

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	日本債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	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。
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。
	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。
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50期（決算日：2021年10月26日）

第51期（決算日：2022年1月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「三菱UFJ 国内債券インデックスファンド」は、去る1月26日に第51期の決算を行いましたので、法令に基づいて第50期～第51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）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近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	期騰落 率	中期騰落率	中期騰落率	中期騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
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	
50期(2021年10月26日)	10,048	30	△0.7	386.17	△0.7	99.5	0.2	3,330	
51期(2022年1月26日)	9,991	30	△0.3	385.52	△0.2	99.6	0.1	3,167	

(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50期	(期 首) 2021年7月26日	10,154	—	388.73	—	99.6	0.2
	7月末	10,155	0.0	388.81	0.0	99.3	0.3
	8月末	10,144	△0.1	388.46	△0.1	100.3	0.3
	9月末	10,106	△0.5	387.12	△0.4	100.5	0.2
	(期 末) 2021年10月26日	10,078	△0.7	386.17	△0.7	99.5	0.2
第51期	(期 首) 2021年10月26日	10,048	—	386.17	—	99.5	0.2
	10月末	10,062	0.1	386.72	0.1	100.3	—
	11月末	10,083	0.3	387.65	0.4	99.2	0.2
	12月末	10,057	0.1	386.84	0.2	100.5	0.1
	(期 末) 2022年1月26日	10,021	△0.3	385.52	△0.2	99.6	0.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

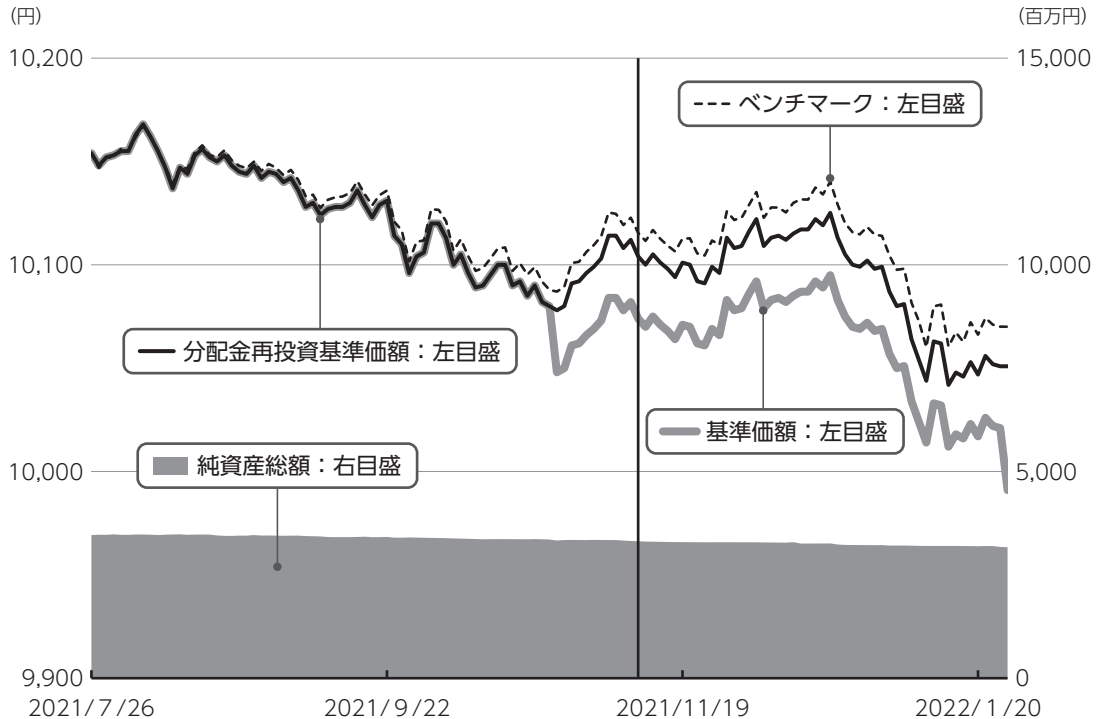
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第50期～第51期：2021年7月27日～2022年1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



※2021年11月11日にマザーファンドの入れ替えが終了したため、区切り線を入れております。

第50期首	10,154円
第51期末	9,991円
既払分配金	60円
騰落率	-1.0%

(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す。

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

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ1.0%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

なお、当作成中にマザーファンドの入れ替えを行いました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.8%）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50期～第51期：2021年7月27日～2022年1月26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、作成期の前半はインフレ懸念による米金利の上昇などを受けて下落しました。その後、新たに確認された新型コロナウイルスのオミクロン変異

株への懸念などから国内債券市況は上昇しましたが、米国の利上げ前倒し観測の高まりなどから反落し、作成期を通して見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

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。なお、2021年11月11日に「三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券」から「日本債券インデックスマザーファンド受益証券」へ、投資対象マザーファンドの入れ替えを行いました。

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。

日本債券インデックスマザーファンド

組入れを開始した時期から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50期～第51期：2021/7/27～2022/1/26

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。

- ▶ **三菱UFJ 国内債券マザーファンド**
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

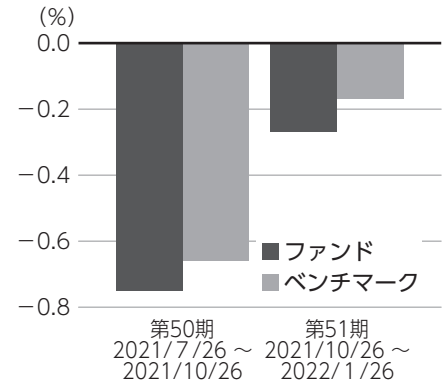
主なマイナス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

- ▶ **日本債券インデックスマザーファンド**
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。

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50期	第51期
	2021年7月27日～2021年10月26日	2021年10月27日～2022年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	30 (0.298%)	30 (0.299%)
当期の収益	7	7
当期の収益以外	22	22
翌期繰越分配対象額	621	599

(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。

▶ **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7月27日～2022年1月26日

1万口当たりの費用明細

項目	第50期～第51期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	20	0.194	(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)	(0.083)	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)	(0.083)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0.028)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.002	(c) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	20	0.196	

作成期中の平均基準価額は、10,094円です。

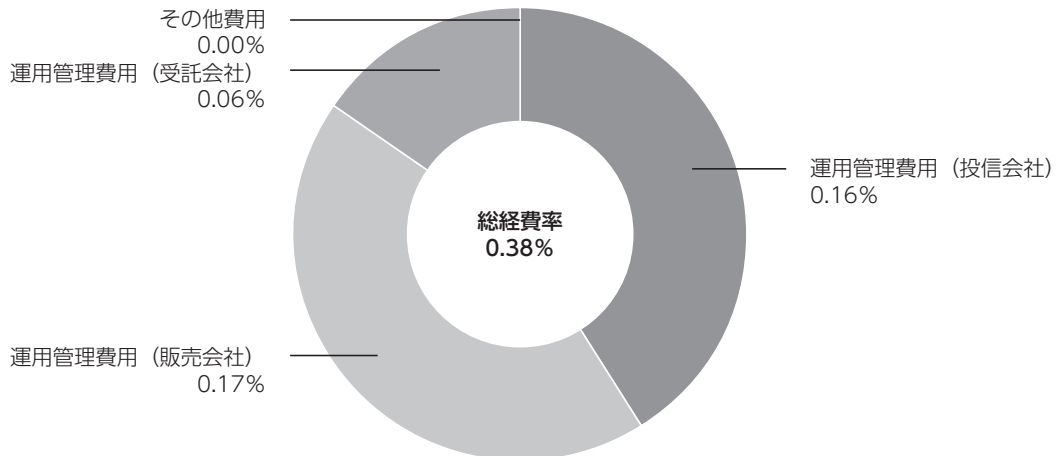
- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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まず。
- (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

(2021年7月27日～2022年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第50期～第51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	85,872	121,219	2,533,933	3,572,225
日本債券インデックスマザーファンド	2,474,654	3,336,284	113,129	152,353

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月27日～2022年1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50期～第51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 34,985	百万円 11,999	% 34.3	百万円 331,834	百万円 2,006	% 0.6

平均保有割合 1.1%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<日本債券インデックスマザーファンド>

区分	第50期～第51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 409,161	百万円 34,448	% 8.4	百万円 68,499	百万円 13,349	% 19.5

平均保有割合 0.5%

※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50期～第51期		
	買 付 額	売 付 額	第51期末保有額
公社債	百万円 100	百万円 1,221	百万円 —

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	第50期～第51期		
	買 付 額	売 付 額	第51期末保有額
公社債	百万円 2,121	百万円 302	百万円 3,958

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50期～第51期
	買 付 額
公社債	百万円 1,300

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	第50期～第51期
	買 付 額
公社債	百万円 4,399

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

(2022年1月26日現在)

親投資信託残高

銘柄	第49期末	第51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 2,448,061	千口 —	千円 —
日本債券インデックスマザーファンド	—	2,361,524	3,167,276

○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

項目	第51期末	
	評価額	比率
日本債券インデックスマザーファンド	千円 3,167,276	% 98.9
コール・ローン等、その他	35,298	1.1
投資信託財産総額	3,202,574	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第50期末	第51期末
	2021年10月26日現在	2022年1月26日現在
(A) 資産	円 3,367,549,210	円 3,202,574,413
コール・ローン等	8,683,807	5,792,446
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	3,330,629,881	—
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	—	3,167,276,656
未収入金	28,235,522	29,505,311
(B) 負債	36,610,240	35,003,740
未払収益分配金	9,945,432	9,511,036
未払解約金	23,316,012	22,300,324
未払信託報酬	3,322,245	3,167,075
未払利息	4	2
その他未払費用	26,547	25,303
(C) 純資産総額(A-B)	3,330,938,970	3,167,570,673
元本	3,315,144,029	3,170,345,343
次期繰越損益金	15,794,941	△ 2,774,670
(D) 受益権総口数	3,315,144,029口	3,170,345,343口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,048円	9,991円

○損益の状況

項 目	第50期	第51期
	2021年7月27日～ 2021年10月26日	2021年10月27日～ 2022年1月26日
	円	円
(A) 配当等収益	△ 353	△ 445
受取利息	19	7
支払利息	△ 372	△ 452
(B) 有価証券売買損益	△ 21,725,831	△ 5,287,936
売買益	459,109	11,936,343
売買損	△ 22,184,940	△ 17,224,279
(C) 信託報酬等	△ 3,348,792	△ 3,192,378
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 25,074,976	△ 8,480,759
(E) 前期繰越損益金	△ 58,604,776	△ 80,287,083
(F) 追加信託差損益金	109,420,125	95,504,208
(配当等相当額)	(213,273,363)	(197,065,791)
(売買損益相当額)	(△103,853,238)	(△101,561,583)
(G) 計(D+E+F)	25,740,373	6,736,366
(H) 収益分配金	△ 9,945,432	△ 9,511,036
次期繰越損益金(G+H)	15,794,941	△ 2,774,670
追加信託差損益金	102,126,808	88,529,448
(配当等相当額)	(206,064,355)	(190,116,559)
(売買損益相当額)	(△103,937,547)	(△101,587,111)
分配準備積立金	69,981	48,010
繰越損益金	△ 86,401,848	△ 91,352,128

(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 3,409,282,515円
 作成期中追加設定元本額 270,243,858円
 作成期中一部解約元本額 509,181,030円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9991円です。

② 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,774,670円です。

③ 分配金の計算過程

項 目	2021年7月27日～ 2021年10月26日	2021年10月27日～ 2022年1月26日
費用控除後の配当等収益額	2,638,161円	2,519,203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	213,357,672円	197,091,319円
分配準備積立金額	83,935円	65,083円
当ファンドの分配対象収益額	216,079,768円	199,675,605円
1万口当たり収益分配対象額	651円	629円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	9,945,432円	9,511,036円

○分配金のお知らせ

	第50期	第51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削除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12月28日)

日本債券インデックスマザーファンド

《第20期》決算日2021年5月12日

[計算期間：2020年5月13日～2021年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12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	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主 要 運 用 対 象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2%	378.85	△2.2%	99.3%	0.2%	457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8%	381.82	0.8%	98.4%	0.3%	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7%	388.16	1.7%	99.8%	0.1%	608,830
19期(2020年5月12日)	13,524	0.2%	388.75	0.2%	99.6%	0.1%	630,705
20期(2021年5月12日)	13,462	△0.5%	386.93	△0.5%	99.5%	0.2%	314,171

(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		NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020年5月12日	13,524	—	388.75	—	99.6	0.1
5月末	13,500	△0.2	388.13	△0.2	99.5	0.1
6月末	13,447	△0.6	386.56	△0.6	99.7	0.1
7月末	13,494	△0.2	387.91	△0.2	99.6	0.1
8月末	13,432	△0.7	386.09	△0.7	98.9	0.1
9月末	13,471	△0.4	387.22	△0.4	99.7	0.2
10月末	13,450	△0.5	386.63	△0.5	99.6	0.1
11月末	13,468	△0.4	387.12	△0.4	99.5	0.1
12月末	13,470	△0.4	387.20	△0.4	99.6	0.2
2021年1月末	13,437	△0.6	386.25	△0.6	99.6	0.1
2月末	13,326	△1.5	383.06	△1.5	99.4	0.3
3月末	13,419	△0.8	385.72	△0.8	99.5	0.3
4月末	13,444	△0.6	386.44	△0.6	99.1	0.3
(期 末) 2021年5月12日	13,462	△0.5	386.93	△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

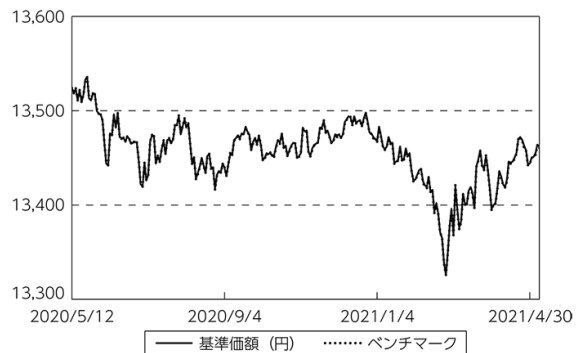
◎基準価額の動き

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(NOMURA-BPI総合)の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました[※]。
- [※]一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.5%の下落になったため、乖離は0.0%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13日～2021年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,455円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売買及び取引の状況

(2020年5月13日～2021年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	155,268,219	415,803,696
	地方債証券	6,996,873	22,992,622 (36,650)
内	特殊債券	7,504,707	27,814,826 (529,101)
	社債券	23,993,981	35,628,990 (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 10,000	百万円 9,856	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月13日～2021年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 193,763	百万円 52,248	27.0	百万円 502,240	百万円 73,722	14.7

(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 1,622	百万円 3,733	百万円 2,146

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 13,200

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HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021年5月12日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	242,655,000	259,888,132	82.7	—	56.6	18.1	8.0
地方債証券	14,919,160	15,856,280	5.0	—	2.2	1.8	1.0
	(14,919,160)	(15,856,280)	(5.0)	(—)	(2.2)	(1.8)	(1.0)
特殊債券 (除く金融債)	16,937,895	17,942,101	5.7	—	3.1	1.3	1.3
	(16,937,895)	(17,942,101)	(5.7)	(—)	(3.1)	(1.3)	(1.3)
金融債券	1,500,000	1,508,993	0.5	—	—	0.3	0.2
	(1,500,000)	(1,508,993)	(0.5)	(—)	(—)	(0.3)	(0.2)
普通社債券	17,350,000	17,533,409	5.6	0.0	1.7	3.4	0.5
	(17,350,000)	(17,533,409)	(5.6)	(0.0)	(1.7)	(3.4)	(0.5)
合 計	293,362,055	312,728,916	99.5	0.0	63.7	24.9	11.0
	(50,707,055)	(52,840,783)	(16.8)	(0.0)	(7.0)	(6.8)	(3.0)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
	%	千円	千円
国債証券			
第413回利付国債(2年)	0.1	1,160,000	1,162,807
第415回利付国債(2年)	0.1	1,050,000	1,053,076
第418回利付国債(2年)	0.1	1,760,000	1,766,212
第420回利付国債(2年)	0.1	430,000	431,655
第421回利付国債(2年)	0.1	150,000	150,607
第422回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,104,763
第423回利付国債(2年)	0.005	1,700,000	1,704,488
第132回利付国債(5年)	0.1	1,950,000	1,954,836
第133回利付国債(5年)	0.1	2,300,000	2,307,015
第134回利付国債(5年)	0.1	3,740,000	3,753,838
第136回利付国債(5年)	0.1	1,810,000	1,818,959
第137回利付国債(5年)	0.1	1,660,000	1,669,412
第138回利付国債(5年)	0.1	3,600,000	3,623,040
第139回利付国債(5年)	0.1	600,000	604,206
第140回利付国債(5年)	0.1	1,510,000	1,521,294
第141回利付国債(5年)	0.1	1,770,000	1,784,018
第142回利付国債(5年)	0.1	1,150,000	1,159,579
第143回利付国債(5年)	0.1	1,460,000	1,472,994
第144回利付国債(5年)	0.1	3,990,000	4,027,027
第145回利付国債(5年)	0.1	2,580,000	2,604,845
第146回利付国債(5年)	0.1	1,640,000	1,655,547
第147回利付国債(5年)	0.005	320,000	321,558
第1回利付国債(40年)	2.4	225,000	326,976
第2回利付国債(40年)	2.2	470,000	662,902
第3回利付国債(40年)	2.2	433,000	613,192
第4回利付国債(40年)	2.2	578,000	822,546
第5回利付国債(40年)	2.0	605,000	834,186
第6回利付国債(40年)	1.9	570,000	774,362
第7回利付国債(40年)	1.7	610,000	798,520
第8回利付国債(40年)	1.4	630,000	771,806
第9回利付国債(40年)	0.4	1,100,000	1,011,791
第10回利付国債(40年)	0.9	1,110,000	1,195,891
第11回利付国債(40年)	0.8	890,000	931,073
第12回利付国債(40年)	0.5	860,000	813,396
第13回利付国債(40年)	0.5	1,140,000	1,076,935
第323回利付国債(10年)	0.9	975,000	986,046
第324回利付国債(10年)	0.8	1,200,000	1,212,264
第325回利付国債(10年)	0.8	2,335,000	2,364,327
第326回利付国債(10年)	0.7	530,000	537,033
第327回利付国債(10年)	0.8	1,340,000	1,359,939
第328回利付国債(10年)	0.6	1,800,000	1,824,390
第329回利付国債(10年)	0.8	3,160,000	3,222,315
第330回利付国債(10年)	0.8	1,730,000	1,768,440
第331回利付国債(10年)	0.6	760,000	773,292

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332回利付国債 (10年)	0.6	1,240,000	1,263,994	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,250,000	3,319,322	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	2,830,000	2,895,288	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,370,000	2,420,718	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	2,280,000	2,332,029	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	640,000	649,964	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,980,000	2,020,609	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,860,000	1,900,269	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,050,000	1,073,908	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,870,000	1,905,473	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,706,477	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,120,000	2,140,648	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,480,000	2,504,676	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	2,730,000	2,757,654	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,440,000	2,465,083	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	2,050,000	2,071,361	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	3,360,000	3,395,380	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	2,260,000	2,283,978	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,470,000	2,495,465	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,560,000	1,575,553	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	1,380,000	1,393,220	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,740,000	2,765,043	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,050,000	2,067,712	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	2,490,000	2,510,169	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	3,000,000	3,022,530	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	1,410,000	1,419,686	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	2,670,000	2,686,500	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	3,740,000	3,760,345	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,850,000	2,863,252	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	2,380,000	2,387,949	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	660,000	661,610	2031/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	93,625	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	118,379	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	140,825	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	161,305	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	58,000	70,255	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	209,587	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	114,000	141,179	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	168,934	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	132,766	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	135,000	149,933	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	162,243	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	120,000	148,297	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	251,450	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	303,000	387,982	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	246,000	319,268	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	202,000	262,949	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	227,000	293,338	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	327,000	419,272	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	389,479	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	395,000	520,329	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	279,000	360,607	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	410,000	543,270	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	54,000	71,735	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	311,000	414,174	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	442,000	576,792	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	584,000	773,093	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	60,000	80,769	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	611,000	826,621	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	50,000	67,100	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	796,000	1,059,468	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	858,000	1,130,801	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	739,000	991,220	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	694,000	896,703	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	896,000	1,195,918	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,119,000	1,457,385	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	959,000	1,253,115	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,117,000	1,442,393	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	625,000	796,831	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	710,000	921,601	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	640,000	817,990	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	450,000	566,577	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	660,000	831,811	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	760,000	958,816	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	620,000	782,967	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	640,000	780,896	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	900,000	1,098,819	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	800,000	995,720	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	770,000	924,477	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	930,000	1,117,050	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	880,000	934,225	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	840,000	792,800	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	860,000	850,428	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	790,000	798,863	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	630,000	667,157	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	790,000	836,033	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	820,000	867,182	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	770,000	813,728	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	1,280,000	1,351,705	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	630,000	649,227	2048/6/20

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60回利付国債 (30年)	0.9	730,000	787,940	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	690,000	708,857	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	610,000	594,731	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	600,000	568,404	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	900,000	850,194	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	650,000	613,021	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	280,000	263,631	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	1,290,000	1,280,479	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	790,000	783,150	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	940,000	956,412	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	100,000	101,631	2051/3/20
第56回利付国債 (20年)	2.0	349,000	357,198	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	151,042	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	489,000	503,352	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	295,060	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	342,000	355,926	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	341,000	357,402	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	218,000	229,597	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	70,000	73,541	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	646,000	689,185	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	222,000	239,542	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	171,644	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	434,000	466,701	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	320,000	344,688	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	343,688	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	475,000	515,907	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	215,676	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	110,000	119,047	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	310,000	335,826	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	54,371	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	215,000	234,685	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	250,000	273,147	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	462,000	506,800	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	213,000	234,734	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	470,000	515,782	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	290,000	321,027	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	575,121	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	250,000	277,967	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	902,530	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	210,000	234,658	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	800,000	898,352	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	528,053	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	632,000	709,571	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	190,000	213,172	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	615,000	693,621	2027/3/20

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95回利付国債 (20年)	2.3	617,000	706,637	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	220,000	249,264	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	243,000	278,128	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	270,000	307,308	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	845,000	966,037	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	660,000	762,102	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	373,000	435,831	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	330,000	387,363	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	440,000	513,348	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	345,738	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	570,000	659,507	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	361,000	420,348	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	367,000	426,263	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	573,120	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	500,000	575,045	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	596,000	694,816	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	411,000	484,277	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	440,000	514,879	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	562,000	660,063	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,202,253	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	654,000	776,474	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	246,000	293,128	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	810,000	958,027	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	76,000	89,552	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	160,000	185,627	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	260,000	296,925	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	609,000	714,247	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	100,000	116,351	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	518,000	618,916	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	900,000	1,066,743	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	934,000	1,128,654	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	350,000	412,667	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	954,000	1,128,028	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	280,000	328,269	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,062,000	1,248,327	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	290,000	337,905	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	187,000	218,397	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	970,000	1,143,048	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	1,265,000	1,494,255	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	130,000	150,771	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	952,000	1,116,819	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	230,000	264,780	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	10,000	11,621	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,277,000	1,502,198	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	220,000	259,340	2032/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第142回利付国債 (20年)	1.8	1,320,000	1,571,130	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,060,000	1,239,701	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,560,000	1,847,445	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,230,000	1,459,505	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,640,000	1,929,410	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	840,000	979,893	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,420,000	1,658,900	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,510,000	1,746,843	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,490,000	1,686,233	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,180,000	1,336,338	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,390,000	1,594,260	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,110,000	1,258,751	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,320,000	1,460,527	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,050,000	1,070,254	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	1,300,000	1,284,920	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	930,000	959,415	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	1,120,000	1,171,833	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	1,250,000	1,325,650	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	870,000	908,697	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,790,000	1,867,882	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	1,160,000	1,209,300	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,240,000	1,271,620	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,300,000	1,331,460	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,860,000	1,964,904	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	920,000	939,761	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	1,070,000	1,073,573	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	1,060,000	1,042,976	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	920,000	903,486	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	940,000	922,121	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,080,000	1,077,159	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	1,230,000	1,224,563	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	1,540,000	1,531,730	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	1,160,000	1,174,674	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	500,000	505,935	2041/3/20
小 計		242,655,000	259,888,132	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	20,644	2023/6/20
第4回東京都公募公債 (20年)	2.22	200,000	214,834	2024/9/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	13,446	2038/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	93,160	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	94,152	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	139,335	2030/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	115,751	2033/3/18
第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	100,000	97,418	2036/6/20
第711回東京都公募公債	0.82	300,000	303,300	2022/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第714回東京都公募公債	0.74	100,000	101,174	2022/12/20
第719回東京都公募公債	0.86	100,000	101,576	2023/3/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	101,664	2023/6/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	101,939	2024/3/19
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	101,132	2022/10/31
平成25年度第7回北海道公募公債	0.8	150,000	152,692	2023/8/30
平成29年度第15回北海道公募公債	0.23	117,000	118,155	2028/2/28
第29回1号宮城県公募公債	0.68	100,000	101,645	2023/10/25
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	85,961	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	109,405	2036/6/20
第13回神奈川県公募公債(20年)	2.21	100,000	117,860	2029/12/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,473	2034/9/20
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	100,907	2022/6/20
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	100,000	117,316	2033/9/27
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	56,477	2022/3/29
第375回大阪府公募公債	0.835	100,000	101,873	2023/8/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	108,016	2023/9/27
第378回大阪府公募公債	0.7	100,000	101,732	2023/11/28
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	203,934	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	203,504	2024/9/27
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	111,864	2025/2/26
第429回大阪府公募公債	0.197	103,000	103,787	2028/2/25
第464回大阪府公募公債	0.072	400,000	396,248	2031/1/28
平成26年度第2回京都府公募公債(15年)	1.071	200,000	215,248	2029/4/27
第1回兵庫県公募公債(15年)	1.66	300,000	325,035	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	40,000	53,508	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	108,098	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	108,562	2028/5/26
第10回兵庫県公募公債(20年)	2.24	100,000	118,224	2030/2/22
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	101,078	2022/10/19
第11回静岡県公募公債(20年)	1.841	350,000	405,265	2030/10/18
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	116,677	2032/6/18
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	101,105	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	102,018	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	132,197	2023/10/24
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	300,000	352,770	2029/6/20
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	101,184	2022/11/30
平成24年度第15回愛知県公募公債	0.744	250,000	252,985	2022/12/27
平成30年度第8回愛知県公募公債	0.255	200,000	202,540	2028/8/31
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	0.414	100,000	100,711	2036/9/26
第16回埼玉県公募公債(20年)	1.216	100,000	112,441	2035/8/14
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,205	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	94,439	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	104,493	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	2.116	400,000	476,048	2031/2/21

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成24年度第11回福岡県公募公債	0.8	100,000	101,419	2023/2/27
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	100,000	101,560	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債	0.654	100,000	102,010	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,074	2025/12/25
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	80,000	92,641	2030/10/11
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	101,231	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	83,418	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	100,000	101,674	2023/11/24
第7回群馬県公募公債(20年)	0.313	100,000	99,396	2036/6/13
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	101,425	2022/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債	0.476	203,400	207,588	2025/10/30
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	400,000	404,420	2022/9/22
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	101,145	2022/12/22
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	500,000	509,090	2023/6/23
第124回共同発行市場公募地方債	0.91	400,000	407,928	2023/7/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,645	2023/10/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,029	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,810	2024/2/23
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,478	2025/1/24
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,553	2025/4/25
平成30年度第1回福島県公募公債	0.264	100,000	101,305	2028/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債	0.65	100,000	101,632	2023/11/29
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	50,575	2022/10/26
平成24年度第1回浜松市公募公債	0.844	100,000	101,423	2023/1/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	164,268	2024/1/24
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	117,494	2028/9/21
第15回大阪市公募公債(20年)	2.12	100,000	118,903	2031/1/24
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,067	2022/1/27
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	105,164	2023/12/20
第1回名古屋市公募公債(30年)	2.53	100,000	130,104	2035/3/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	94,171	2029/8/17
第1回京都市公募公債(15年)	0.781	100,000	105,977	2030/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	56,422	2026/12/18
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	101,142	2022/10/21
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	2.08	200,000	230,166	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	116,182	2030/9/13
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	218,826	2025/12/19
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	93,312	2029/10/19
平成24年度第2回横浜市公募公債	0.815	100,000	101,153	2022/10/17
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	101,160	2022/12/22
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	204,520	2025/6/16
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	400,000	408,680	2025/8/18
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	69,645	2033/5/20
第33回横浜市公募公債(20年)	0.323	100,000	99,614	2036/4/28
第35回横浜市公募公債(20年)	0.443	300,000	303,198	2036/10/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	106,406	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	117,807	2031/7/29
平成24年度第10回札幌市公募公債	0.8	100,000	101,270	2022/12/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	115,941	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	100,000	101,857	2023/12/26
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	2.14	100,000	116,854	2029/9/18
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	200,000	202,324	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,821	2023/10/24
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	101,865	2023/12/27
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	101,627	2025/4/24
平成30年度第1回山梨県公募公債	0.289	100,000	101,514	2028/10/30
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	199,662	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債	2.34	100,000	115,477	2028/12/20
小 計		14,919,160	15,856,280	
特殊債券(除く金融債)				
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	116,038	2028/11/28
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	132,989	2040/2/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	116,773	2031/10/31
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000	116,617	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	100,000	126,050	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	659,000	665,794	2022/6/30
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	191,000	192,976	2022/7/29
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	430,000	435,095	2022/10/31
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	301,000	305,403	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	170,700	172,852	2023/3/17
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	153,000	154,667	2023/4/28
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	323,000	329,495	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	308,000	313,845	2023/9/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	124,000	126,356	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	114,534	2034/8/31
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	183,000	186,149	2024/11/29
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,027	2022/8/15
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.791	252,000	254,915	2022/10/18
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	400,000	404,784	2022/12/16
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.834	101,000	102,451	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,468	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,214	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,434	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	162,865	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	200,000	203,636	2024/3/15
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	315,000	321,101	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	101,958	2024/6/14
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	244,272	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	302,000	307,777	2025/6/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	150,000	152,479	2025/11/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	174,000	174,041	2026/3/13
第106回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	116,000	116,713	2028/3/14
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	101,484	2023/2/24
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,358	2023/12/18
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	200,000	202,540	2023/3/22
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	100,000	112,042	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	45,161	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	147,940	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	300,000	342,051	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	200,000	228,456	2027/10/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	300,000	399,273	2034/6/20
第38回道路債券(財投機関債)	2.26	200,000	214,994	2024/9/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	150,000	176,428	2032/3/19
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	203,814	2023/3/20
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	100,000	118,596	2044/12/20
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	100,000	110,421	2035/3/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	131,448	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	112,603	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	58,525	2029/6/28
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,379	2023/3/22
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	105,240	2023/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.043	100,000	116,840	2030/6/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	53,888	2024/9/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.851	100,000	115,604	2030/10/28
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	95,572	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	93,190	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	167,242	2026/3/24
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	115,656	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	72,159	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	58,667	2033/1/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	500,000	506,120	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	112,688	2035/6/28
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.609	100,000	109,978	2028/1/28
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.314	100,000	104,935	2025/3/7
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	112,522	2030/3/19
F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.605	100,000	116,861	2035/4/27
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	93,976	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	92,847	2030/10/29
第5回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.23	200,000	215,702	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.175	400,000	401,668	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.225	100,000	100,739	2028/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,614	11,895	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	11,973	12,292	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	12,950	13,406	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	12,220	12,585	2037/11/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.18	56,796	56,753	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	60,888	60,882	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	12,037	12,334	2042/8/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.08	73,289	73,083	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	10,412	10,481	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	11,026	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	11,982	12,260	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	12,853	13,267	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	10,896	11,060	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	13,144	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	11,519	11,775	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	13,737	14,387	2039/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	11,922	12,249	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	13,298	13,810	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	11,129	11,235	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	11,189	11,304	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	10,569	10,677	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	10,555	10,689	2039/7/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	10,331	10,390	2040/5/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	12,317	12,609	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	24,720	26,365	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	24,749	26,319	2045/4/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	12,396	12,747	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	26,566	28,053	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	11,871	12,125	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	27,669	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	12,738	13,169	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	11,635	11,941	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	30,861	32,715	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	29,770	31,716	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	25,284	26,782	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	23,110	24,497	2046/4/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	25,053	26,465	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	27,881	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	11,799	12,166	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	28,334	29,928	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	31,093	32,797	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	34,221	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	36,086	38,058	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	38,089	40,262	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	41,415	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	40,818	42,762	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	40,767	42,535	2047/8/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	38,448	40,335	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	43,702	46,095	2048/7/10

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76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	37,671	39,435	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	32,548	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	39,146	40,772	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	43,039	44,860	2049/2/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	89,548	93,124	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	92,370	96,128	2049/6/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	49,692	51,562	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	50,949	52,686	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	53,506	54,976	2050/1/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.81	65,750	67,859	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	64,871	67,276	2050/7/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	100,000	107,740	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	68,057	70,479	2050/12/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	76,670	77,097	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.19	235,212	234,153	2051/8/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	405,740	410,746	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	171,499	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	165,774	167,653	2052/7/10
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	117,122	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	83,565	84,381	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	84,134	84,945	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	85,629	86,670	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	86,402	2053/3/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	86,396	87,282	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	87,071	87,763	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	88,115	89,114	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	88,538	89,727	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	90,150	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.192	100,000	107,827	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	92,140	91,600	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	187,194	186,052	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.26	188,830	188,359	2054/12/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.37	97,616	98,204	2055/9/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	200,000	201,614	2056/5/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.129	180,000	198,826	2035/11/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	54,109	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	82,392	2031/6/13
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	50,187	2021/9/17
第78回中日本高速道路		0.06	300,000	300,180	2024/5/29
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	202,370	2026/2/12
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.905	100,000	106,191	2029/11/27
小	計		16,937,895	17,942,101	
金融債券					
い第806号商工債券		0.1	100,000	100,084	2022/7/27
い第814号商工債券		0.17	200,000	200,504	2023/3/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	%	千円	千円	
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,963	2024/9/27
い第848号商工債券	0.1	100,000	100,023	2026/1/27
い第818号農林債券	0.08	200,000	200,220	2023/7/27
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,256	2023/1/27
第11号商工債券(10年)	0.66	300,000	305,919	2024/9/20
第236号商工債券(3年)	0.02	200,000	199,972	2022/9/27
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	102,052	2025/9/26
小 計		1,500,000	1,508,993	
普通社債券				
第567回東京電力	1.958	100,000	109,374	2030/7/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,219	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	300,000	307,446	2024/5/24
第508回関西電力	0.455	200,000	202,818	2027/4/23
第510回関西電力	0.49	200,000	203,176	2027/7/23
第518回関西電力	0.44	100,000	101,220	2028/6/20
第532回関西電力	0.18	100,000	100,302	2024/7/25
第381回中国電力	0.953	100,000	102,662	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	102,582	2025/7/25
第409回中国電力	0.4	200,000	202,244	2028/9/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	102,290	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	104,625	2026/6/25
第322回北陸電力	0.38	100,000	101,149	2027/6/25
第475回東北電力	0.809	300,000	307,398	2024/9/25
第509回東北電力	0.2	100,000	100,423	2024/5/24
第529回東北電力	0.07	300,000	299,334	2026/4/24
第427回九州電力	1.024	100,000	102,902	2024/5/24
第449回九州電力	0.43	300,000	304,323	2027/4/23
第484回九州電力	0.375	200,000	201,246	2029/11/22
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13回日本たばこ産業	0.355	200,000	200,786	2028/9/8
第6回ヒューリック	0.494	200,000	200,286	2028/10/20
第9回クラレ	0.34	100,000	100,240	2027/4/30
第42回王子ホールディングス	0.08	200,000	200,108	2026/3/24
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	100,614	2028/3/23
第6回ヤフー	0.35	100,000	99,503	2024/12/6
第15回Zホールディングス	0.35	400,000	400,288	2023/6/9
第11回ブリヂストン	0.295	100,000	100,328	2027/4/21
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	100,006	2028/2/25
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,005	2027/5/20
第51回日本精工	0.19	100,000	99,145	2026/9/2
第19回日立製作所	0.16	100,000	99,396	2027/3/12
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,301	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	300,000	299,799	2028/3/17
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,027	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	200,000	200,150	2025/10/10

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26回トヨタ自動車(サステナビリティ)	0.05	300,000	300,144	2026/3/18
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	100,152	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,028	2024/8/2
第86回クレディセゾン	0.09	300,000	299,574	2026/4/15
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	200,000	202,192	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	200,000	200,012	2028/5/31
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	106,834	2025/11/12
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.16	200,000	216,166	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	115,925	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	103,136	2022/10/27
第28回芙蓉総合リース	0.14	300,000	299,721	2026/4/21
第4回みずほリース	0.24	100,000	100,249	2025/10/7
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	100,444	2025/12/19
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	100,000	100,725	2027/12/20
第31回東京センチュリー	0.01	300,000	299,679	2024/4/26
第32回東京センチュリー	0.09	300,000	299,571	2026/4/27
第64回ホンダファイナンス	0.001	300,000	299,649	2023/9/19
第65回ホンダファイナンス	0.16	100,000	100,139	2025/9/19
第95回トヨタファイナンス	0.001	300,000	300,096	2024/4/15
第96回トヨタファイナンス	0.06	500,000	500,120	2026/4/15
第31回リコーリース	0.3	100,000	100,619	2025/1/23
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,959	2022/7/12
第39回リコーリース	0.05	300,000	299,769	2023/7/14
第40回リコーリース	0.04	200,000	199,818	2024/4/19
第41回リコーリース	0.14	300,000	299,574	2026/4/17
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,898	2023/3/20
第79回アコム	0.29	200,000	199,686	2025/2/28
第80回アコム	0.28	100,000	99,676	2026/2/26
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	101,489	2023/3/20
第70回日立キャピタル	0.2	200,000	200,416	2022/12/20
第87回日立キャピタル	0.06	300,000	299,913	2024/1/19
第201回オリックス	0.07	300,000	299,571	2026/4/21
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	200,000	200,580	2023/11/27
第30回三井住友ファイナンス&リース	0.01	200,000	199,752	2023/8/10
第69回三菱UFJリース	0.24	300,000	301,242	2026/7/10
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	107,573	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	100,000	100,055	2022/8/10
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000	101,856	2024/9/20
第12回森トラスト総合リート投資法人	0.1	100,000	99,514	2023/2/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,822	2027/9/17
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	125,848	2044/1/29
第163回東日本旅客鉄道	0.05	300,000	299,484	2026/4/15
第73回西日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,654	2026/4/22
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	101,824	2022/12/20
第17回東海旅客鉄道	2.21	200,000	214,550	2024/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第50回	阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	100,801	2028/9/13
第58回	阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,911	2026/2/26
第64回	名古屋鉄道	0.09	100,000	99,740	2026/3/23
第5回	ソフトバンク	0.1	600,000	599,532	2023/7/28
第39回	電源開発	0.929	100,000	102,408	2024/2/20
第57回	電源開発	0.355	100,000	100,748	2028/7/20
第6回	東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,989	2027/8/31
第13回	東京電力パワーグリッド	0.77	100,000	101,206	2028/4/19
第28回	東京電力パワーグリッド	1.01	200,000	204,880	2029/7/10
第31回	東京電力パワーグリッド	0.98	200,000	204,464	2029/10/9
第33回	東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	202,460	2027/1/27
第38回	東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,206	2025/7/16
第41回	東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	101,115	2026/10/8
第13回	広島ガス	0.405	100,000	100,761	2028/9/13
第7回	ファーストリテイリング	0.405	100,000	101,365	2028/6/6
第14回	フランス相互信用連合銀行	0.563	200,000	200,314	2021/10/15
第19回	フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	103,108	2025/10/15
第29回	フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,886	2024/10/10
第8回	新韓銀行	0.52	100,000	100,143	2022/11/2
第17回	ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	200,000	199,812	2023/1/25
第17回	ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	100,000	100,167	2024/1/23
小	計		17,350,000	17,533,409	
合	計		293,362,055	312,728,916	

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 757	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 312,728,916	% 97.8
コール・ローン等、その他	7,146,774	2.2
投資信託財産総額	319,875,690	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	319,873,020,657
コール・ローン等	2,210,594,182
公社債(評価額)	312,728,916,071
未収入金	4,330,705,000
未収利息	576,666,066
前払費用	25,209,338
差入委託証拠金	930,000
(B) 負債	5,701,129,489
未払金	766,341,000
未払解約金	4,934,787,787
未払利息	702
(C) 純資産総額(A-B)	314,171,891,168
元本	233,376,402,849
次期繰越損益金	80,795,488,319
(D) 受益権総口数	233,376,402,849口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,462円

<注記事項>

- ①期首元本額 466,348,174,986円
 期中追加設定元本額 96,915,618,453円
 期中一部解約元本額 329,887,390,590円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,462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)

MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	130,227,934,697円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,250,021,186円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	9,511,028,717円
eMAXIS 国内債券インデックス	8,920,095,654円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	7,880,689,781円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	7,471,160,313円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,074,963,326円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	5,016,505,893円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	4,228,400,573円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	4,195,222,287円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,190,127,250円
つみたて8資産均等バランス	3,649,329,900円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,242,382,974円
国内債券セレクション(ラップ向け)	2,969,972,542円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,957,709,360円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	2,731,670,779円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)	2,524,306,261円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)	2,195,094,139円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)	1,594,524,367円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,570,857,172円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	1,150,453,604円
つみたて4資産均等バランス	1,087,803,776円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	1,073,408,843円

○損益の状況 (2020年5月13日~2021年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,200,071,097
受取利息	3,200,872,378
支払利息	△ 801,281
(B) 有価証券売買損益	△ 6,193,092,132
売買益	351,754,219
売買損	△ 6,544,846,351
(C) 先物取引等取引損益	3,345,900
取引益	12,693,100
取引損	△ 9,347,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,989,675,135
(E) 前期繰越損益金	164,357,642,974
(F) 追加信託差損益金	33,433,724,627
(G) 解約差損益金	△114,006,204,147
(H) 計(D+E+F+G)	80,795,488,319
次期繰越損益金(H)	80,795,488,319

(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。

e MAX I S 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,010,323,103円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	792,264,863円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	651,406,232円
e MAX I S バランス (4資産均等型)	649,786,652円
三菱UFJ バランスファンドVA 5 0型 (適格機関投資家限定)	537,708,078円
e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)	537,108,141円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	465,909,803円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	464,145,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	464,110,790円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	463,972,979円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	335,833,749円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	321,781,869円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	266,875,370円
e MAX I S 最適化バランス (マイフォワード)	144,491,667円
三菱UFJ バランスVA 6 0 D (適格機関投資家限定)	133,386,984円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	105,076,539円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	101,103,687円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	97,813,407円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	91,378,383円
三菱UFJ バランスVA 6 0 G (適格機関投資家限定)	78,943,615円
三菱UFJ バランスVA 3 0 D (適格機関投資家限定)	77,592,039円
e MAX I S バランス (波乗り型)	75,833,484円
三菱UFJ バランスファンド4 5 VA (適格機関投資家限定)	69,507,712円
e MAX I S 債券バランス (2資産均等型)	65,901,754円
三菱UFJ バランスVA 3 0 G (適格機関投資家限定)	52,399,445円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	31,304,318円
三菱UFJ バランスファンド5 5 VA (適格機関投資家限定)	20,824,787円
e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)	19,941,988円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	16,802,578円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	13,042,993円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	11,970,062円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	8,568,340円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	8,528,748円
e MAX I S マイマネージャー 1970s	4,793,749円
コアバランス	2,317,696円
三菱UFJ バランスファンドVA 3 0型 (適格機関投資家限定)	2,212,911円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,805,991円
ラップ向けインデックスf 国内債券	743,627円
e MAX I S マイマネージャー 1980s	734,329円
e MAX I S マイマネージャー 1990s	105,082円
合計	233,376,402,849円

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

《繰上償還(第22期)》信託終了日2021年12月27日

[計算期間：2021年5月21日～2021年12月27日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、12月27日に繰り上げて償還させていただきます。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22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 銭	%		%	%	%	百万円
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
(償還時)	(償還価額)						
22期(2021年12月27日)	14,095.77	0.2	387.367	0.2	—	—	300

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。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
	円 銭	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年5月20日	14,062	—	386.560	—	99.5	0.2
5月末	14,064	0.0	386.621	0.0	100.3	0.2
6月末	14,072	0.1	386.903	0.1	100.2	0.2
7月末	14,142	0.6	388.809	0.6	99.3	0.3
8月末	14,131	0.5	388.461	0.5	100.3	0.3
9月末	14,083	0.1	387.116	0.1	100.5	0.2
10月末	14,067	0.0	386.721	0.0	100.3	—
11月末	14,096	0.2	387.655	0.3	—	—
(償還時) 2021年12月27日	(償還価額) 14,095.77	0.2	387.367	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

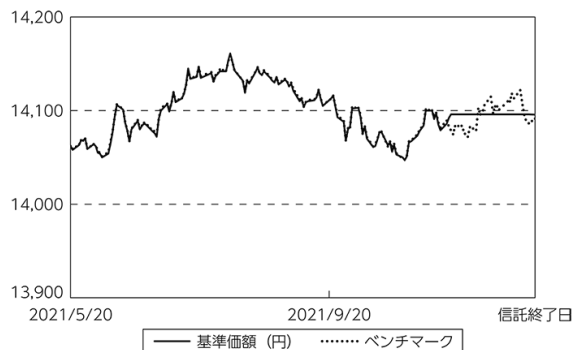
◎基準価額の動き

償還価額は期首に比べ0.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.2%)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。

期首から償還に向け保有資産を売却し始めた2021年11月中旬までは、基準価額はベンチマークに連動した動きとなりました。

11月中旬から信託終了日にかけては、基準価額はほぼ横ばい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。
- ・ 国内債券市況は、期の前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上昇したあと、インフレ懸念による米金利の上昇などを受けて反落しました。その後、新たに確認されたオミクロン変異株への懸念などから国内債券市況は上昇し、期を通してみても上昇しました。

● 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。
- ・ 第22期(2021年5月21日～信託終了日)は、前記の運用を維持しましたが、2021年11月中旬に保有資産の売却を行いました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは0.2%の上昇になったため、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)

- ・ ポートフォリオ要因[※]によるものです。
※償還に向け保有資産を売却したことによる要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ ありません。

● 償還価額

償還価額は、14,095円77銭となりました。

○1万口当たりの費用明細

(2021年5月21日～2021年12月27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、14,098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

(2021年5月21日～2021年12月27日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	44,972,433	286,311,547
	地方債証券	6,221,407	20,307,541 (186,000)
内	特殊債券	1,634,438	17,196,459 (193,593)
	社債券	4,209,964	20,356,857 (300,000)

(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 1,516	百万円 2,121	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月21日～2021年12月27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	57,038	16,735	29.3	344,172	3,480	1.0

(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 100	百万円 1,221	百万円 —

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 2,000

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12月27日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2021年12月27日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 300,080	% 100.0
投資信託財産総額	300,080	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2021年12月27日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	300,080,509
コール・ローン等	300,080,509
(B) 負債	151
未払利息	151
(C) 純資産総額(A-B)	300,080,358
元本	212,886,744
償還差益金	87,193,614
(D) 受益権総口数	212,886,744口
1万口当たり償還価額(C/D)	14,095円77銭

<注記事項>

- ①期首元本額 206,012,246,620円
 期中追加設定元本額 22,215,152,275円
 期中一部解約元本額 228,014,512,151円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.409577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） 212,886,744円

【お知らせ】

当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が、当該投資信託を投資対象から除外することとなるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。
 (2021年12月27日)

○損益の状況 (2021年5月21日～2021年12月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,044,155,361
受取利息	1,044,333,301
支払利息	△ 177,940
(B) 有価証券売買損益	△ 329,342,754
売買益	321,599,744
売買損	△ 650,942,498
(C) 先物取引等取引損益	△ 366,400
取引益	2,786,800
取引損	△ 3,153,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	714,446,207
(E) 前期繰越損益金	83,687,328,198
(F) 追加信託差損益金	9,084,893,088
(G) 解約差損益金	△93,399,473,879
償還差益金(D+E+F+G)	87,193,614

(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。