

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44期（決算日：2020年4月27日）

第45期（決算日：2020年7月27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7月27日に第45期の決算を行いましたので、法令に基づいて第44期～第45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 総額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円
36期(2018年4月26日)	10,475		30		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
40期(2019年4月26日)	10,492		30	0.5	387.94	0.6	100.8	0.2	2,751
41期(2019年7月26日)	10,588		30	1.2	392.93	1.3	99.6	0.1	2,792
42期(2019年10月28日)	10,525		30	△0.3	392.10	△0.2	99.7	0.2	3,011
43期(2020年1月27日)	10,466		30	△0.3	391.37	△0.2	99.6	0.2	3,312
44期(2020年4月27日)	10,378		30	△0.6	389.59	△0.5	99.6	0.2	3,206
45期(2020年7月27日)	10,272		30	△0.7	387.08	△0.6	99.6	0.2	3,393

(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
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
第44期	(期 首) 2020年1月27日	円 10,466	% —	391.37	% —	% 99.6	% 0.2
	1月末	10,476	0.1	391.77	0.1	98.7	0.2
	2月末	10,554	0.8	394.74	0.9	97.4	0.2
	3月末	10,380	△0.8	388.45	△0.7	97.2	0.2
	(期 末) 2020年4月27日	10,408	△0.6	389.59	△0.5	99.6	0.2
第45期	(期 首) 2020年4月27日	10,378	—	389.59	—	99.6	0.2
	4月末	10,383	0.0	389.79	0.1	100.9	0.2
	5月末	10,334	△0.4	388.13	△0.4	102.0	0.2
	6月末	10,290	△0.8	386.56	△0.8	99.7	0.2
	(期 末) 2020年7月27日	10,302	△0.7	387.08	△0.6	99.6	0.2

(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

第44期～第45期：2020年1月28日～2020年7月27日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第44期首	10,466円
第45期末	10,272円
既払分配金	60円
騰落率	-1.3%

(分配金再投資ベース)

※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はありません。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、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

基準価額は当作成期首に比べ1.3%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-1.1%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

ベンチマークに概ね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44期～第45期：2020年1月28日～2020年7月27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、作成期の前半に新型コロナウイルスによる景気後退懸念などから上昇する局面もありましたが、財政拡張による国債増発懸念などからすぐに下落に転じました。その後はもみ合いで推移しましたが、作成期を通して見ると下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド

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（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。

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

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。

第44期～第45期：2020/1/28～2020/7/27

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ▶ **三菱UFJ 国内債券インデックスファンド**
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 0.0% 程度でした。

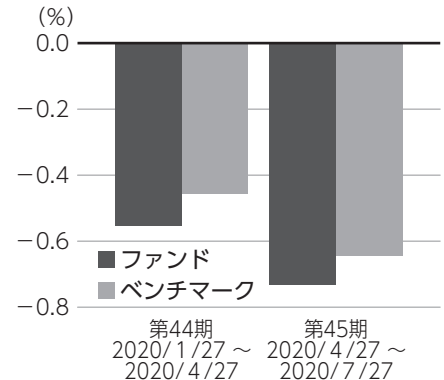
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：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。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



^{*}ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

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44期	第45期
	2020年1月28日～2020年4月27日	2020年4月28日～2020年7月27日
当期分配金（対基準価額比率）	30 (0.288%)	30 (0.291%)
当期の収益	11	10
当期の収益以外	19	20
翌期繰越分配対象額	737	718

(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**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **三菱UFJ 国内債券マザーファンド**
ベンチマークの動きに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

2020年1月28日～2020年7月27日

1万口当たりの費用明細

項目	第44期～第45期		項目の概要
	金額 (円)	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)	(0.027)	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
合 計	20	0.194	

作成期中の平均基準価額は、10,378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。

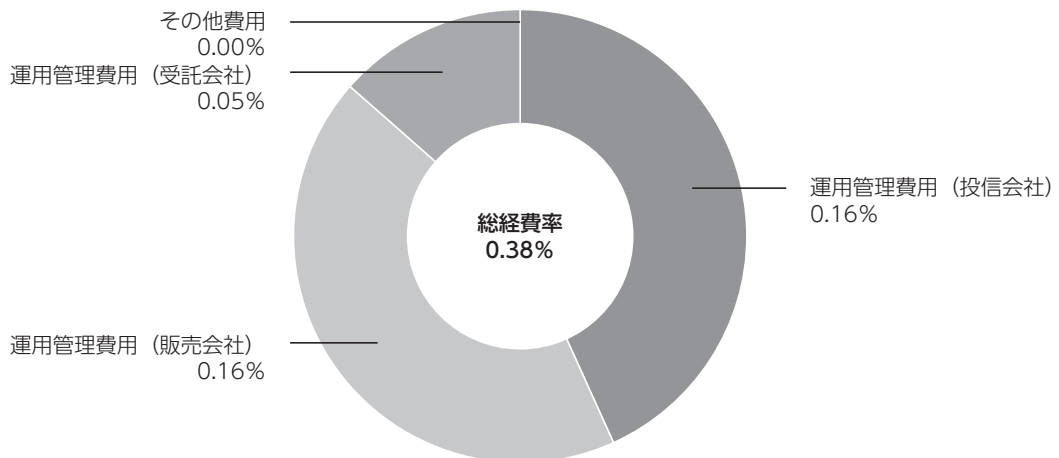
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.38%**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

(2020年1月28日～2020年7月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第44期～第45期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	275,306	389,129	192,113	272,525

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2020年7月27日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 国内債券インデックスファンド>

該当事項はございません。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

区 分	第44期～第45期					
	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	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 46,334	百万円 16,502	35.6	百万円 48,872	百万円 21,514	44.0

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

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種 類	第44期～第45期		
	買 付 額	売 付 額	第45期末保有額
公社債	百万円 400	百万円 201	百万円 1,112

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種 類	第44期～第45期	
	買 付	額
公社債		百万円 2,800

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UFJリース、アコム、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年7月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第43期末	第45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 2,326,554	千口 2,409,748	千円 3,393,407

○投資信託財産の構成

(2020年7月27日現在)

項 目	第45期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千円 3,393,407	% 99.5
コール・ローン等、その他	16,796	0.5
投資信託財産総額	3,410,203	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第44期末	第45期末
	2020年4月27日現在	2020年7月27日現在
	円	円
(A) 資産	3,233,328,947	3,410,203,981
コール・ローン等	13,555,208	9,919,126
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	3,205,897,680	3,393,407,147
未収入金	13,876,059	6,877,708
(B) 負債	27,093,733	16,495,579
未払収益分配金	9,268,450	9,911,488
未払解約金	14,662,766	3,411,935
未払信託報酬	3,137,430	3,147,001
未払利息	17	9
その他未払費用	25,070	25,146
(C) 純資産総額(A-B)	3,206,235,214	3,393,708,402
元本	3,089,483,615	3,303,829,412
次期繰越損益金	116,751,599	89,878,990
(D) 受益権総口数	3,089,483,615口	3,303,829,412口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,378円	10,272円

○損益の状況

項 目	第44期		第45期	
	2020年1月28日～ 2020年4月27日		2020年4月28日～ 2020年7月27日	
	円		円	
(A) 配当等収益	△	868	△	627
受取利息		19		17
支払利息	△	887	△	644
(B) 有価証券売買損益	△	14,349,615	△	19,845,387
売買益		1,345,078		562,749
売買損	△	15,694,693	△	20,408,136
(C) 信託報酬等	△	3,162,500	△	3,172,147
(D) 当期損益金(A+B+C)	△	17,512,983	△	23,018,161
(E) 前期繰越損益金	△	22,118,349	△	41,549,191
(F) 追加信託差損益金		165,651,381		164,357,830
(配当等相当額)	(233,596,888)	(243,647,257)
(売買損益相当額)	(△	67,945,507)	(△	79,289,427)
(G) 計(D+E+F)		126,020,049		99,790,478
(H) 収益分配金	△	9,268,450	△	9,911,488
次期繰越損益金(G+H)		116,751,599		89,878,990
追加信託差損益金		159,781,362		157,750,171
(配当等相当額)	(227,834,161)	(237,200,874)
(売買損益相当額)	(△	68,052,799)	(△	79,450,703)
分配準備積立金		58,590		216,437
繰越損益金	△	43,088,353	△	68,087,618

(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。

<注記事項>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 3,165,199,888円
 作成期中追加設定元本額 573,107,609円
 作成期中一部解約元本額 434,478,085円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0272円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年1月28日～ 2020年4月27日	2020年4月28日～ 2020年7月27日
費用控除後の配当等収益額	3,421,039円	3,463,690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	233,704,180円	243,808,533円
分配準備積立金額	35,982円	56,576円
当ファンドの分配対象収益額	237,161,201円	247,328,799円
1万口当たり収益分配対象額	767円	748円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	9,268,450円	9,911,488円

○分配金のお知らせ

	第44期	第45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。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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、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。

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月20日に第20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20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
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
19期(2019年5月20日)	14,116	1.7	388.062	1.7	99.3	0.2	239,103
20期(2020年5月20日)	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2	242,398

(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。

○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) 2019年5月20日	円	%		%	%	%
	14,116	—	388.062	—	99.3	0.2
5月末	14,200	0.6	390.322	0.6	97.4	0.2
6月末	14,286	1.2	392.695	1.2	100.4	0.1
7月末	14,302	1.3	393.155	1.3	100.3	0.1
8月末	14,495	2.7	398.496	2.7	97.2	0.2
9月末	14,342	1.6	394.271	1.6	101.9	0.2
10月末	14,284	1.2	392.608	1.2	101.2	0.2
11月末	14,234	0.8	391.325	0.8	100.6	0.2
12月末	14,190	0.5	390.136	0.5	100.6	0.2
2020年1月末	14,251	1.0	391.771	1.0	98.7	0.2
2月末	14,362	1.7	394.745	1.7	97.4	0.2
3月末	14,130	0.1	388.450	0.1	97.2	0.2
4月末	14,179	0.4	389.790	0.4	100.9	0.2
(期 末) 2020年5月20日	円	%		%	%	%
	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2

(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

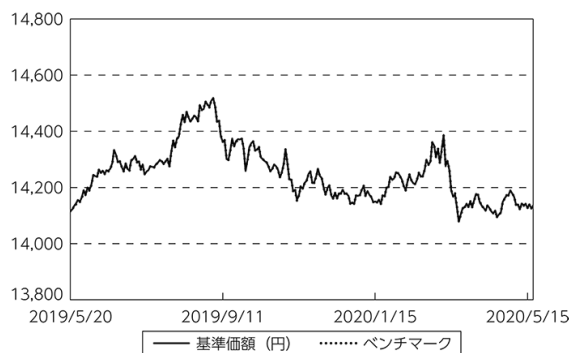
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%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(0.1%)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。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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**

- ・国内債券市況は上昇しました。
- ・期の前半は、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国内債券市況は上昇しましたが、その後下落しました。また、期の後半は、新型肺炎による景気後退懸念などから上昇後、すぐに財政拡張による国債増発懸念などから下落しましたが、期を通して見ると国内債券市況は上昇しました。

● 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0.1%の上昇となったため、乖離は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によるものです。
主なマイナス要因：取引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

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,250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

(2019年5月21日～2020年5月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 67,966,209	千円 63,390,384
	地方債証券	4,812,010	5,403,873
	特殊債券	6,586,648	5,105,895
	社債券	5,118,093	(294,070)
			4,789,017 (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 2,006	百万円 2,004	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 84,482	百万円 23,379	% 27.7	百万円 78,689	百万円 27,600	% 35.1

(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 703	百万円 302	百万円 1,209

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 2,200

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、三菱UFJリース、アコム、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	183,704,000	200,679,370	82.8	—	56.9	17.8	8.0
地方債証券	10,936,350	11,612,991	4.8	—	2.6	1.3	0.9
	(10,936,350)	(11,612,991)	(4.8)	(—)	(2.6)	(1.3)	(0.9)
特殊債券 (除く金融債)	13,677,761	14,517,823	6.0	—	3.8	1.6	0.6
	(13,677,761)	(14,517,823)	(6.0)	(—)	(3.8)	(1.6)	(0.6)
金融債券	1,400,000	1,400,135	0.6	—	—	0.4	0.2
	(1,400,000)	(1,400,135)	(0.6)	(—)	(—)	(0.4)	(0.2)
普通社債券	12,771,000	12,912,480	5.3	—	1.7	3.1	0.5
	(12,771,000)	(12,912,480)	(5.3)	(—)	(1.7)	(3.1)	(0.5)
合 計	222,489,111	241,122,801	99.5	—	65.0	24.3	10.2
	(38,785,111)	(40,443,430)	(16.7)	(—)	(8.1)	(6.4)	(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401回利付国債(2年)	0.1	970,000	972,793	2021/6/1
第402回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,936	2021/7/1
第403回利付国債(2年)	0.1	500,000	501,675	2021/8/1
第404回利付国債(2年)	0.1	950,000	953,410	2021/9/1
第405回利付国債(2年)	0.1	450,000	451,845	2021/10/1
第406回利付国債(2年)	0.1	800,000	803,312	2021/11/1
第407回利付国債(2年)	0.1	480,000	482,064	2021/12/1
第408回利付国債(2年)	0.1	200,000	200,890	2022/1/1
第411回利付国債(2年)	0.1	1,170,000	1,176,013	2022/4/1
第128回利付国債(5年)	0.1	2,310,000	2,316,999	2021/6/20
第129回利付国債(5年)	0.1	2,350,000	2,358,624	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	1,030,000	1,034,408	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	1,810,000	1,818,959	2022/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	2,170,000	2,182,455	2022/6/20
第133回利付国債(5年)	0.1	980,000	986,311	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	1,920,000	1,933,689	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	900,000	906,903	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	460,000	463,845	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	1,860,000	1,876,200	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	3,800,000	3,834,884	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	200,000	201,926	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	3,180,000	3,211,990	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	1,270,000	1,283,004	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	550,000	555,830	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	980,000	990,711	2025/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	220,000	331,848	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	415,000	610,456	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	285,000	423,407	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	470,000	705,089	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	480,000	698,817	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	490,000	704,311	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	470,000	651,091	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	540,000	700,795	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	790,000	770,676	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	900,000	1,027,953	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	640,000	710,112	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	740,000	744,839	2059/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	780,000	791,622	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	400,000	405,528	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	250,000	254,262	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	550,000	558,640	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	790,000	805,989	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	640,000	651,936	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	870,000	888,678	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	420,000	428,248	2022/3/20

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323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	480,556	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	999,962	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,421,761	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	102,257	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	902,149	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,808,745	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,530,000	1,575,731	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,450,000	1,496,661	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	656,300	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,725,696	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	700,000	720,223	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,160,000	1,195,484	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,520,000	1,562,408	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	185,270	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	980,000	999,423	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,350,000	1,384,776	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	2,160,000	2,218,557	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,420,000	2,488,873	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,450,000	1,485,061	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,130,000	2,158,137	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,430,000	1,449,705	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	1,810,000	1,835,991	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,714,657	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	1,390,000	1,410,572	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	2,770,000	2,812,519	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	1,600,000	1,624,832	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,140,000	1,157,863	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,860,000	1,888,606	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,090,000	1,106,404	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,680,000	2,719,315	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,530,000	2,564,914	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	1,600,000	1,620,560	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	1,650,000	1,670,295	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	2,540,000	2,569,692	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	1,500,000	1,515,825	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	1,190,000	1,201,697	2030/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	151,574	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	209,895	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	233,453	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	162,555	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	222,325	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	215,192	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	284,017	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	193,358	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	104,345	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	295,377	2033/3/20

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11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	120,195	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	257,762	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	486,369	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	495,508	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	440,000	581,394	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	345,000	457,483	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	350,000	460,414	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	360,000	469,562	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	290,000	379,436	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	260,000	348,969	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	250,000	328,842	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	285,000	384,695	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	140,000	189,579	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	230,000	312,192	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	205,000	272,350	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	430,000	579,777	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	400,000	549,072	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	415,000	572,915	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	480,000	658,032	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	625,000	850,818	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	725,000	979,409	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	570,000	784,838	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	623,000	825,973	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	765,000	1,048,929	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	790,000	1,056,103	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	790,000	1,060,804	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	820,000	1,087,787	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	605,000	792,132	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	560,000	746,967	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	450,000	591,394	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	250,000	323,525	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	570,000	738,440	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	560,000	727,098	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	620,000	805,882	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	550,000	690,046	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	680,000	853,767	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	650,000	832,546	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	600,000	740,574	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	770,000	950,911	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	770,000	839,153	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	480,000	464,275	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	570,000	578,749	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	610,000	634,735	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	400,000	436,124	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	700,000	762,825	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	620,000	676,103	2047/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第57回利付国債 (30年)	0.8	580,000	632,136	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	780,000	850,675	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	310,000	330,143	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	1,000,000	1,118,700	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	660,000	703,566	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	190,000	192,422	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	380,000	374,148	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	1,280,000	1,260,147	2049/9/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	380,000	374,018	2050/3/20
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	143,325	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	267,943	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	82,883	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	549,943	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	249,573	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	386,816	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	166,937	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	367,020	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	618,709	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	239,400	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	268,650	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	576,738	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	291,739	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	513,057	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	461,759	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	181,942	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	86,300	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	430,672	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	130,375	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	563,182	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	219,214	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	707,848	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	219,642	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	419,071	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	254,867	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	230,664	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	286,847	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	110,868	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	412,106	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	694,077	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	204,768	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	458,986	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	260,054	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	607,762	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	193,211	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	528,204	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	148,478	2026/6/20

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90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	539,597	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	92,356	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	745,504	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	299,540	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	574,289	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	138,928	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	386,218	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	395,409	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	635,000	741,749	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	436,814	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	350,000	418,722	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	228,330	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	381,952	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	364,972	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	413,668	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	210,000	249,960	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	240,000	284,604	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	584,300	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	60,000	70,314	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	280,000	333,096	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	450,000	541,386	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	610,000	728,321	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	360,000	431,571	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	697,392	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	290,000	351,477	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	261,495	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	510,000	615,279	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	444,000	532,990	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	283,267	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	520,000	603,272	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	690,000	823,777	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	500,000	608,870	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	340,000	410,444	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	810,000	998,122	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	330,000	399,531	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	90,000	107,992	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	440,000	529,416	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	580,000	693,221	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	497,259	2031/9/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,030,000	1,234,032	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	890,000	1,068,765	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	59,457	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	60,000	70,646	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	620,000	738,860	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	130,000	151,816	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	117,977	2032/6/20

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140回利付国債 (20年)	1.7	480,000	573,220	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	820,000	981,818	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	480,000	580,680	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,380,000	1,638,060	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	240,000	281,848	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,320,000	1,586,574	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	900,000	1,083,780	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	720,000	858,974	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	760,000	897,795	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,190,000	1,407,662	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,210,000	1,416,268	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	330,000	377,295	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	930,000	1,063,938	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,240,000	1,438,635	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,100,000	1,260,842	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	810,000	904,510	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	960,000	982,675	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	840,000	832,860	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	750,000	778,200	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	1,020,000	1,074,274	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	910,000	972,990	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	820,000	862,771	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,210,000	1,272,956	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	880,000	925,636	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,010,000	1,044,178	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,360,000	1,405,437	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	480,000	512,918	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	1,000,000	1,032,470	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	590,000	598,378	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	770,000	766,535	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	1,020,000	1,014,430	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	370,000	367,957	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	320,000	324,166	2040/3/20
小 計		183,704,000	200,679,370	
地方債証券				
第5回東京都公募公債 (20年)	2.11	100,000	110,032	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	111,166	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	70,000	95,777	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (20年)	2.33	100,000	114,174	2026/9/18
第10回東京都公募公債 (30年)	2.31	100,000	135,207	2039/9/20
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	101,315	2021/9/17
第710回東京都公募公債	0.81	100,000	101,625	2022/6/20
第719回東京都公募公債	0.86	200,000	204,726	2023/3/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	102,425	2024/3/19
第3回東京都公募公債 (20年)	2.26	100,000	108,531	2024/3/19
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	50,911	2022/10/31

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26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	101,887	2024/12/26
平成29年度第13回北海道公募公債	0.21	108,000	108,773	2027/12/28
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	138,890	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	137,738	2038/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,633	2027/6/18
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	119,609	2030/5/28
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	50,550	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	71,155	2022/2/28
第419回大阪府公募公債	0.196	200,000	201,392	2027/4/27
第423回大阪府公募公債	0.185	130,000	130,750	2027/8/30
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,851	2028/8/30
第451回大阪府公募公債	0.063	140,000	138,793	2029/12/26
平成21年度第3回京都市公募公債(20年)	2.19	100,000	119,058	2029/9/20
平成23年度第2回京都市公募公債	1.2	66,000	66,841	2021/6/22
平成26年度第5回京都市公募公債(20年)	1.455	100,000	115,602	2034/8/10
平成29年度第4回京都市公募公債	0.19	100,000	100,704	2027/6/21
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	68,351	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債(12年)	0.73	200,000	207,844	2026/8/6
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	50,767	2022/1/27
第27回兵庫県公募公債(20年)	0.387	200,000	200,064	2036/5/12
平成28年度第3回兵庫県公募公債	0.08	100,000	99,910	2026/5/22
平成29年度第1回兵庫県公募公債	0.187	200,000	201,278	2027/5/21
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	109,449	2027/10/29
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	102,572	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,483	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	232,932	2028/12/20
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	71,007	2021/10/28
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	200,000	218,696	2026/11/13
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	101,952	2022/3/29
平成24年度第8回愛知県公募公債	0.835	200,000	203,680	2022/8/29
平成28年度第13回愛知県公募公債	0.13	100,000	100,324	2026/11/30
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	265,408	2025/3/25
平成27年度第5回広島県公募公債	0.41	200,000	203,966	2026/1/26
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	202,596	2028/11/22
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	119,058	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,107	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債(20年)	1.546	200,000	233,428	2034/5/8
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	40,384	2021/2/25
平成23年度第6回埼玉県公募公債	1.02	100,000	101,422	2021/10/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	50,511	2021/2/25
平成24年度第6回福岡県公募公債	0.8	100,000	101,884	2022/10/25
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	80,769	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	80,880	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	81,248	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	81,431	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	81,574	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27年度第3回千葉県公募公債		0.524	200,000	204,716	2025/6/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債		0.06	100,000	99,871	2026/10/30
第96回共同発行市場公募地方債		1.29	20,000	20,213	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	600,000	609,096	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債		1.01	70,000	71,264	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	305,850	2022/11/25
第125回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	102,583	2023/8/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	102,687	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	102,420	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	205,174	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	204,286	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,944	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	204,258	2025/3/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	20,000	20,211	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	102,282	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債(20年)		1.99	100,000	107,021	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債(20年)		2.07	100,000	116,721	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債(30年)		2.095	90,000	120,292	2042/9/19
第3回京都市公募公債(20年)		2.09	100,000	111,296	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	110,000	126,377	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	101,408	2021/10/19
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	110,696	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	250,000	277,822	2025/12/19
第11回横浜市公募公債(20年)		2.2	200,000	227,756	2026/12/18
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	40,000	46,675	2033/5/20
第35回横浜市公募公債(20年)		0.443	200,000	201,640	2036/10/28
第7回川崎市公募公債(20年)		2.08	100,000	117,756	2029/7/17
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	50,698	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	71,327	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	50,607	2021/5/31
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	165,012	2021/11/30
平成28年度第1回岡山県公募公債		0.18	140,000	140,931	2027/1/29
小	計		10,936,350	11,612,991	
特殊債券(除く金融債)					
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	134,668	2040/5/31
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	126,752	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	118,343	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	14,194	2021/6/30
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	200,000	202,748	2021/7/30
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	131,398	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	101,881	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	100,000	101,937	2022/10/31
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	30,679	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	346,232	2023/5/31
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	208,000	213,162	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	100,000	102,468	2024/3/29

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215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	100,000	102,619	2024/4/30
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	102,624	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	102,219	2024/11/29
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	100,000	102,123	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	204,328	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.509	133,000	136,265	2025/5/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	101,000	103,392	2025/6/30
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	100,000	101,707	2026/1/30
第269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	100,721	2026/2/27
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	108,000	108,683	2028/4/28
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	102,380	2021/6/28
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.576	110,000	110,928	2021/9/24
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,101	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	20,218	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	124,500	126,347	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	203,610	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	35,604	2022/3/14
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.819	100,000	101,912	2022/9/16
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	200,000	203,780	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	38,850	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.541	100,000	101,580	2023/4/21
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	102,694	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	305,000	312,512	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.645	100,000	102,444	2024/3/15
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	500,000	500,000	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	102,000	2026/4/17
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	126,070	2027/7/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	92,136	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,212	2021/10/19
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	106,441	2025/6/13
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債		0.001	200,000	200,202	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	100,000	101,883	2023/3/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	72,796	2021/3/15
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	99,347	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	34,431	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	156,156	2045/9/20
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	140,000	159,254	2026/3/19
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	153,007	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.28	350,000	402,143	2027/4/20
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	166,426	2047/3/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	133,294	2033/12/20
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	118,356	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	102,836	2023/6/20
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	200,000	222,264	2035/3/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	102,879	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	135,319	2034/3/24

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	119,726	2030/1/28
第7回	回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	108,340	2024/3/22
第8回	回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	108,532	2024/3/22
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	120,542	2031/1/28
第24回	回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	117,049	2028/4/25
第27回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	101,301	2021/8/27
第44回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	204,174	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	203,266	2023/4/28
第104回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.255	200,000	202,058	2028/1/28
F131回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	80,315	2031/7/30
F151回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	100,000	109,083	2027/11/5
F197回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.052	100,000	106,955	2027/10/29
F203回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.063	100,000	107,266	2028/2/28
F438回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.123	200,000	200,500	2026/3/27
第1回	回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	104,335	2022/6/20
第29回	福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	101,799	2021/12/20
第4回	回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	202,074	2027/2/22
第1回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	25,890	26,694	2042/5/10
第2回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	28,654	29,976	2042/6/10
第3回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	22,730	23,140	2036/5/10
第5回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	35,592	36,258	2036/11/10
第6回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	12,279	12,658	2037/5/10
第7回	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	36,981	38,109	2037/5/10
第8回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	14,532	15,122	2042/12/10
第11回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	10,482	10,532	2038/6/10
第13回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,251	15,961	2043/5/10
第16回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	29,346	29,916	2032/11/10
第17回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	29,466	30,052	2032/11/10
第18回	回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	14,834	15,117	2032/11/10
第19回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	11,566	11,776	2039/6/10
第29回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	27,450	29,553	2044/10/10
第31回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	12,893	13,227	2040/6/10
第31回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	28,216	30,306	2044/12/10
第32回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	14,048	14,488	2040/7/10
第36回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	57,400	60,884	2045/5/10
第37回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	57,902	61,281	2045/6/10
第39回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	26,480	27,398	2041/2/10
第40回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	32,933	34,512	2045/9/10
第42回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	26,088	27,262	2041/5/10
第44回	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	26,282	27,370	2041/7/10
第44回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	111,690	119,372	2046/1/10
第45回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	62,852	66,926	2046/2/10
第48回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	59,490	63,333	2046/5/10
第49回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	29,589	31,417	2046/6/10
第50回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,400	32,205	2046/7/10
第51回	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,786	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公庫債券		2.18	29,290	30,857	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	35,499	37,534	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	37,087	39,216	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	41,066	43,481	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	42,090	44,568	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	43,829	46,254	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	84,906	89,286	2047/6/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	142,215	148,870	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	50,368	52,572	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	98,886	103,069	2049/5/10
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	118,559	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	112,790	116,832	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	69,531	71,596	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	238,660	2032/4/16
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	245,856	247,707	2051/6/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	171,806	174,245	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	172,020	174,588	2052/3/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	87,888	89,032	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	89,957	90,848	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,492	91,760	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	90,657	91,705	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,139	92,048	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,017	91,926	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	182,946	185,035	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	93,640	95,023	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	94,239	95,836	2053/11/10
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,098	96,533	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,948	97,327	2054/11/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	98,861	99,172	2055/1/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		0.713	100,000	104,235	2027/6/18
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	99,808	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		0.24	100,000	100,881	2027/3/19
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	101,406	2021/9/17
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	99,814	2021/6/28
小	計		13,677,761	14,517,823	
金融債券					
い第804号商工債券		0.06	300,000	299,817	2022/5/27
第321回信金中金債		0.03	200,000	199,948	2021/8/27
第333回信金中金債		0.09	100,000	100,076	2022/8/26
第337回信金中金債		0.11	100,000	100,143	2022/12/27
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,294	2023/1/27
第341回信金中金債		0.11	100,000	100,161	2023/4/27
第230号商工債券 (3年)		0.09	200,000	200,034	2022/3/25
第239号商工債券 (3年)		0.02	200,000	199,662	2022/12/27
小	計		1,400,000	1,400,135	

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548回東京電力	2.347	100,000	109,885	2028/9/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,646	2023/6/23
第528回中部電力	0.13	100,000	99,895	2023/11/24
第510回関西電力	0.49	100,000	100,208	2027/7/23
第518回関西電力	0.44	100,000	99,495	2028/6/20
第532回関西電力	0.18	100,000	99,730	2024/7/25
第383回中国電力	0.764	100,000	102,410	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,648	2026/11/25
第494回東北電力	0.425	200,000	200,830	2027/6/25
第427回九州電力	1.024	100,000	103,258	2024/5/24
第468回九州電力	0.435	100,000	100,079	2028/8/25
第469回九州電力	0.3	100,000	99,946	2025/10/24
第482回九州電力	0.17	300,000	299,364	2024/8/23
第484回九州電力	0.375	200,000	198,644	2029/11/22
第488回九州電力	0.07	100,000	99,984	2023/5/25
第5回日揮	0.2	300,000	299,595	2022/10/13
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	99,654	2024/9/13
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,347	2026/2/13
第12回日本たばこ産業	0.11	200,000	199,154	2023/9/8
第6回ヒューリック	0.494	200,000	199,090	2028/10/20
第7回ヒューリック	0.2	100,000	99,229	2024/6/25
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,628	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	100,000	99,689	2023/3/8
第31回東レ	0.25	100,000	99,897	2024/7/19
第1回電通	0.11	200,000	199,136	2023/10/25
第2回電通	0.24	100,000	99,567	2025/10/24
第2回大塚ホールディングス	0.26	100,000	99,455	2026/3/6
第11回ヤフー	0.18	100,000	98,075	2024/7/31
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	101,743	2022/12/2
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	198,974	2027/4/21
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	198,714	2026/4/17
第10回日本特殊陶業	0.11	100,000	99,389	2024/6/20
第1回日本製鉄	0.14	100,000	99,150	2024/6/20
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	99,014	2027/5/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	101,271	2021/9/17
第48回日本精工	0.16	100,000	99,697	2023/11/29
第51回日本精工	0.19	100,000	98,736	2026/9/2
第53回日本電気	0.26	100,000	99,869	2023/9/21
第56回日本電気	0.28	100,000	100,086	2023/4/21
第17回パナソニック	0.47	100,000	100,117	2026/9/18
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	99,703	2021/8/2
第60回日産自動車	0.22	200,000	195,476	2023/3/20
第16回アイシン精機	0.16	100,000	98,844	2026/9/25
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	98,895	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	98,725	2024/8/2
第51回住友商事	1.241	100,000	106,374	2029/4/23

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	101,033
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	98,218
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	101,924
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	114,446
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	100,525
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	102,429
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	100,795
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	108,698
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	99,780
第53回ホンダファイナンス	0.05	200,000	199,630
第77回トヨタファイナンス	0.145	100,000	99,503
第30回リコーリース	0.16	100,000	99,914
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,634
第37回リコーリース	0.02	100,000	99,484
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,350
第79回アコム	0.29	100,000	98,122
第70回日立キャピタル	0.2	100,000	99,841
第82回日立キャピタル	0.09	200,000	198,896
第194回オリックス	0.19	200,000	199,266
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	100,000	99,698
第63回三菱UFJリース	0.19	100,000	99,825
第66回三菱UFJリース	0.21	300,000	299,292
第75回三菱UFJリース	0.22	100,000	99,580
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	109,437
第76回三井不動産	0.21	100,000	100,038
第72回三菱地所	2.28	100,000	108,611
第125回三菱地所	0.19	100,000	99,425
第36回京王電鉄	0.325	100,000	99,815
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	108,179
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	109,819
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	128,117
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	104,084
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	21,851
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	117,547
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	114,737
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	99,794
第16回三菱倉庫	0.21	100,000	99,457
第63回日本電信電話	0.69	200,000	202,788
第21回KDDI	0.669	100,000	101,488
第1回ソフトバンク	0.13	200,000	199,708
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	101,582
第8回電源開発	2.11	100,000	108,355
第38回電源開発	0.978	100,000	102,801
第50回電源開発	0.415	200,000	199,848
第4回東京電力パワーグリッド	0.69	200,000	202,484
第12回東京電力パワーグリッド	0.44	100,000	100,442

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15回東京電力パワーグリッド		0.89	100,000	98,168	2030/7/24
第28回東京電力パワーグリッド		1.01	100,000	100,333	2029/7/10
第30回東京電力パワーグリッド		0.58	100,000	100,685	2024/10/9
第31回東京電力パワーグリッド		0.98	100,000	99,955	2029/10/9
第23回東京ガス		1.01	100,000	102,818	2023/6/9
第13回広島ガス		0.405	100,000	99,995	2028/9/13
第6回SCSK		0.14	100,000	99,706	2022/7/21
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	102,234	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行		0.563	100,000	99,903	2021/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行		0.443	100,000	99,427	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行		0.25	100,000	98,187	2024/10/10
第8回新韓銀行		0.52	300,000	300,027	2022/11/2
第1回韓国石油公社債		0.24	100,000	99,437	2022/1/21
小 計			12,771,000	12,912,480	
合 計			222,489,111	241,122,801	

先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 456	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 241,122,801	% 99.3
コール・ローン等、その他	1,581,932	0.7
投資信託財産総額	242,704,733	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	242,704,733,025
コール・ローン等	795,705,527
公社債(評価額)	241,122,801,233
未収入金	251,638,000
未収利息	511,876,525
前払費用	11,101,740
差入委託証拠金	11,610,000
(B) 負債	305,764,927
未払金	109,813,300
未払解約金	195,950,153
未払利息	1,474
(C) 純資産総額(A-B)	242,398,968,098
元本	171,486,959,342
次期繰越損益金	70,912,008,756
(D) 受益権総口数	171,486,959,342口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,135円

<注記事項>

- ①期首元本額 169,381,679,941円
 期中追加設定元本額 44,209,423,557円
 期中一部解約元本額 42,104,144,156円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,135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 プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	58,154,450,424円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	39,034,764,006円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	28,076,386,911円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	14,231,472,089円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	11,508,739,055円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	5,990,944,211円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	5,311,854,467円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	4,628,158,477円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,289,247,486円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,234,615,945円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	272,033,561円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	222,826,982円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	194,540,017円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	169,005,961円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	114,505,079円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	53,278,913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)	135,758円
合計	171,486,959,342円

○損益の状況 (2019年5月21日~2020年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,059,680,963
受取利息	2,060,273,030
支払利息	△ 592,067
(B) 有価証券売買損益	△ 1,736,999,171
売買益	576,169,788
売買損	△ 2,313,168,959
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,858,320
取引益	15,241,520
取引損	△ 18,099,840
(D) 保管費用等	△ 1,928
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	319,821,544
(F) 前期繰越損益金	69,721,588,450
(G) 追加信託差損益金	18,838,180,338
(H) 解約差損益金	△17,967,581,576
(I) 計(E+F+G+H)	70,912,008,756
次期繰越損益金(I)	70,912,008,756

(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まず。

(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。