/27
第378回大阪府公募公債		0.7	200,000	203,464	2023/11/28
第388回大阪府公募公債		0.54	200,000	203,504	2024/9/27
第451回大阪府公募公債		0.063	127,000	126,218	2029/12/26
平成24年度第10回京都府公募公債		0.67	100,000	101,227	2023/3/22
平成29年度第10回京都府公募公債 (5年)		0.03	100,000	100,032	2022/12/22
第2回兵庫県公募公債 (30年)		2.36	100,000	133,772	2040/3/19
第9回兵庫県公募公債 (20年)		2.25	200,000	235,748	2029/11/19
平成28年度第3回兵庫県公募公債		0.08	100,000	100,276	2026/5/22
第11回静岡県公募公債 (20年)		1.841	200,000	231,580	2030/10/18
平成27年度第10回静岡県公募公債		0.461	100,000	101,941	2025/9/19
平成29年度第14回静岡県公募公債 (5年)		0.04	10,000	10,005	2023/3/20
令和2年度第7回静岡県公募公債 (5年)		0.02	200,000	200,032	2025/6/20
平成20年度第2回愛知県公募公債 (20年)		2.46	100,000	116,821	2028/6/20
平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年)		2.28	200,000	235,180	2029/6/20
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	200,000	216,306	2026/11/13
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)		1.314	100,000	108,160	2027/12/13
平成27年度第5回愛知県公募公債		0.544	100,000	102,138	2025/5/27
平成24年度第5回広島県公募公債		0.84	100,000	101,417	2023/1/25
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	100,854	2028/3/23
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	101,205	2025/1/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成29年度第7回埼玉県公募公債（5年）		0.02	200,000	200,028	2022/10/27
平成30年度第8回埼玉県公募公債		0.145	300,000	301,137	2029/1/30
平成27年度第7回千葉県公募公債		0.41	100,000	101,856	2026/1/23
第126回共同発行市場公募地方債		0.81	210,000	213,985	2023/9/25
第138回共同発行市場公募地方債		0.554	100,000	101,831	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	101,750	2024/11/25
平成28年度第2回島根県公募公債（20年）		0.506	100,000	102,052	2036/9/30
平成27年度第1回新潟市公募公債		0.464	10,000	10,207	2025/12/24
第1回名古屋市公募公債（30年）		2.53	100,000	130,104	2035/3/20
第7回京都市公募公債（20年）		2.38	200,000	233,670	2028/9/21
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）		2.08	100,000	115,083	2028/12/20
平成27年度第3回横浜市公募公債		0.524	100,000	102,170	2025/8/18
平成23年度第3回札幌市公募公債		1.944	100,000	117,807	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募公債		0.961	100,000	107,049	2029/9/20
第9回川崎市公募公債（20年）		2.15	100,000	118,038	2030/5/24
第50回川崎市公募公債（5年）		0.01	150,000	14,999	2022/6/20
第60回川崎市公募公債（5年）		0.02	140,000	140,030	2025/10/30
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）		1.371	100,000	114,125	2034/9/20
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）		0.02	100,000	100,022	2025/10/24
平成30年度第3回千葉市公募公債		0.259	10,000	10,126	2028/11/22
平成24年度第1回相模原市公募公債		0.71	200,000	202,250	2022/12/20
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	101,250	2023/3/24
平成24年度第2回岡山県公募公債		0.68	100,000	101,258	2023/3/29
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	101,688	2024/3/19
小	計		6,422,000	6,880,032	
特殊債券(除く金融債)					
第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	200,000	206,944	2023/1/31
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	116,038	2028/11/28
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	116,773	2031/10/31
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	100,000	126,050	2042/5/30
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	113,746	2033/4/28
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	209,000	211,572	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	200,000	203,746	2023/6/30
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	9,000	9,172	2023/8/31
第225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.556	100,000	101,799	2024/8/30
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	100,000	101,721	2024/11/29
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.174	106,000	106,913	2027/2/26
第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	100,639	2028/6/30
第22回政府保証日本政策投資銀行債券		2.2	100,000	104,621	2023/6/19
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.791	100,000	101,157	2022/10/18
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.541	229,000	231,473	2023/4/21
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.66	100,000	101,965	2024/5/21
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.601	100,000	101,877	2024/7/16
第70回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.45	100,000	101,684	2025/3/14
第74回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.557	113,000	115,551	2025/7/15
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	13,000	13,214	2025/11/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券 (除く金融債)	%	千円	千円	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,717	2027/8/13
第3回政府保証新関西国際空港債券	0.644	100,000	101,979	2024/6/26
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	100,000	101,257	2023/3/15
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	100,000	111,699	2026/3/19
第27回道路債券 (財投機関債)	2.42	150,000	160,272	2024/3/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	2.37	100,000	116,372	2028/9/20
第42回道路債券 (財投機関債)	2.22	110,000	119,277	2025/3/21
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	58,727	2030/5/10
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	0.666	300,000	303,648	2023/3/20
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	1.038	100,000	101,907	2023/3/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	1.133	100,000	110,421	2035/3/20
第8回地方公共団体金融機構債券 (20年) (財投機関債)	2.043	100,000	116,840	2030/6/28
第11回地方公共団体金融機構債券 (20年) (財投機関債)	1.851	100,000	115,604	2030/10/28
第24回公営企業債券 (20年) (財投機関債)	2.29	100,000	114,983	2028/4/25
第24回地方公共団体金融機構債券 (20年) (財投機関債)	1.702	100,000	116,070	2032/9/28
F54回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.588	100,000	104,469	2024/3/19
F89回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.602	100,000	109,331	2027/8/20
F101回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.22	100,000	103,378	2024/3/6
F122回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.412	200,000	215,782	2027/6/18
F149回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.145	100,000	105,152	2025/12/19
F257回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	0.335	300,000	301,344	2022/9/28
第11回福祉医療機構債券 (財投機関債)	2.57	100,000	112,287	2026/3/20
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	60,888	60,882	2033/1/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	33,429	33,730	2032/11/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	40,206	43,091	2044/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	23,024	23,467	2040/6/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	24,116	25,518	2045/5/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	73,710	78,093	2046/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	43,006	44,928	2047/11/10
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	94,756	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	117,438	122,317	2048/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	45,422	47,302	2049/4/10
第84回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	1.536	100,000	107,704	2026/9/18
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	112,984	115,235	2050/2/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	1.441	100,000	107,740	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	68,057	70,479	2050/12/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	240,303	242,386	2051/12/10
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	81,758	82,480	2052/5/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	167,130	168,762	2052/10/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	87,071	87,763	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	88,115	89,114	2053/9/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	188,858	189,503	2055/1/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	99,077	99,564	2056/2/10
第256回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	0.03	100,000	100,028	2024/3/19
第25回西日本高速道路	0.524	100,000	101,707	2024/12/20

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72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.905	100,000	106,191	2029/11/27
小 計			7,163,592	7,530,924	
金融債券					
い第817号商工債券		0.17	110,000	110,314	2023/6/27
い第832号商工債券		0.06	100,000	99,963	2024/9/27
い第825号農林債券		0.07	100,000	100,097	2024/2/27
第336回信金中金債		0.1	100,000	100,107	2022/11/25
第11号商工債券(10年)		0.66	100,000	101,973	2024/9/20
第240号商工債券(3年)		0.02	100,000	99,974	2023/1/27
第248号商工債券(3年)		0.07	100,000	100,072	2023/9/27
小 計			710,000	712,500	
普通社債券					
第500回中部電力		0.875	200,000	204,964	2024/5/24
第503回中部電力		0.584	10,000	10,191	2025/3/25
第500回関西電力		0.455	100,000	101,493	2026/3/19
第506回関西電力		0.33	100,000	100,754	2026/10/23
第510回関西電力		0.49	100,000	101,588	2027/7/23
第322回北陸電力		0.38	100,000	101,149	2027/6/25
第475回東北電力		0.809	100,000	102,466	2024/9/25
第437回九州電力		0.685	100,000	102,569	2026/1/23
第449回九州電力		0.43	300,000	304,323	2027/4/23
第484回九州電力		0.375	100,000	100,623	2029/11/22
第325回北海道電力		1.264	100,000	108,316	2030/10/25
第21回新関西国際空港		1.017	100,000	106,186	2048/9/18
第24回成田国際空港		0.25	100,000	100,851	2027/12/17
第1回国際石油開発帝石		0.08	100,000	100,175	2026/3/16
第16回アサヒグループホールディングス		0.08	100,000	100,006	2026/3/13
第3回 キューピー		0.23	100,000	100,007	2026/2/13
第13回日本たばこ産業		0.355	100,000	100,393	2028/9/8
第9回ヒューリック		0.4	100,000	99,188	2029/6/25
第14回セブン&アイ・ホールディングス		0.19	100,000	100,443	2025/12/19
第9回クラレ		0.34	100,000	100,240	2027/4/30
第42回王子ホールディングス		0.08	100,000	100,054	2026/3/24
第15回Zホールディングス		0.35	200,000	200,144	2023/6/9
第4回新日本製鐵		0.375	100,000	100,005	2027/5/20
第31回ジェイ エフ イー ホールディングス		0.25	100,000	99,115	2026/9/18
第7回ジェイテクト		0.345	100,000	99,344	2028/3/8
第42回川崎重工業		0.791	100,000	101,930	2024/7/18
第18回J A三井リース		0.16	100,000	99,886	2026/3/12
第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)		0.05	100,000	100,048	2026/3/18
第1回明治安田生命2018基金		0.315	200,000	200,304	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金		0.29	100,000	100,028	2024/8/2
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ		0.724	100,000	101,096	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ		0.535	100,000	100,006	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)		1.62	100,000	100,659	2021/10/29
第57回三菱東京UFJ銀行		2.22	100,000	103,136	2022/10/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	100,444	2025/12/19
第42回ホンダファイナンス	0.05	100,000	99,906	2022/6/20
第65回ホンダファイナンス	0.16	100,000	100,139	2025/9/19
第39回リコーリース	0.05	200,000	199,846	2023/7/14
第40回リコーリース	0.04	100,000	99,909	2024/4/19
第41回リコーリース	0.14	100,000	99,858	2026/4/17
第79回アコム	0.29	100,000	99,843	2025/2/28
第80回アコム	0.28	100,000	99,676	2026/2/26
第87回日立キャピタル	0.06	100,000	99,971	2024/1/19
第16回三井住友ファイナンス&リース	0.25	200,000	201,022	2024/9/13
第30回三井住友ファイナンス&リース	0.01	200,000	199,752	2023/8/10
第72回三菱地所	2.28	200,000	214,550	2024/9/20
第147回東日本旅客鉄道	0.265	100,000	100,526	2030/4/22
第17回東海旅客鉄道	2.21	100,000	107,275	2024/9/20
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	114,662	2030/10/25
第73回東海旅客鉄道	1.014	100,000	107,553	2035/1/26
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,911	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,740	2026/3/23
第5回ソフトバンク	0.1	400,000	399,688	2023/7/28
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	100,000	101,206	2028/4/19
第14回東京電力パワーグリッド	0.43	100,000	100,602	2023/7/24
第30回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,290	2024/10/9
第34回東京電力パワーグリッド	0.75	100,000	101,787	2025/4/23
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,206	2025/7/16
第23回東京ガス	1.01	100,000	102,055	2023/6/9
第13回広島ガス	0.405	100,000	100,761	2028/9/13
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	100,157	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	103,108	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,886	2024/10/10
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	100,000	99,906	2023/1/25
第4回フランス預金供託公庫	0.725	100,000	101,754	2024/7/30
小 計		7,810,000	7,911,669	
合 計		138,050,592	146,694,116	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	当 期 末			
	買 建 額	売 建 額		
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 151	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 146,694,116	% 98.5
コール・ローン等、その他	2,220,708	1.5
投資信託財産総額	148,914,824	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	148,914,364,787	
コール・ローン等	1,960,835,772	
公社債(評価額)	146,694,116,635	
未収入金	398,900	
未収利息	190,909,077	
前払費用	67,844,403	
差入委託証拠金	260,000	
(B) 負債	3,139,669,552	
未払金	2,788,286,900	
未払解約金	351,382,029	
未払利息	623	
(C) 純資産総額(A-B)	145,774,695,235	
元本	148,891,221,462	
次期繰越損益金	△ 3,116,526,227	
(D) 受益権総口数	148,891,221,462口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,791円	

<注記事項>

- ①期首元本額 72,499,743,606円
 期中追加設定元本額 481,042,138,260円
 期中一部解約元本額 404,650,660,404円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9791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)

MUKAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	45,289,206,679円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	32,201,931,252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)	20,408,992,208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)	18,727,000,836円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	9,155,338,636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)	7,669,289,772円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	7,533,837,147円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	4,704,665,955円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	1,873,532,743円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	683,241,962円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	603,143,121円
ファンド・マネジャー(国内債券)	41,041,151円
合計	148,891,221,462円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,116,526,227円です。

○損益の状況 (2020年5月13日～2021年5月12日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,193,649,026	
受取利息	1,194,074,766	
その他収益金	142,200	
支払利息	△ 567,940	
(B) 有価証券売買損益	△ 1,204,663,086	
売買益	458,683,280	
売買損	△ 1,663,346,366	
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,812,100	
取引益	4,135,100	
取引損	△ 5,947,200	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 12,826,160	
(E) 前期繰越損益金	△ 1,194,529,447	
(F) 追加信託差損益金	△ 10,607,844,419	
(G) 解約差損益金	8,698,673,799	
(H) 計(D+E+F+G)	△ 3,116,526,227	
次期繰越損益金(H)	△ 3,116,526,227	

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。