

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	日本債券インデックスマザーファンド受益証券および三菱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	ベビーフンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券および三菱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。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	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48期（決算日：2021年4月26日）

第49期（決算日：2021年7月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ 国内債券インデックスファンド」は、去る7月26日に第49期の決算を行いましたので、法令に基づいて第48期～第49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
		税込み 分配金	騰落 率	騰落 率	騰落 率	騰落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
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	
46期(2020年10月26日)	10,225	30	△0.2	386.83	△0.1	99.7	0.1	3,533	
47期(2021年1月26日)	10,186	30	△0.1	386.83	0.0	99.6	0.1	3,531	
48期(2021年4月26日)	10,149	30	△0.1	386.91	0.0	99.7	0.2	3,522	
49期(2021年7月26日)	10,154	30	0.3	388.73	0.5	99.6	0.2	3,461	

(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48期	(期 首) 2021年1月26日	10,186	—	386.83	—	99.6	0.1
	1月末	10,169	△0.2	386.25	△0.1	100.3	0.1
	2月末	10,082	△1.0	383.06	△1.0	102.1	0.1
	3月末	10,148	△0.4	385.72	△0.3	101.6	0.2
	(期 末) 2021年4月26日	10,179	△0.1	386.91	0.0	99.7	0.2
第49期	(期 首) 2021年4月26日	10,149	—	386.91	—	99.7	0.2
	4月末	10,135	△0.1	386.44	△0.1	99.5	0.2
	5月末	10,136	△0.1	386.62	△0.1	100.3	0.2
	6月末	10,138	△0.1	386.90	△0.0	100.2	0.2
	(期 末) 2021年7月26日	10,184	0.3	388.73	0.5	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。

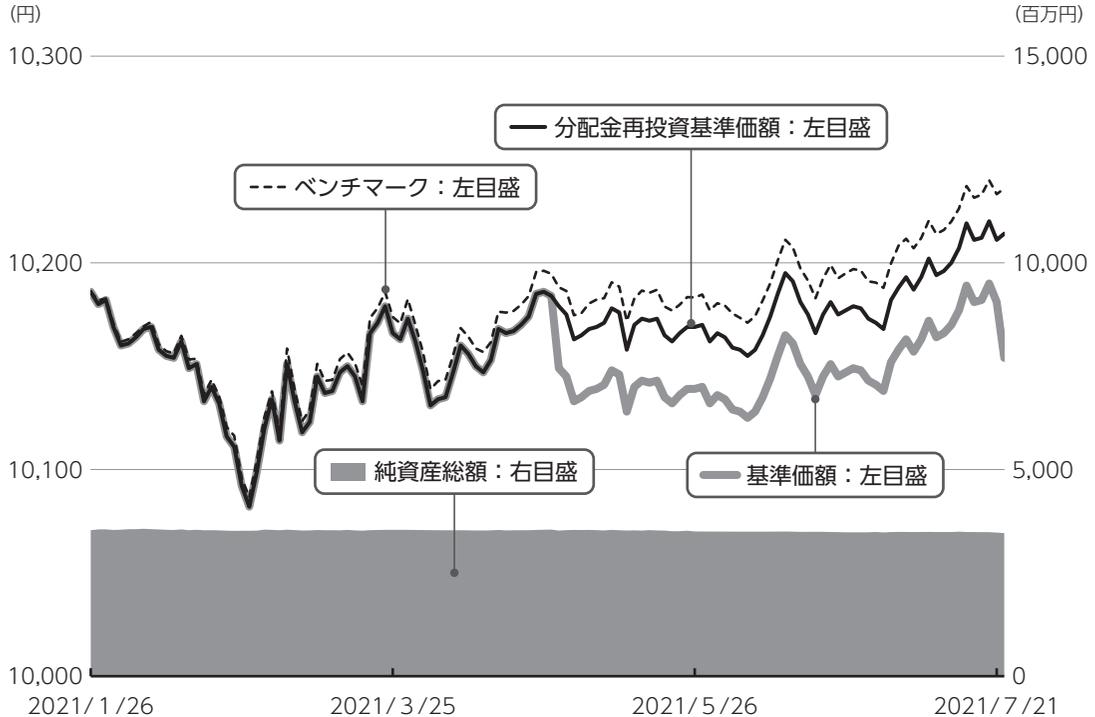
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第48期～第49期：2021年1月27日～2021年7月26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 48 期 首	10,186円
第 49 期 末	10,154円
既払分配金	60円
騰 落 率	0.3%

(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0.3%（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（0.5%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

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48期～第49期：2021年1月27日～2021年7月26日

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。

国内債券市況は、作成期の前半にインフレや米債増発への懸念による米金利の上昇、日銀の金融政策点検に対する警戒感などから下落しました。公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感か

ら、国内債券市況は反発しました。作成期の後半は、新型コロナウイルス感染再拡大による景気回復の後ずれ懸念などから国内債券市況は上昇し、作成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

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。

当作成期は、投資対象に追加した日本債券インデックスマザーファンドの投資はありません。

※マザーファンドの入替えのため、日本債券インデックスマザーファンドを2021年4月24日に投資対象に追加し、三菱UFJ 国内債券マザーファンドを2021年12月28日に削除する予定です。

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48期～第49期：2021/1/27～2021/7/26

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△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△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。

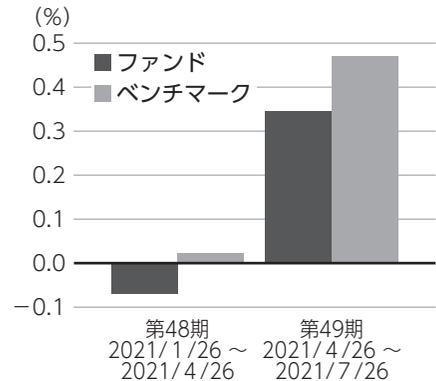
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：取引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48期 2021年1月27日～2021年4月26日	第49期 2021年4月27日～2021年7月26日
当期分配金（対基準価額比率）	30 (0.295%)	30 (0.295%)
当期の収益	9	14
当期の収益以外	21	15
翌期繰越分配対象額	658	643

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

2021年1月27日～2021年7月26日

1万口当たりの費用明細

項目	第48期～第49期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	19	0.191	(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）	(8)	(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）	(8)	(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	19	0.193	

作成期中の平均基準価額は、10,149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。

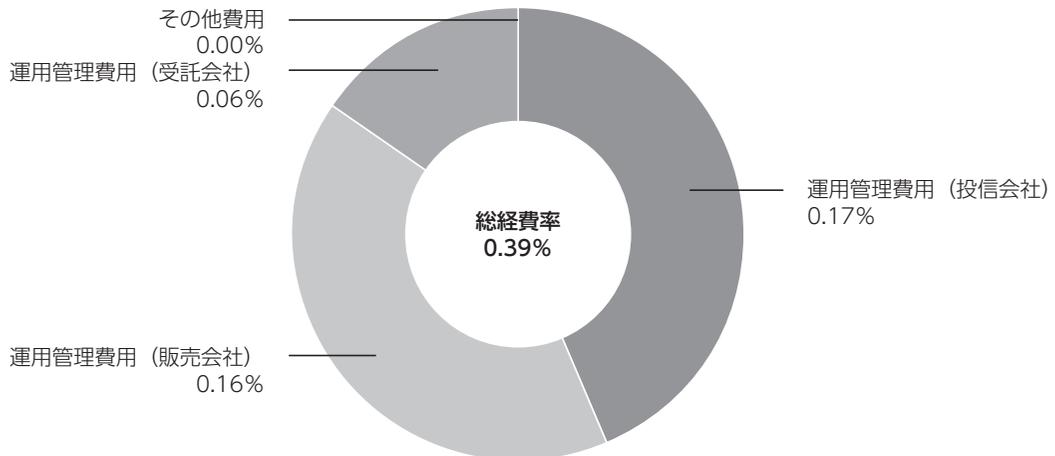
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.39%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2021年1月27日～2021年7月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第48期～第49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	184,788	259,607	245,722	345,564

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2021年7月26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48期～第49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 65,919	百万円 13,517	% 20.5	百万円 41,726	百万円 7,690	% 18.4

平均保有割合 1.2%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

利害関係人の発行する有価証券等

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種 類	第48期～第49期		
	買 付 額	売 付 額	第49期末保有額
公社債	百万円 803	百万円 502	百万円 1,122

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48期～第49期
	買 付 額
公社債	百万円 3,500

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

○組入資産の明細

(2021年7月26日現在)

親投資信託残高

銘柄	第47期末	第49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 2,508,995	千口 2,448,061	千円 3,461,559

○投資信託財産の構成

(2021年7月26日現在)

項目	第49期末	
	評価額	比率
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	千円 3,461,559	% 99.0
コール・ローン等、その他	35,291	1.0
投資信託財産総額	3,496,850	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第48期末	第49期末
	2021年4月26日現在	2021年7月26日現在
(A) 資産	円 3,550,612,936	円 3,496,850,733
コール・ローン等	10,189,424	13,949,208
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	3,522,081,998	3,461,559,000
未収入金	18,341,514	21,342,525
(B) 負債	28,203,957	34,970,229
未払収益分配金	10,412,391	10,227,847
未払解約金	14,408,207	21,353,360
未払信託報酬	3,356,537	3,362,137
未払利息	1	13
その他未払費用	26,821	26,872
(C) 純資産総額(A-B)	3,522,408,979	3,461,880,504
元本	3,470,797,013	3,409,282,515
次期繰越損益金	51,611,966	52,597,989
(D) 受益権総口数	3,470,797.013口	3,409,282.515口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,149円	10,154円

○損益の状況

項 目	第48期	第49期
	2021年1月27日～ 2021年4月26日	2021年4月27日～ 2021年7月26日
	円	円
(A) 配当等収益	△ 111	△ 405
受取利息	2	-
支払利息	△ 113	△ 405
(B) 有価証券売買損益	1,554,551	15,550,721
売買益	4,612,522	17,917,030
売買損	△ 3,057,971	△ 2,366,309
(C) 信託報酬等	△ 3,383,358	△ 3,389,009
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,828,918	12,161,307
(E) 前期繰越損益金	△ 70,809,467	△ 70,594,352
(F) 追加信託差損益金	134,662,742	121,258,881
(配当等相当額)	(235,605,207)	(224,373,449)
(売買損益相当額)	(△100,942,465)	(△103,114,568)
(G) 計(D+E+F)	62,024,357	62,825,836
(H) 収益分配金	△ 10,412,391	△ 10,227,847
次期繰越損益金(G+H)	51,611,966	52,597,989
追加信託差損益金	127,374,068	116,144,957
(配当等相当額)	(228,407,288)	(219,324,855)
(売買損益相当額)	(△101,033,220)	(△103,179,898)
分配準備積立金	281,521	91,014
繰越損益金	△ 76,043,623	△ 63,637,982

(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 3,466,910,676円
 作成期中追加設定元本額 419,917,697円
 作成期中一部解約元本額 477,545,858円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0154円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年1月27日～ 2021年4月26日	2021年4月27日～ 2021年7月26日
費用控除後の配当等収益額	3,255,126円	4,942,622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	235,695,962円	224,438,779円
分配準備積立金額	150,112円	262,315円
当ファンドの分配対象収益額	239,101,200円	229,643,716円
1万口当たり収益分配対象額	688円	673円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	10,412,391円	10,227,847円

○分配金のお知らせ

	第48期	第49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]

投資の対象とするマザーファンドの追加および付随する変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年4月24日)

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

《第21期》決算日2021年5月20日

[計算期間：2020年5月21日～2021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21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21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
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
21期(2021年5月20日)	14,062	△0.5	386.560	△0.5	99.5	0.2	289,699

(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	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年5月20日	円 14,135	% —	388.555	% —	% 99.5	% 0.2
5月末	14,117	△0.1	388.127	△0.1	102.0	0.2
6月末	14,062	△0.5	386.558	△0.5	99.7	0.2
7月末	14,110	△0.2	387.913	△0.2	99.7	0.2
8月末	14,046	△0.6	386.087	△0.6	102.5	0.1
9月末	14,087	△0.3	387.219	△0.3	99.8	0.1
10月末	14,064	△0.5	386.633	△0.5	98.9	0.1
11月末	14,083	△0.4	387.118	△0.4	103.8	0.1
12月末	14,085	△0.4	387.203	△0.3	101.0	0.1
2021年1月末	14,051	△0.6	386.252	△0.6	100.3	0.1
2月末	13,934	△1.4	383.056	△1.4	102.1	0.1
3月末	14,031	△0.7	385.724	△0.7	101.6	0.2
4月末	14,058	△0.5	386.440	△0.5	99.5	0.2
(期 末) 2021年5月20日	14,062	△0.5	386.560	△0.5	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

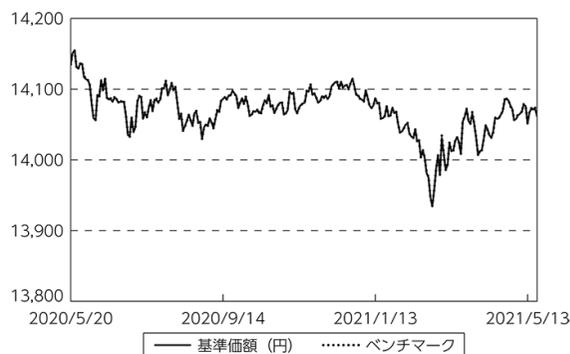
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.5%)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

(下落要因)

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

● 投資環境について**◎ 国内債券市況**

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

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
 - ・ ベンチマークである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0.5%の下落になったため、カイ離は△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)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年5月21日～2021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
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,068円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年5月21日～2021年5月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	105,426,153	61,331,968
	地方債証券	9,001,225	5,851,777 (340,000)
内	特殊債券	3,906,698	3,468,954 (438,668)
	社債券	19,927,717	16,288,590 (200,000)

(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	債券先物取引	百万円 1,969	百万円 1,819	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月21日～2021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 138,261	百万円 30,671	% 22.2	百万円 86,941	百万円 22,077	% 25.4

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1,620	百万円 1,713	百万円 1,122

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 10,700

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

○組入資産の明細

(2021年5月20日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	226,364,000	241,609,431	83.4	—	57.1	17.5	8.9
地方債証券	13,539,800	14,310,611	4.9	—	2.0	1.9	1.0
	(13,539,800)	(14,310,611)	(4.9)	(—)	(2.0)	(1.9)	(1.0)
特殊債券 (除く金融債)	14,111,426	14,885,739	5.1	—	2.6	1.7	0.8
	(14,111,426)	(14,885,739)	(5.1)	(—)	(2.6)	(1.7)	(0.8)
金融債券	900,000	900,786	0.3	—	—	0.1	0.2
	(900,000)	(900,786)	(0.3)	(—)	(—)	(0.1)	(0.2)
普通社債券	16,171,000	16,436,529	5.7	—	1.9	3.4	0.4
	(16,171,000)	(16,436,529)	(5.7)	(—)	(1.9)	(3.4)	(0.4)
合 計	271,086,226	288,143,098	99.5	—	63.6	24.5	11.3
	(44,722,226)	(46,533,667)	(16.1)	(—)	(6.6)	(7.0)	(2.5)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第413回利付国債 (2年)	0.1	830,000	831,967	2022/6/1
第414回利付国債 (2年)	0.1	100,000	100,267	2022/7/1
第415回利付国債 (2年)	0.1	1,350,000	1,353,874	2022/8/1
第416回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,616	2022/9/1
第417回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,103,608	2022/10/1
第418回利付国債 (2年)	0.1	1,300,000	1,304,524	2022/11/1
第421回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,008,000	2023/2/1
第422回利付国債 (2年)	0.1	1,420,000	1,426,191	2023/3/1
第423回利付国債 (2年)	0.005	1,650,000	1,654,306	2023/4/1
第132回利付国債 (5年)	0.1	2,170,000	2,175,273	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	2,710,000	2,718,130	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	1,920,000	1,926,988	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,200,000	1,205,172	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	710,000	713,479	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,860,000	1,870,230	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	2,420,000	2,434,737	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	2,280,000	2,295,207	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	2,780,000	2,799,765	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	2,540,000	2,559,126	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	2,150,000	2,167,393	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	2,250,000	2,269,035	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	2,360,000	2,380,791	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,440,000	1,453,478	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	1,720,000	1,736,236	2025/12/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	220,000	318,131	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	415,000	582,377	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	285,000	401,516	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	470,000	664,467	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	460,000	629,188	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	550,000	742,082	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	600,000	778,884	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	630,000	766,344	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,020,000	930,403	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	1,030,000	1,100,029	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	840,000	870,970	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	740,000	693,653	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	1,080,000	1,009,422	2060/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	475,217	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	989,819	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,407,180	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	101,309	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	892,909	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,793,700	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,530,000	1,559,865	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,450,000	1,481,740	2023/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	651,014	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,711,785	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	700,000	714,616	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,160,000	1,186,204	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,520,000	1,551,798	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	184,048	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	980,000	994,984	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,350,000	1,377,000	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	2,160,000	2,205,619	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,420,000	2,474,280	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,450,000	1,477,376	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,030,000	2,049,203	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,750,000	2,775,960	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,440,000	2,463,521	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	3,490,000	3,524,236	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,670,000	2,696,566	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	1,860,000	1,878,730	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	3,450,000	3,485,086	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	2,100,000	2,121,504	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,830,000	2,858,101	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,260,000	1,272,070	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	1,700,000	1,715,606	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,200,000	2,220,042	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,650,000	2,672,816	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	960,000	967,756	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	3,080,000	3,103,069	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	2,030,000	2,043,905	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	2,960,000	2,978,233	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	2,620,000	2,634,200	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,840,000	2,851,842	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	1,910,000	1,916,360	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	830,000	831,618	2031/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	147,756	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	205,263	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	228,596	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	158,612	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	217,954	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	210,742	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	278,541	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	190,292	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	102,984	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	292,040	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	118,323	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	253,103	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	477,925	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	486,096	2034/3/20

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15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	570,468	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	448,641	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	451,825	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	461,120	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	372,389	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	342,136	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	322,792	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	377,237	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	185,781	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	305,971	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	267,231	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	568,610	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	537,864	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	560,374	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	642,912	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	625,000	830,231	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	725,000	953,614	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	570,000	762,984	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	623,000	803,327	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	765,000	1,018,926	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	910,000	1,181,571	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	970,000	1,263,551	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	920,000	1,184,279	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	785,000	997,632	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	560,000	724,550	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	590,000	751,642	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	520,000	652,579	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	650,000	816,517	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	560,000	704,160	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	620,000	780,356	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	610,000	741,814	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	880,000	1,070,792	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	770,000	955,131	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	600,000	717,150	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	770,000	920,704	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	800,000	845,536	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	760,000	714,179	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	810,000	797,445	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	720,000	724,816	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	520,000	547,544	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	790,000	831,253	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	700,000	736,015	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)		0.8	800,000	840,536	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	1,050,000	1,102,342	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)		0.7	620,000	635,183	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)		0.9	670,000	718,883	2048/9/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
国債証券	%	千円	千円
第61回利付国債 (30年)	0.7	660,000	674,018
第62回利付国債 (30年)	0.5	490,000	474,912
第63回利付国債 (30年)	0.4	720,000	678,052
第64回利付国債 (30年)	0.4	750,000	704,287
第65回利付国債 (30年)	0.4	510,000	478,109
第66回利付国債 (30年)	0.4	810,000	758,070
第67回利付国債 (30年)	0.6	820,000	807,995
第68回利付国債 (30年)	0.6	800,000	788,200
第69回利付国債 (30年)	0.7	940,000	950,481
第70回利付国債 (30年)	0.7	160,000	161,393
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	378,517
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	163,510
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	359,471
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	607,080
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	235,563
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	265,387
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	570,869
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	286,079
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	502,809
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	452,566
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	178,481
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	84,600
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	421,081
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	127,582
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	549,841
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	214,386
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	692,929
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	215,258
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	410,358
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	249,598
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	226,277
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	281,153
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	108,652
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	403,529
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	679,668
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	200,482
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	449,749
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	254,435
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	593,680
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	188,885
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	515,995
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	145,161
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	527,405
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	90,199
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	729,267
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	293,027

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95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	560,760	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	135,864	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	377,421	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	386,695	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	635,000	725,417	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	426,906	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	350,000	408,628	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	222,845	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	373,049	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	356,989	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	404,645	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	210,000	244,330	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	240,000	278,642	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	572,910	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	60,000	68,980	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	280,000	326,295	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	450,000	530,010	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	610,000	713,529	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	360,000	422,654	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	683,373	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	290,000	344,172	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	256,086	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	510,000	602,973	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	444,000	522,747	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	278,222	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	520,000	593,403	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	690,000	808,597	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	800,000	955,504	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	340,000	402,849	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	910,000	1,098,697	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	200,000	237,568	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	90,000	106,027	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,020,000	1,205,058	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	800,000	939,584	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	488,985	2031/9/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,150,000	1,354,734	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	890,000	1,050,974	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	58,508	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	60,000	69,567	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	1,320,000	1,548,096	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	130,000	149,619	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	116,186	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	820,000	964,336	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	820,000	966,361	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	630,000	749,630	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,350,000	1,578,447	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144回利付国債 (20年)		1.5	10,000	11,575	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,380,000	1,632,857	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	1,340,000	1,588,637	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	930,000	1,093,168	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	840,000	979,045	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	1,090,000	1,272,269	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	1,170,000	1,352,344	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	1,320,000	1,492,576	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	1,000,000	1,131,530	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	1,480,000	1,696,006	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	1,160,000	1,314,314	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	1,480,000	1,636,169	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	1,220,000	1,242,606	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	1,100,000	1,086,470	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	880,000	907,130	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	1,390,000	1,453,161	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	1,110,000	1,176,200	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	900,000	939,258	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	1,210,000	1,261,606	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	1,280,000	1,333,286	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	1,330,000	1,361,707	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	1,180,000	1,206,573	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	1,050,000	1,107,340	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	1,000,000	1,019,770	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	1,050,000	1,051,743	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	1,090,000	1,070,707	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	710,000	696,084	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	1,070,000	1,047,861	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	970,000	965,770	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)		0.4	1,150,000	1,142,904	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)		0.4	1,370,000	1,360,231	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)		0.5	1,290,000	1,303,944	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)		0.5	300,000	303,006	2041/3/20
小	計		226,364,000	241,609,431	
地方債証券					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	108,020	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	109,292	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	93,950	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (7年)		0.238	100,000	100,306	2022/9/20
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	132,086	2039/9/20
第710回東京都公募公債		0.81	100,000	100,868	2022/6/20
第713回東京都公募公債		0.77	100,000	101,017	2022/9/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	203,116	2023/3/20
第724回東京都公募公債		0.7	800,000	812,896	2023/9/20
第728回東京都公募公債		0.65	400,000	406,564	2023/12/20
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	101,839	2024/3/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	400,000	425,420	2024/3/19
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	50,558	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	101,569	2024/12/26
第29回1号宮城県公募公債	0.68	200,000	203,250	2023/10/25
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	136,706	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,368	2038/3/19
第190回神奈川県公募公債	0.88	100,000	100,944	2022/6/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	117,895	2030/5/28
第372回大阪府公募公債	0.656	200,000	202,578	2023/5/30
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,986	2028/8/30
第451回大阪府公募公債	0.063	140,000	139,141	2029/12/26
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	193,111	2030/9/27
第464回大阪府公募公債	0.072	400,000	396,176	2031/1/28
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	117,235	2029/9/20
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	66,070	2021/6/22
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	1.455	100,000	115,134	2034/8/10
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	66,762	2040/3/19
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	50,321	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	200,000	202,124	2022/10/19
第27回兵庫県公募公債(20年)	0.387	200,000	200,764	2036/5/12
第6回静岡県公募公債(15年)	1.062	300,000	323,211	2029/6/25
第11回静岡県公募公債(20年)	1.841	200,000	231,436	2030/10/18
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	101,848	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,297	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	229,476	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	400,000	470,168	2029/6/20
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	70,314	2021/10/28
平成24年度第5回愛知県公募公債	0.886	300,000	302,910	2022/6/28
平成24年度第8回愛知県公募公債	0.835	200,000	202,108	2022/8/29
平成30年度第5回愛知県公募公債	0.195	100,000	100,777	2028/6/29
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	264,446	2025/3/25
平成30年度第1回広島県公募公債	0.2	100,000	100,801	2028/5/25
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	202,498	2028/11/22
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	117,235	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	116,771	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債(20年)	1.546	200,000	232,258	2034/5/8
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	0.02	140,000	140,021	2022/10/27
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	2.116	400,000	475,732	2031/2/21
平成24年度第6回福岡県公募公債	0.8	100,000	101,133	2022/10/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	80,434	2021/11/25
平成27年度第3回千葉県公募公債	0.524	200,000	204,170	2025/6/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	303,597	2022/11/25
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	200,000	203,598	2023/6/23
第124回共同発行市場公募地方債	0.91	300,000	305,886	2023/7/25
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	101,835	2023/8/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,001	2024/1/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,838	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	203,956	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	203,444	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,428	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	203,498	2025/3/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	300,000	303,465	2028/8/25
平成24年度第1回長崎県公募公債		0.82	100,000	101,101	2022/9/28
平成24年度第1回静岡市公募公債		0.82	400,000	404,892	2022/11/22
平成24年度第6回大阪市公募公債		0.797	100,000	101,180	2022/11/18
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	101,831	2024/11/28
第1回名古屋市長募公債(20年)		1.99	100,000	105,107	2023/12/20
第2回名古屋市長募公債(15年)		0.905	100,000	106,645	2029/11/16
第9回名古屋市長募公債(20年)		2.07	100,000	114,964	2028/12/20
第9回名古屋市長募公債(30年)		2.095	90,000	118,010	2042/9/19
第3回京都市公募公債(20年)		2.09	100,000	109,505	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	110,000	123,887	2026/6/19
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	108,799	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	250,000	273,420	2025/12/19
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	40,000	46,395	2033/5/20
第35回横浜市公募公債(20年)		0.443	200,000	202,128	2036/10/28
平成24年度第7回札幌市公募公債		0.75	100,000	100,991	2022/9/20
令和2年度第7回札幌市公募公債		0.115	200,000	199,242	2030/12/20
第7回川崎市公募公債(20年)		2.08	100,000	116,033	2029/7/17
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	70,801	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	50,018	2021/5/31
小	計		13,539,800	14,310,611	
特殊債券(除く金融債)					
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	233,358	2029/9/28
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	131,287	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	123,970	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	116,441	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	14,018	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	128,834	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	101,012	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	101,168	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	30,442	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	344,144	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	101,852	2023/6/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	208,000	211,704	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	101,817	2024/3/29
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	101,944	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	101,956	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	300,000	305,076	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	101,625	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	203,358	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	135,644	2025/5/30

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第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	102,946	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	101,432	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	100,620	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	108,522	2028/4/28
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	35,261	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	101,106	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	202,360	2022/12/16
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.834	104,000	105,475	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	38,551	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	101,067	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	101,855	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	310,377	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	101,792	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	500,115	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	102,017	2026/4/17
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	143,000	145,096	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	91,506	2023/10/20
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	105,982	2025/6/13
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	100,000	101,242	2023/3/15
第26回政府保証日本政策投資銀行		0.466	100,000	101,606	2024/12/12
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	99,305	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	33,805	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	150,951	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	156,304	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	147,162	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	200,000	225,656	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	159,921	2047/3/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	131,090	2033/12/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	200,000	216,740	2025/3/21
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.773	100,000	116,910	2032/9/17
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.038	200,000	203,768	2023/3/20
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.94	100,000	101,917	2023/6/20
第121回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.689	100,000	101,716	2023/12/20
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	220,928	2035/3/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	101,874	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	133,097	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	117,716	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	106,172	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	106,314	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	118,577	2031/1/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.29	100,000	114,921	2028/4/25
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	202,640	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	202,194	2023/4/28
F54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.588	200,000	208,846	2024/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	79,333	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	107,981	2027/11/5

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	
F 203回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.063	100,000	106,341	2028/2/28
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	600,000	613,602	2022/6/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	202,232	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	23,228	23,780	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	25,900	26,802	2042/6/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	20,076	20,181	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	31,236	31,433	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	10,859	11,022	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	32,688	33,168	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	12,792	13,139	2042/12/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	92,373	92,230	2034/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	13,298	13,803	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	22,258	22,465	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	22,378	22,602	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	11,143	11,240	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	10,569	10,674	2039/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	24,772	26,531	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	11,512	11,729	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,731	26,436	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	12,317	12,604	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	48,232	51,008	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	49,030	51,805	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	23,742	24,242	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	26,471	27,656	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	23,270	23,872	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	23,574	24,150	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	89,310	95,098	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	50,568	53,534	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	49,140	52,031	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	25,053	26,450	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	26,418	27,865	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	28,334	29,911	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	26,222	27,201	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	31,093	32,780	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	32,435	34,204	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	35,943	37,919	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	38,089	40,243	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	39,325	41,397	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	76,430	80,158	2047/6/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	129,018	134,732	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	45,422	47,283	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	89,548	93,087	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	116,901	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	101,898	105,334	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	63,247	64,989	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	235,490	2032/4/16

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.54	141,810	144,093	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	230,010	231,212	2051/6/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	162,368	164,186	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	162,296	164,230	2052/3/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	82,887	83,790	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	84,791	85,448	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	85,629	86,630	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	85,536	86,363	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	85,557	86,250	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	85,708	86,431	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	172,792	174,483	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	88,538	89,683	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	88,771	90,106	2053/11/10
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	92,140	91,556	2054/8/10
第149回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.704	200,000	203,846	2024/3/19
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	93,597	92,981	2054/11/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	94,429	94,702	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	103,611	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	196,548	197,288	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.514	100,000	102,033	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	99,077	99,507	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	100,000	100,747	2056/5/10
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	99,918	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	100,753	2027/3/19
第231回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.06	100,000	100,083	2023/6/20
小	計		14,111,426	14,885,739	
金融債券					
い第843号商工債券		0.12	200,000	200,212	2025/8/27
第333回信金中金債		0.09	100,000	100,083	2022/8/26
第337回信金中金債		0.11	100,000	100,128	2022/12/27
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,252	2023/1/27
第341回信金中金債		0.11	100,000	100,145	2023/4/27
第239号商工債券(3年)		0.02	200,000	199,966	2022/12/27
小	計		900,000	900,786	
普通社債券					
第548回東京電力		2.347	100,000	111,108	2028/9/29
第499回中部電力		1.194	50,000	51,206	2023/6/23
第510回関西電力		0.49	300,000	304,656	2027/7/23
第518回関西電力		0.44	100,000	101,181	2028/6/20
第524回関西電力		0.514	200,000	203,286	2028/10/25
第532回関西電力		0.18	100,000	100,270	2024/7/25
第383回中国電力		0.764	100,000	102,322	2024/10/25
第393回中国電力		0.26	100,000	100,409	2026/11/25
第485回東北電力		0.25	100,000	100,487	2026/7/24
第494回東北電力		0.425	200,000	202,832	2027/6/25
第509回東北電力		0.2	400,000	401,572	2024/5/24

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529回東北電力	0.07	200,000	199,490	2026/4/24
第427回九州電力	1.024	100,000	102,854	2024/5/24
第468回九州電力	0.435	100,000	101,283	2028/8/25
第471回九州電力	0.455	300,000	304,278	2028/11/24
第482回九州電力	0.17	300,000	300,825	2024/8/23
第484回九州電力	0.375	200,000	201,242	2029/11/22
第1回国際石油開発帝石	0.08	100,000	100,150	2026/3/16
第21回大和ハウス工業	0.001	300,000	299,844	2023/9/15
第10回明治ホールディングス (サステナビリティ)	0.05	100,000	99,980	2026/4/23
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,981	2026/3/13
第3回 キュービー	0.23	100,000	99,982	2026/2/13
第6回ヒューリック	0.494	200,000	200,284	2028/10/20
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,974	2024/12/20
第42回王子ホールディングス	0.08	100,000	100,029	2026/3/24
第6回花王	0.13	200,000	200,100	2025/9/19
第3回ヤフー	0.37	100,000	99,962	2024/2/28
第15回Zホールディングス	0.35	200,000	200,252	2023/6/9
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	200,654	2027/4/21
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,035	2027/5/20
第51回日本精工	0.19	100,000	99,406	2026/9/2
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,510	2026/9/18
第18回J A三井リース	0.16	100,000	99,862	2026/3/12
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,023	2021/8/2
第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.22	100,000	100,050	2025/10/10
第26回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	0.05	100,000	100,024	2026/3/18
第16回アイシン精機	0.16	100,000	99,215	2026/9/25
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	100,144	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,019	2024/8/2
第51回住友商事	1.241	100,000	107,167	2029/4/23
第86回クレディセゾン	0.09	200,000	199,328	2026/4/15
第1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	101,642	2024/6/26
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	101,084	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	300,000	300,018	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	100,628	2021/10/29
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	106,802	2025/11/12
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	112,321	2027/4/20
第15回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	101,231	2022/3/22
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	108,185	2026/9/11
第28回芙蓉総合リース	0.14	200,000	199,570	2026/4/21
第4回みずほリース	0.24	100,000	100,224	2025/10/7
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	100,417	2025/12/19
第17回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	200,000	201,446	2027/12/20
第31回東京センチュリー	0.01	200,000	199,536	2024/4/26
第32回東京センチュリー	0.09	100,000	99,662	2026/4/27
第64回ホンダファイナンス	0.001	200,000	199,754	2023/9/19
第65回ホンダファイナンス	0.16	200,000	200,186	2025/9/19

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第95回トヨタファイナンス	0.001	200,000	200,010
第96回トヨタファイナンス	0.06	300,000	299,979
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,959
第39回リコーリース	0.05	200,000	199,836
第40回リコーリース	0.04	200,000	199,686
第41回リコーリース	0.14	200,000	199,670
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,895
第79回アコム	0.29	100,000	99,820
第80回アコム	0.28	100,000	99,653
第201回オリックス	0.07	200,000	199,326
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	100,000	100,268
第69回三菱UFJリース	0.24	200,000	200,826
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	107,978
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,819
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	106,279
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	107,642
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	344,745
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	125,329
第102回東日本旅客鉄道	0.63	100,000	101,858
第163回東日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,594
第73回西日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,588
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	21,371
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	116,581
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	114,598
第83回東海旅客鉄道	0.001	400,000	399,820
第2回東京地下鉄	2.36	500,000	535,590
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	301,662
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	100,798
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,887
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,741
第8回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	100,020
第5回ソフトバンク	0.1	600,000	599,628
第8回電源開発	2.11	100,000	107,189
第50回電源開発	0.415	200,000	202,570
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	101,334
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	201,970
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	200,000	205,100
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	102,304
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,106
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	100,000	100,077
第13回広島ガス	0.405	100,000	100,758
第6回SSK	0.14	100,000	99,993
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	100,151
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,268
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,866

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第8回新韓銀行	% 0.52	千円 300,000	千円 300,405	2022/11/2
小 計		16,171,000	16,436,529	
合 計		271,086,226	288,143,098	

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 605	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 288,143,098	% 99.4
コール・ローン等、その他	1,704,546	0.6
投資信託財産総額	289,847,644	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	289,846,084,512
コール・ローン等	1,120,593,931
公社債(評価額)	288,143,098,675
未収入金	1,275,600
未収利息	562,672,313
前払費用	17,123,993
差入委託証拠金	1,320,000
(B) 負債	146,509,694
未払解約金	146,509,391
未払利息	303
(C) 純資産総額(A-B)	289,699,574,818
元本	206,012,246,620
次期繰越損益金	83,687,328,198
(D) 受益権総口数	206,012,246,620口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,062円

<注記事項>

- ①期首元本額 171,486,959,342円
 期中追加設定元本額 55,973,800,561円
 期中一部解約元本額 21,448,513,283円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,062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 ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	72,060,077,529円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	44,909,131,566円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	31,982,561,458円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	19,246,154,095円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	9,530,096,034円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	8,582,663,820円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	6,680,202,281円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	5,478,928,501円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,505,038,212円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,623,311,801円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式15)	1,400,369,556円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式40)	935,896,238円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式25)	459,242,641円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式65)	303,695,388円
三菱UFJ J 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	178,590,588円
三菱UFJ J 6資産バランスファンド(成長型)	136,164,871円
三菱UFJ J 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)	122,041円
合計	206,012,246,620円

[お知らせ]

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2021年4月3日)

○損益の状況 (2020年5月21日~2021年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,083,906,020
受取利息	2,084,234,091
支払利息	△ 328,071
(B) 有価証券売買損益	△ 3,321,538,486
売買益	212,488,097
売買損	△ 3,534,026,583
(C) 先物取引等取引損益	△ 837,500
取引益	2,832,400
取引損	△ 3,669,900
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,238,469,966
(E) 前期繰越損益金	70,912,008,756
(F) 追加信託差損益金	22,727,947,786
(G) 解約差損益金	△ 8,714,158,378
(H) 計(D+E+F+G)	83,687,328,198
次期繰越損益金(H)	83,687,328,198

(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。