

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2009年2月2日設定）	
運用方針	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 総合に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
分配方針	経費等控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。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）

### 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド



第38期（決算日：2018年10月26日）

第39期（決算日：2019年1月28日）



#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「三菱UFJ 国内債券インデックスファンド」は、去る1月28日に第39期の決算を行いましたので、法令に基づいて第38期～第39期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



### 三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近10期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込分配金	み騰落	期中率	期中騰落	期中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
30期(2016年10月26日)	10,817	30	△1.5	385.02	△1.4	99.5	0.3	3,226	
31期(2017年1月26日)	10,569	30	△2.0	377.66	△1.9	99.2	0.4	3,432	
32期(2017年4月26日)	10,596	30	0.5	379.96	0.6	99.3	0.4	3,560	
33期(2017年7月26日)	10,513	30	△0.5	378.50	△0.4	99.4	0.3	3,550	
34期(2017年10月26日)	10,490	30	0.1	379.13	0.2	99.3	0.3	3,519	
35期(2018年1月26日)	10,474	30	0.1	379.99	0.2	99.2	0.5	3,269	
36期(2018年4月26日)	10,475	30	0.3	381.41	0.4	99.4	0.3	3,162	
37期(2018年7月26日)	10,419	30	△0.2	380.79	△0.2	99.1	0.5	3,092	
38期(2018年10月26日)	10,355	30	△0.3	379.98	△0.2	99.2	0.6	3,013	
39期(2019年1月28日)	10,466	30	1.4	385.49	1.5	99.5	0.1	2,740	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		NOMURA-BPI総合		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
第38期	(期 首) 2018年7月26日	10,419	—	380.79	—	99.1	0.5
	7月末	10,450	0.3	381.98	0.3	100.6	0.5
	8月末	10,390	△0.3	379.89	△0.2	99.3	0.6
	9月末	10,362	△0.5	378.99	△0.5	100.3	0.6
	(期 末) 2018年10月26日	10,385	△0.3	379.98	△0.2	99.2	0.6
第39期	(期 首) 2018年10月26日	10,355	—	379.98	—	99.2	0.6
	10月末	10,347	△0.1	379.64	△0.1	95.6	0.2
	11月末	10,387	0.3	381.24	0.3	99.5	0.5
	12月末	10,459	1.0	384.13	1.1	95.9	0.1
	(期 末) 2019年1月28日	10,496	1.4	385.49	1.5	99.5	0.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

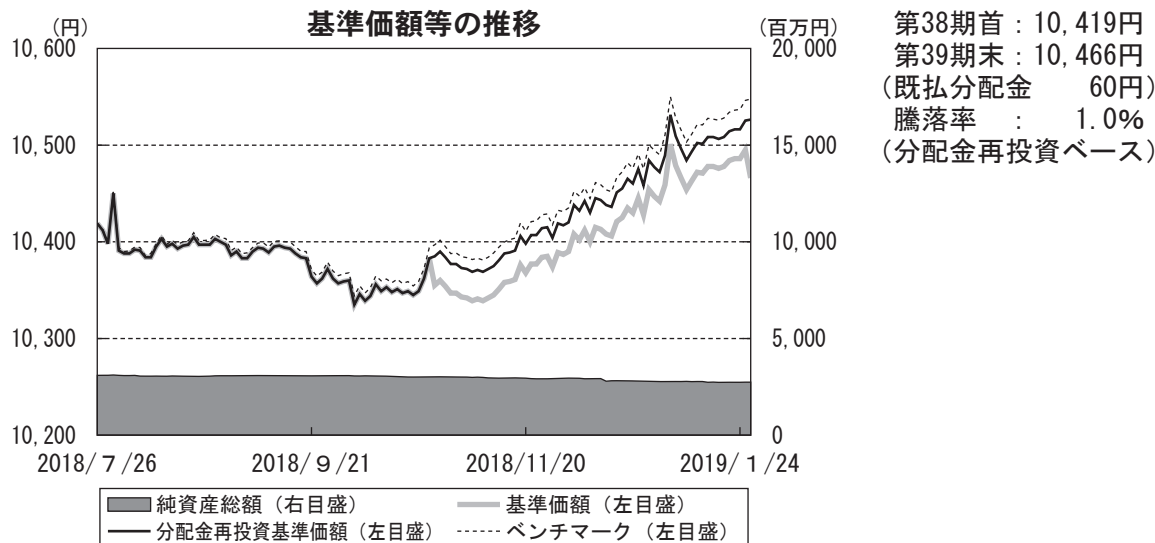
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について (第38期～第39期：2018/7/27～2019/1/28)

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ1.0% (分配金再投資ベース) 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 (1.2%) を0.2%下回りました。



・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、ファンドの購入金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。

## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	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などを背景に、国内債券市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	日本銀行による金融緩和策の柔軟化などを背景に、国内債券市況が下落したことや信託報酬等のコストが基準価額の下落要因となりました。

## 投資環境について

(第38期～第39期：2018/7/27～2019/1/28)

## ◎国内債券市況

- 国内債券市況は、日本銀行による金融緩和策の柔軟化を受けて下落する局面もありましたが、作成期末にかけ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などから、作成期を通じてみると上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

**i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

## &lt;三菱UFJ 国内債券インデックスファンド&gt;

- 当ファンドはマザーファンドに資産のほぼ全額を投資したことにより、基準価額（分配金再投資ベース）はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

基準価額は当作成期首に比べ1.2%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。
  - ベンチマークである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。

(ご参考)

## 利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

作成期首（2018年7月26日）

作成期末（2019年1月28日）

最終利回り	0.2%	➡	最終利回り	0.1%
直接利回り	0.9%		直接利回り	0.9%
デュレーション	8.9年		デュレーション	9.1年

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

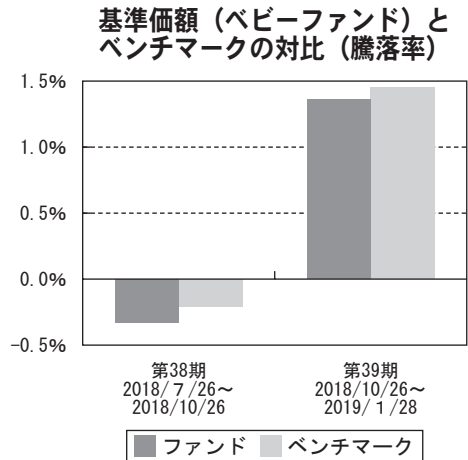
当該投資信託のベンチマークとの差異について (第38期～第39期：2018/7/27～2019/1/28)

**i** ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

＜三菱UFJ 国内債券インデックスファンド＞  
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

◎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。



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算していません。

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

ベンチマークは $1.2\%$ の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ポートフォリオ要因

(主なマイナス要因)

- ・取引コスト要因

## 分配金について

**i** 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

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38期	第39期
	2018年7月27日～2018年10月26日	2018年10月27日～2019年1月28日
当期分配金	30	30
（対基準価額比率）	0.289%	0.286%
当期の収益	13	22
当期の収益以外	16	7
翌期繰越分配対象額	804	797

（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。）

### ＜三菱UFJ 国内債券インデックスファンド＞

- ・ベンチマークに概ね連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額をマザーファンドに投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

### ＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

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

## ○1万口当たりの費用明細

(2018年7月27日～2019年1月28日)

項 目	第38期～第39期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	20	0.192	(a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率× (作成期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	( 9 )	(0.082)	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 ）	( 9 )	(0.082)	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 ）	( 3 )	(0.028)	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＝作成期中の売買委託手数料÷作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(c) その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	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	20	0.194	
作成期中の平均基準価額は、10,395円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2018年7月27日～2019年1月28日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第38期～第39期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 189,211	千円 262,118	千口 467,578	千円 648,353



## ○利害関係人との取引状況等

(2018年7月27日～2019年1月28日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ 国内債券インデックスファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

区 分	第38期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 34,270	百万円 8,295	% 24.2	百万円 36,974	百万円 7,205	% 19.5

平均保有割合 1.3%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

種 類	第38期～第39期		
	買 付 額	売 付 額	第39期末保有額
公社債	百万円 100	百万円 200	百万円 520

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

## &lt;三菱UFJ 国内債券マザーファンド&gt;

種 類	第38期～第39期
	買 付 額
公社債	百万円 1,200

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、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2019年1月28日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	第37期末	第39期末	
	口 数	口 数	評 価 額
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千口 2,232,325	千口 1,953,959	千円 2,740,037

## ○投資信託財産の構成

(2019年1月28日現在)

項 目	第39期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千円 2,740,037	% 99.5
コール・ローン等、その他	14,806	0.5
投資信託財産総額	2,754,843	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第38期末	第39期末
	2018年10月26日現在	2019年1月28日現在
(A) 資産	円 3,026,211,392	円 2,754,843,997
コール・ローン等	3,786,101	10,883,127
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	3,012,959,009	2,740,037,210
未収入金	9,466,282	3,923,660
(B) 負債	12,976,421	14,566,376
未払収益分配金	8,729,407	7,854,455
未払解約金	1,304,795	3,899,996
未払信託報酬	2,918,887	2,789,590
未払利息	8	20
その他未払費用	23,324	22,315
(C) 純資産総額(A-B)	3,013,234,971	2,740,277,621
元本	2,909,802,451	2,618,151,980
次期繰越損益金	103,432,520	122,125,641
(D) 受益権総口数	2,909,802,451口	2,618,151,980口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,355円	10,466円

## ○損益の状況

項 目	第38期		第39期	
	2018年7月27日～ 2018年10月26日		2018年10月27日～ 2019年1月28日	
	円		円	
(A) 配当等収益	△	1,183	△	2,619
受取利息		5		—
支払利息	△	1,188	△	2,619
(B) 有価証券売買損益	△	6,088,060		38,424,782
売買益		804,791		42,493,946
売買損	△	6,892,851	△	4,069,164
(C) 信託報酬等	△	2,942,211	△	2,812,144
(D) 当期損益金(A+B+C)	△	9,031,454		35,610,019
(E) 前期繰越損益金	△	59,169,856	△	63,241,590
(F) 追加信託差損益金		180,363,237		157,611,667
(配当等相当額)	(	229,955,900)	(	207,331,336)
(売買損益相当額)	(△	49,592,663)	(△	49,719,669)
(G) 計(D+E+F)		112,161,927		129,980,096
(H) 収益分配金	△	8,729,407	△	7,854,455
次期繰越損益金(G+H)		103,432,520		122,125,641
追加信託差損益金		180,363,237		157,611,667
(配当等相当額)	(	230,092,113)	(	207,479,308)
(売買損益相当額)	(△	49,728,876)	(△	49,867,641)
分配準備積立金		3,876,587		1,226,936
繰越損益金	△	80,807,304	△	36,712,962

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首(前作成期末)元本額 2,968,170,438円  
 作成期中追加設定元本額 451,820,643円  
 作成期中一部解約元本額 801,839,101円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0466円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2018年7月27日～ 2018年10月26日	2018年10月27日～ 2019年1月28日
費用控除後の配当等収益額	4,018,749円	5,894,606円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円
収益調整金額	230,092,113円	207,479,308円
分配準備積立金額	8,587,245円	3,186,785円
当ファンドの分配対象収益額	242,698,107円	216,560,699円
1万口当たり収益分配対象額	834円	827円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	8,729,407円	7,854,455円

## ○分配金のお知らせ

	第38期	第39期
1 万口当たり分配金 (税込み)	30円	30円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

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

◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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

## 【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。）の税率が適用されます。

## 三菱UFJ 国内債券マザーファンド

### 《第18期》決算日2018年5月21日

[計算期間：2017年5月23日～2018年5月21日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月21日に第18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18期の運用状況をご報告申し上げます。

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

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA—BPI総合		債組入比率	債先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2014年5月20日)	12,874	2.8	354.058	2.8	99.4	—	290,123
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—	256,631
16期(2016年5月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902
17期(2017年5月22日)	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3	212,031
18期(2018年5月21日)	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4	225,098

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

(注) 「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 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2017年5月22日	円 13,798	% —		% —	% 99.3	% 0.3
5月末	13,805	0.1	379.549	0.0	100.0	0.3
6月末	13,766	△0.2	378.570	△0.2	100.5	0.3
7月末	13,768	△0.2	378.545	△0.2	99.6	0.3
8月末	13,842	0.3	380.579	0.3	98.7	0.4
9月末	13,793	△0.0	379.266	△0.0	101.0	0.4
10月末	13,793	△0.0	379.268	△0.0	100.8	0.3
11月末	13,830	0.2	380.257	0.2	99.3	0.5
12月末	13,838	0.3	380.513	0.3	100.0	0.5
2018年1月末	13,816	0.1	379.850	0.1	99.9	0.5
2月末	13,869	0.5	381.295	0.5	98.0	0.5
3月末	13,891	0.7	381.911	0.7	98.1	0.3
4月末	13,880	0.6	381.638	0.6	100.8	0.4
(期 末) 2018年5月21日	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4

(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0.6%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%)とほぼ同程度となりました。

## 基準価額等の推移



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

## ●投資環境について

・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市場は上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の構成銘柄を種別や年限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0.6%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.0%程度	0.0%程度	0.0%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値とベンチマークとのカイ離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（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、0.0%程度となりました。

## ◎今後の運用方針

・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。

・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年5月23日～2018年5月21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、13,824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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	55,950,087	43,342,752
	地方債証券	1,364,262	1,151,780
	特殊債券	3,400,919	3,108,757 ( 357,028)
	社債券	3,313,236	2,250,343 ( 100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		5,878	5,579	—	—



## ○利害関係人との取引状況等

(2017年5月23日～2018年5月21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 64,028	百万円 15,771	24.6	百万円 49,853	百万円 10,636	21.3

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 821

## 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 1,300

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リース、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2018年5月21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	170,634,000 ( 100,000)	185,717,710 ( 100,142)	82.5 ( 0.0)	— (—)	53.5 ( —)	19.6 ( —)	9.3 ( 0.0)
地方債証券	11,777,720 ( 11,777,720)	12,569,753 ( 12,569,753)	5.6 ( 5.6)	— (—)	3.4 ( 3.4)	1.6 ( 1.6)	0.6 ( 0.6)
特殊債券 (除く金融債)	12,547,066 ( 12,547,066)	13,500,022 ( 13,500,022)	6.0 ( 6.0)	— (—)	4.1 ( 4.1)	1.4 ( 1.4)	0.4 ( 0.4)
金融債券	1,430,000 ( 1,430,000)	1,432,061 ( 1,432,061)	0.6 ( 0.6)	— (—)	— ( —)	0.4 ( 0.4)	0.3 ( 0.3)
普通社債券	9,821,000 ( 9,821,000)	10,141,299 ( 10,141,299)	4.5 ( 4.5)	— (—)	1.7 ( 1.7)	2.1 ( 2.1)	0.8 ( 0.8)
合 計	206,209,786 ( 35,675,786)	223,360,847 ( 37,743,279)	99.2 (16.8)	— (—)	62.8 ( 9.2)	25.0 ( 5.4)	11.5 ( 2.2)

(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378回利付国債 (2年)	0.1	650,000	651,787	2019/7/15
第380回利付国債 (2年)	0.1	1,200,000	1,203,792	2019/9/15
第381回利付国債 (2年)	0.1	400,000	401,344	2019/10/15
第383回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,104,136	2019/12/15
第384回利付国債 (2年)	0.1	850,000	853,374	2020/1/15
第385回利付国債 (2年)	0.1	300,000	301,251	2020/2/15
第386回利付国債 (2年)	0.1	550,000	552,398	2020/3/15
第387回利付国債 (2年)	0.1	1,300,000	1,305,928	2020/4/15
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,200,000	1,204,404	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	610,000	611,579	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	1,040,000	1,044,638	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	380,000	381,189	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	2,230,000	2,238,117	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,100,000	1,104,532	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	1,880,000	1,888,817	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	2,110,000	2,121,098	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	1,420,000	1,428,264	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	1,500,000	1,509,360	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	2,110,000	2,124,326	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	2,090,000	2,105,027	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	1,500,000	1,511,310	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	1,810,000	1,824,244	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	2,200,000	2,218,458	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	1,810,000	1,826,145	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	1,750,000	1,766,502	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	930,000	939,244	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	220,000	316,186	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	285,000	396,409	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	285,000	398,344	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	420,000	588,953	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	410,000	552,753	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	470,000	620,968	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	420,000	529,683	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	540,000	630,369	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	750,000	634,327	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	820,000	821,180	2057/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	630,986	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	691,315	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,220,000	1,245,058	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	720,000	733,824	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	1,080,000	1,104,548	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,120,000	1,151,382	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,155,000	1,185,249	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	690,000	710,568	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,580,000	1,620,511	2020/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,200,000	1,231,560	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	602,755	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	2,180,000	2,255,079	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	640,000	665,875	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	600,155	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	780,000	811,816	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	400,000	415,080	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	250,000	260,157	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	550,000	570,504	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	790,000	824,357	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	640,000	665,536	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	870,000	906,940	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	420,000	436,220	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	489,251	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,016,122	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,444,098	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	103,657	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	916,229	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,830,091	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,730,000	1,808,559	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,240,000	1,298,416	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	663,296	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,880,000	1,951,101	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,090,000	1,132,728	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,630,000	1,695,640	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,760,000	1,822,057	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	350,000	362,708	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	780,000	798,018	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,210,000	1,246,868	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,910,000	1,968,961	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,510,000	1,557,700	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,100,000	1,127,148	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,560,000	1,574,664	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,530,000	1,543,601	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,140,000	2,157,826	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,640,000	1,652,644	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	1,630,000	1,641,475	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	1,570,000	1,579,938	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	1,820,000	1,830,992	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	2,100,000	2,112,012	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,270,000	1,276,197	2028/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	156,214	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	214,662	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	238,412	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	167,070	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	226,310	2031/5/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
国債証券	%	千円	千円
第6回利付国債(30年)	2.4	170,000	219,301
第7回利付国債(30年)	2.3	225,000	288,537
第8回利付国債(30年)	1.8	160,000	194,710
第9回利付国債(30年)	1.4	90,000	104,486
第10回利付国債(30年)	1.1	263,000	294,120
第11回利付国債(30年)	1.7	100,000	120,632
第12回利付国債(30年)	2.1	205,000	259,845
第13回利付国債(30年)	2.0	390,000	489,048
第14回利付国債(30年)	2.4	380,000	500,574
第15回利付国債(30年)	2.5	440,000	587,584
第16回利付国債(30年)	2.5	345,000	461,727
第17回利付国債(30年)	2.4	350,000	463,893
第18回利付国債(30年)	2.3	360,000	471,931
第19回利付国債(30年)	2.3	290,000	380,828
第20回利付国債(30年)	2.5	260,000	350,768
第21回利付国債(30年)	2.3	250,000	329,102
第22回利付国債(30年)	2.5	285,000	385,556
第23回利付国債(30年)	2.5	140,000	189,889
第24回利付国債(30年)	2.5	230,000	312,225
第25回利付国債(30年)	2.3	205,000	271,426
第26回利付国債(30年)	2.4	430,000	577,541
第27回利付国債(30年)	2.5	400,000	545,832
第28回利付国債(30年)	2.5	415,000	568,309
第29回利付国債(30年)	2.4	480,000	650,112
第30回利付国債(30年)	2.3	565,000	756,834
第31回利付国債(30年)	2.2	525,000	695,021
第32回利付国債(30年)	2.3	610,000	822,036
第33回利付国債(30年)	2.0	753,000	971,113
第34回利付国債(30年)	2.2	675,000	901,793
第35回利付国債(30年)	2.0	750,000	972,855
第36回利付国債(30年)	2.0	700,000	909,986
第37回利付国債(30年)	1.9	700,000	896,063
第38回利付国債(30年)	1.8	515,000	649,239
第39回利付国債(30年)	1.9	500,000	641,690
第40回利付国債(30年)	1.8	370,000	466,603
第41回利付国債(30年)	1.7	350,000	433,457
第42回利付国債(30年)	1.7	450,000	557,572
第43回利付国債(30年)	1.7	530,000	657,025
第44回利付国債(30年)	1.7	450,000	558,742
第45回利付国債(30年)	1.5	520,000	620,880
第46回利付国債(30年)	1.5	630,000	752,327
第47回利付国債(30年)	1.6	650,000	792,187
第48回利付国債(30年)	1.4	710,000	830,692
第49回利付国債(30年)	1.4	600,000	701,958
第50回利付国債(30年)	0.8	560,000	571,043
第51回利付国債(30年)	0.3	590,000	525,973

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第52回利付国債 (30年)	0.5	630,000	592,502
第53回利付国債 (30年)	0.6	610,000	588,460
第54回利付国債 (30年)	0.8	400,000	406,184
第55回利付国債 (30年)	0.8	660,000	669,471
第56回利付国債 (30年)	0.8	620,000	628,202
第57回利付国債 (30年)	0.8	770,000	779,317
第58回利付国債 (30年)	0.8	400,000	404,380
第43回利付国債 (20年)	2.9	360,000	374,572
第44回利付国債 (20年)	2.5	710,000	744,200
第45回利付国債 (20年)	2.4	100,000	104,634
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	105,443
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	267,007
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	180,752
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	544,643
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	149,181
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	279,273
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	86,340
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	573,905
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	259,425
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	401,908
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	173,142
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	380,450
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	638,722
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	245,819
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	273,738
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	585,278
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	301,444
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	530,740
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	477,459
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	187,810
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	89,195
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	447,333
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	135,157
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	586,372
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	227,510
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	732,842
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	226,920
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	433,656
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	263,605
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	237,808
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	296,210
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	114,401
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	425,910
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	716,769
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	211,292
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	472,877

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85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	268,014	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	628,265	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	199,430	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	545,918	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	153,231	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	555,916	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	95,289	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	766,142	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	307,517	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	590,714	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	142,491	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	396,448	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	405,300	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	635,000	759,485	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	447,574	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	350,000	430,223	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	234,425	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	391,616	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	373,171	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	422,660	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	210,000	255,748	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	200,000	242,260	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	250,000	297,582	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	570,000	680,260	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	121,487	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	320,000	393,420	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	510,000	621,429	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	460,000	562,133	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	710,761	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	290,000	358,692	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	266,683	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	580,000	712,675	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	314,000	383,145	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	287,152	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	200,000	234,546	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	490,000	593,458	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	310,000	371,702	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	500,000	619,625	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	340,000	417,149	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	410,000	514,480	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	330,000	405,810	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	240,000	292,120	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	480,000	585,124	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	270,000	325,684	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	580,000	700,953	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	200,000	239,110	2031/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第132回利付国債 (20年)		1.7	490,000	586,789	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	380,000	460,081	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	410,000	497,260	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	263,692	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	260,000	308,146	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	260,000	312,122	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	270,000	316,764	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	250,000	296,707	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,058,006	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	930,000	1,118,910	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	120,000	146,166	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	540,000	642,848	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	470,000	552,809	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	990,000	1,194,256	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	850,000	1,025,924	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	620,000	739,970	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	670,000	789,688	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	800,000	943,640	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	880,000	1,024,320	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	850,000	963,220	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	900,000	1,019,133	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	920,000	1,056,592	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	910,000	1,029,655	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	980,000	1,075,697	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	840,000	835,128	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	1,040,000	995,696	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	930,000	936,286	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	920,000	940,433	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	850,000	882,283	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	890,000	906,287	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	840,000	853,297	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	930,000	943,215	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	710,000	705,541	2038/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,142	2018/11/15
小	計		170,634,000	185,717,710	
<b>地方債証券</b>					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	113,784	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	115,034	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	93,537	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (20年)		2.33	100,000	118,175	2026/9/18
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	130,605	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	118,834	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	117,638	2032/12/20
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	102,356	2020/3/19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	103,289	2021/9/17
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	208,006	2023/3/20



銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	103,507	2024/3/19
第749回東京都公募公債	0.436	100,000	102,445	2025/9/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,178	2027/6/18
第771回東京都公募公債	0.155	200,000	199,540	2027/9/17
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	112,775	2024/3/19
平成21年度第7回北海道公募公債	1.46	50,000	50,963	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	80,000	81,819	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	51,641	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	102,366	2024/12/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	99,524	2026/4/28
平成29年度第1回北海道公募公債	0.2	272,000	272,356	2027/4/28
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	138,601	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,423	2038/3/19
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	103,075	2023/3/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	121,299	2030/5/28
第332回大阪府公募公債	1.58	50,000	51,178	2019/11/27
第335回大阪府公募公債	1.48	30,000	30,768	2020/2/25
第336回大阪府公募公債	1.46	50,000	51,327	2020/3/30
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	25,690	2020/9/29
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,546	2020/11/27
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	51,841	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	72,440	2022/2/28
第404回大阪府公募公債	0.4	400,000	407,896	2026/1/28
第408回大阪府公募公債	0.072	118,000	117,267	2026/5/29
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	121,182	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	40,000	41,060	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債	1.31	45,900	47,564	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	68,381	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	65,723	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	110,639	2028/5/26
平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	40,000	40,956	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	51,675	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	103,170	2022/10/19
平成28年度第29回兵庫県公募公債	0.238	100,000	100,499	2027/2/19
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	110,895	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	118,118	2032/6/18
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,829	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	237,290	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債	1.44	50,000	50,839	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債	1.38	201,000	204,915	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	27,903	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	72,403	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	104,030	2022/3/29
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	200,000	201,530	2027/2/12
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	46,107	2020/9/24
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	266,450	2025/3/25

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円
平成27年度第5回広島県公募公債	0.41	200,000	204,254
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	121,182
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	119,579
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,243
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	41,383
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	103,928
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	51,840
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	82,767
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	82,955
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	82,892
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	82,963
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	83,185
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	55,399
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	82,410
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	140,000	140,905
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	43,170
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	55,947
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	204,572
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	51,029
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	20,497
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	102,559
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	20,716
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	103,511
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	72,619
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	310,275
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,905
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,434
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	621,756
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,374
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,318
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	205,098
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	102,322
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	96,424
平成21年度第1回浜松市公募公債	1.54	33,900	34,678
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	50,000	51,166
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	51,679
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	20,721
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	102,885
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	110,709
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	100,000	119,201
第9回名古屋市公募公債(30年)	2.095	90,000	115,021
第3回京都市公募公債(20年)	2.09	100,000	114,799
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	110,000	131,195
平成23年度第5回神戸市公募公債	1.025	100,000	103,393
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	114,557
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	250,000	286,435

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
第27回横浜市公募公債 (20年)		1.599	40,000	46,620	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債		1.05	50,000	51,187	2020/9/18
第7回川崎市公募公債 (20年)		2.08	100,000	119,731	2029/7/17
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	127,300	131,965	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	51,665	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	72,361	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	51,784	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債		1.29	60,000	61,954	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	149,170	153,052	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	168,227	2021/11/30
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	36,500	37,346	2019/11/29
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	51,294	2020/11/30
平成27年度第1回岡山県公募公債		0.395	189,000	192,808	2026/1/29
小	計		11,777,720	12,569,753	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	105,353	2021/2/26
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	105,498	2021/3/26
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	203,376	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	124,000	126,116	2019/7/31
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	241,846	2029/10/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	10,000	10,253	2020/2/28
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	221,000	227,139	2020/4/30
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	121,455	2030/4/30
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	129,998	2040/5/31
第114回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	119,314	2030/7/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	121,905	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	119,494	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,535	2021/6/30
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	126,883	2042/2/28
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	103,741	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	300,000	310,758	2022/10/31
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	207,982	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	31,189	2023/2/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	340,000	350,516	2023/5/31
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	103,655	2024/3/29
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	201,000	208,627	2024/5/31
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	103,746	2024/6/28
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	102,961	2024/11/29
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.44	400,000	411,008	2025/8/29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	103,506	2020/7/15
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	106,617	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券 (15年)		1.6	200,000	206,806	2020/6/22
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	200,000	203,266	2019/7/12
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	31,000	31,542	2019/9/13
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	200,000	203,470	2019/10/18
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,371	2021/2/15

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22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	20,747	2021/3/12
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	208,032	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	36,228	2022/3/14
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	39,497	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	104,395	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	103,778	2023/12/18
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.115	400,000	400,340	2027/1/19
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	125,395	2027/7/16
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	106,190	2021/4/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	93,356	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,444	2021/10/19
第5回政府保証新関西国際空港債券		0.145	100,000	100,262	2027/3/30
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	74,699	2021/3/15
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	35,410	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.99	100,000	149,946	2045/9/20
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	145,468	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	157,773	2047/3/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.37	100,000	121,234	2028/9/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.41	100,000	122,624	2029/4/20
第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.3	100,000	103,602	2021/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.773	100,000	118,283	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.94	100,000	104,326	2023/6/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	104,651	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	136,873	2034/3/24
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.22	100,000	121,578	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	112,151	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	112,441	2024/3/22
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.278	100,000	102,605	2020/6/26
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.132	100,000	121,799	2031/1/28
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.84	100,000	118,837	2031/12/26
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.68	100,000	116,948	2032/7/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	206,736	2023/1/27
第47回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.576	200,000	205,078	2023/4/28
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	80,303	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.1	100,000	108,329	2022/6/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	102,830	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)		2.26	100,000	114,866	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	103,935	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	200,000	201,114	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	33,976	35,705	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	36,536	38,649	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.85	19,604	19,713	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.82	29,086	30,229	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	44,865	46,556	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	15,603	16,484	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	47,163	49,808	2037/5/10

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8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	18,994	20,004	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	33,714	34,215	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	12,159	12,378	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券		0.92	13,119	13,271	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	20,173	21,374	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	45,452	46,958	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	46,094	47,710	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	23,244	23,971	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	14,450	14,943	2039/6/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.6	100,000	123,549	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	34,730	37,272	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	16,957	17,580	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	35,222	37,635	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	18,326	19,032	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	76,276	80,880	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	75,102	79,352	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	34,128	35,591	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	42,994	44,941	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	33,612	35,563	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	33,630	35,665	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	145,803	155,586	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	82,812	88,118	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	77,812	83,076	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	38,153	40,512	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	38,742	41,001	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	41,958	44,436	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	37,366	39,724	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	44,867	47,323	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	46,819	49,350	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	51,011	53,773	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	52,254	55,105	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	54,651	57,380	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	105,602	110,528	2047/6/10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.358	100,000	103,447	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	175,176	182,479	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	61,511	63,937	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	124,142	128,863	2049/5/10
第86回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.046	100,000	103,358	2021/9/17
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	119,061	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	135,708	139,902	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	81,807	83,785	2050/5/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	200,000	239,304	2032/4/16
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	96,826	97,326	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	98,487	98,635	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	99,020	99,605	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	99,479	99,750	2053/3/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	99,851	99,920	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	100,000	99,980	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	100,172	2053/6/10
第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.075	100,000	99,006	2026/10/20
第17回国際協力機構債券(財投機関債)	0.72	30,000	30,901	2022/12/26
第21回西日本高速道路	0.754	100,000	103,372	2023/12/20
第25回西日本高速道路	0.524	100,000	102,304	2024/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	102,915	2021/9/17
小 計		12,547,066	13,500,022	
<b>金融債券</b>				
い第775号商工債券	0.2	100,000	100,159	2019/12/27
い第769号農林債券	0.3	130,000	130,362	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,296	2019/11/27
い第778号農林債券	0.25	300,000	301,134	2020/3/27
第310回信金中金債	0.225	200,000	200,730	2020/9/25
第318回信金中金債	0.04	300,000	299,772	2021/5/27
第321回信金中金債	0.03	200,000	199,608	2021/8/27
第337回信金中金債	0.11	100,000	100,000	2022/12/27
小 計		1,430,000	1,432,061	
<b>普通社債券</b>				
第548回東京電力	2.347	100,000	115,908	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	142,408	2019/10/29
第499回中部電力	1.194	50,000	52,530	2023/6/23
第518回中部電力	0.19	200,000	200,000	2023/1/25
第510回関西電力	0.49	100,000	100,529	2027/7/23
第383回中国電力	0.764	100,000	103,089	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,173	2026/11/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,439	2020/10/23
第494回東北電力	0.425	200,000	200,438	2027/6/25
第400回九州電力	1.777	70,000	72,311	2020/4/24
第427回九州電力	1.024	100,000	104,277	2024/5/24
第316回北海道電力	1.164	100,000	102,224	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,618	2019/9/25
第26回関西国際空港	1.156	100,000	102,585	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	103,359	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,727	2021/6/18
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	99,852	2024/9/13
第11回アサヒグループホールディングス	0.23	100,000	100,067	2024/6/13
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,626	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	100,000	100,005	2023/3/8
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	202,142	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,095	2024/7/19
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,209	2022/12/2
第4回富士フイルムホールディングス	0.005	200,000	199,664	2020/3/3
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,147	2027/5/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	103,225	2021/9/17

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第5回日本電産	0.001	100,000	99,867
第15回パナソニック	0.19	100,000	100,152
第12回デンソー	0.01	100,000	99,652
第34回三菱重工	0.104	200,000	199,524
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,352
第7回JA三井リース	0.2	100,000	99,791
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,111
第78回三菱商事	1.155	100,000	103,645
第79回三菱商事	1.022	100,000	103,285
第67回クレディセゾン	0.06	100,000	99,944
第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.5	200,000	204,926
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	104,785
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	117,866
第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	100,000	103,438
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	104,248
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	102,957
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	105,329
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	102,448
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	102,971
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	103,708
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	113,597
第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	105,418
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	99,743
第22回東京センチュリーリース	0.06	100,000	99,959
第38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,595
第77回トヨタファイナンス	0.145	100,000	99,881
第29回リコーリース	0.08	100,000	100,016
第30回リコーリース	0.16	100,000	100,040
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,668
第62回日立キャピタル	0.001	200,000	199,672
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,821
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	199,218
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	103,526
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	113,746
第58回三井不動産	0.1	100,000	99,958
第72回三菱地所	2.28	100,000	112,701
第80回三菱地所	2.305	100,000	117,159
第125回三菱地所	0.19	100,000	99,706
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,094
第36回京王電鉄	0.325	100,000	99,883
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	21,185
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	108,563
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	112,351
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	114,454
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	124,636
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	108,430

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6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	22,808	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	121,478	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,093	2030/10/25
第16回三菱倉庫	0.21	100,000	99,814	2024/12/6
第63回日本電信電話	0.69	200,000	204,884	2023/3/20
第21回KDDI	0.669	100,000	101,953	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,776	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	111,730	2024/12/20
第38回電源開発	0.978	100,000	103,958	2023/12/20
第4回東京電力パワーグリッド	0.69	100,000	101,009	2024/6/20
第12回東京電力パワーグリッド	0.44	100,000	100,150	2023/4/19
第23回東京ガス	1.01	100,000	104,495	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,918	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	101,323	2021/10/15
第20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	100,077	2018/5/29
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,207	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,248	2019/5/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,261	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,449	2020/5/22
小 計		9,821,000	10,141,299	
合 計		206,209,786	223,360,847	

## 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 904	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 223,360,847	% 99.1
コール・ローン等、その他	1,975,832	0.9
投資信託財産総額	225,336,679	100.0



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	225,336,610,215
コール・ローン等	1,408,599,050
公社債(評価額)	223,360,847,799
未収利息	557,008,760
前払費用	7,464,606
差入委託証拠金	2,690,000
(B) 負債	238,106,324
未払金	100,116,480
未払解約金	137,987,227
未払利息	2,617
(C) 純資産総額(A-B)	225,098,503,891
元本	162,212,782,817
次期繰越損益金	62,885,721,074
(D) 受益権総口数	162,212,782,817口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,877円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 153,669,783,979円  
 期中追加設定元本額 33,283,504,571円  
 期中一部解約元本額 24,740,505,733円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3877円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	4,100,004,841円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	5,011,145,536円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,272,332,051円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	35,114,657,345円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	54,955,337,241円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	13,921,053,817円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	212,238,947円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	151,515,236円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,263,515,443円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	3,591,141,401円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	15,855,339,589円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	4,933,717円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	3,276,168円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,327,190円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	25,754,846,955円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	117,340円
合計	162,212,782,817円

## 【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)  
 (2018年1月1日)

## ○損益の状況 (2017年5月23日~2018年5月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,160,966,940
受取利息	2,161,819,944
支払利息	△ 853,004
(B) 有価証券売買損益	△ 878,696,444
売買益	482,999,168
売買損	△ 1,361,695,612
(C) 先物取引等取引損益	3,097,920
取引益	7,373,560
取引損	△ 4,275,640
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,285,368,416
(E) 前期繰越損益金	58,362,185,666
(F) 追加信託差損益金	12,723,710,902
(G) 解約差損益金	△ 9,485,543,910
(H) 計(D+E+F+G)	62,885,721,074
次期繰越損益金(H)	62,885,721,074

(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。