

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／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27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ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
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およびヘッジ付外国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、日本を含む先進国の公社債に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。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

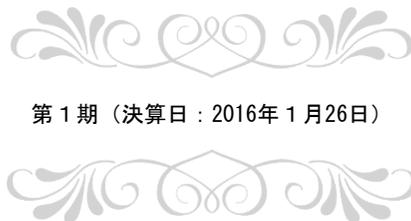
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）



イーマックス

eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）



第1期（決算日：2016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「eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）」は、去る1月26日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

URL:<http://www.am.mufig.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）のご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇運用経過	2
◇今後の運用方針	9
◇1万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	11
◇利害関係人との取引状況等	11
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	12
◇組入資産の明細	12
◇投資信託財産の構成	12
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	13
◇損益の状況	13
◇お知らせ	14

マザーファンドのご報告

◇日本債券インデックスマザーファンド	38
◇ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	67

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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配率)	基準価額			合成ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み入金	期騰落率	期騰落率	中率			
(設定日)	円	円		%		%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	—	—	—	10,000	—	—	—	1
1期(2016年1月26日)	10,141	0	1.4		10,163	1.6	96.9	0.0	537

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合およびシティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)を50%ずつ組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		合成ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日)	円	%		%	%	%
2015年8月27日	10,000	—	10,000	—	—	—
8月末	9,990	△0.1	9,992	△0.1	94.6	0.2
9月末	10,046	0.5	10,049	0.5	97.3	0.1
10月末	10,064	0.6	10,072	0.7	97.6	0.1
11月末	10,067	0.7	10,080	0.8	95.4	0.0
12月末	10,053	0.5	10,070	0.7	100.4	—
(期末)						
2016年1月26日	10,141	1.4	10,163	1.6	96.9	0.0

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

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

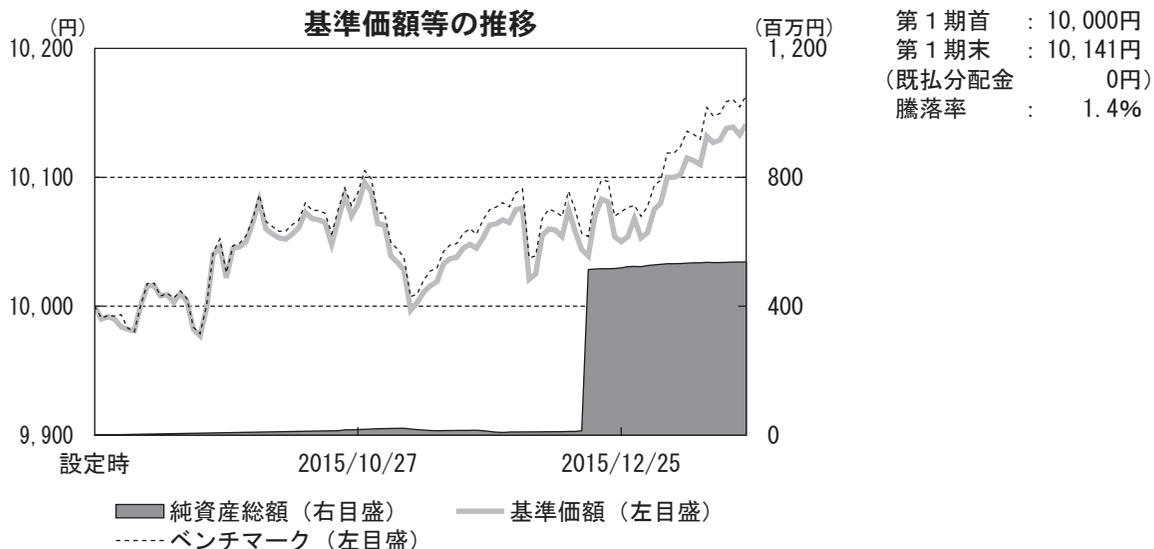
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第1期 : 2015/8/27~2016/1/26)

基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ1.4%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.6%)を0.2%下回りました。

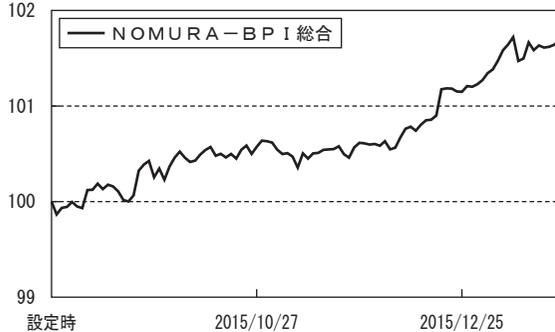


基準価額の主な変動要因

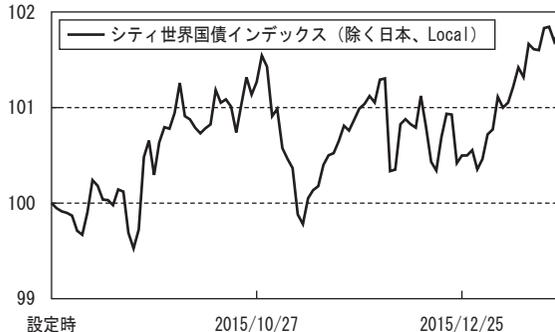
上昇要因	債券市況の上昇が、基準価額のプラス要因となりました。
------	----------------------------

投資環境について

（第1期：2015/8/27～2016/1/26）

市況の推移
（設定時を100として指数化）

（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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合は野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

市況の推移
（設定時を100として指数化）

（注）シティ世界国債インデックス（除く日本、Local）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎国内債券市況

- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇（金利は低下）基調となりました。

◎外国債券市況

- ・外国債券市況は、新興国の景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

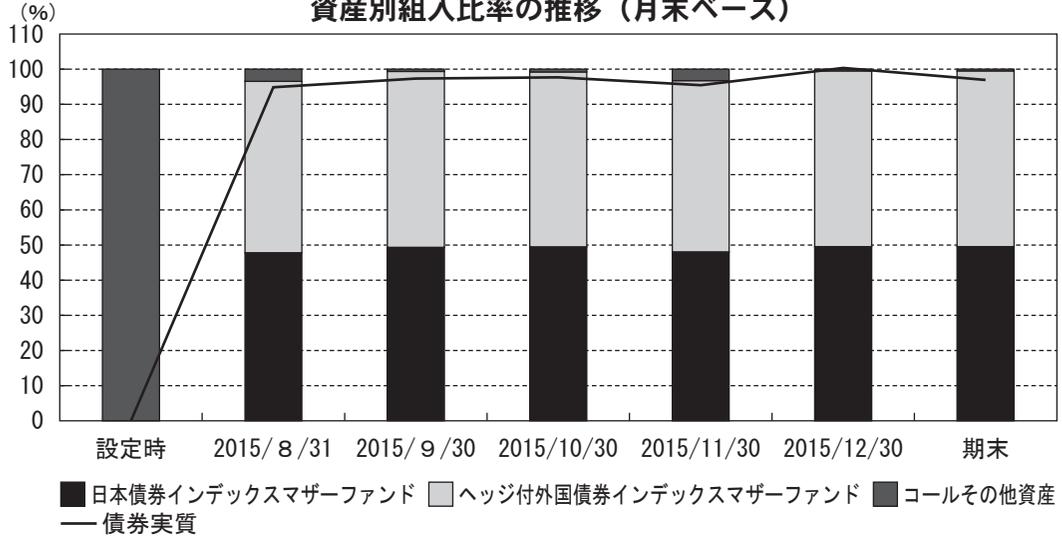
当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

- ・日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

(ご参考)

資産別組入比率の推移（月末ベース）



<日本債券インデックスマザーファンド>

基準価額は設定時に比べ1.7%の上昇となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期末（2016年1月26日）

最終利回り	0.3%
直接利回り	1.1%
デュレーション	8.3年

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

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

基準価額は設定時に比べ1.5%の上昇となりました。

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・為替変動の影響を回避するため、組入外貨建資産は原則として100%程度の為替ヘッジを行いました。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期末（2016年1月26日）

最終利回り	1.2%
直接利回り	2.4%
デュレーション	6.5年

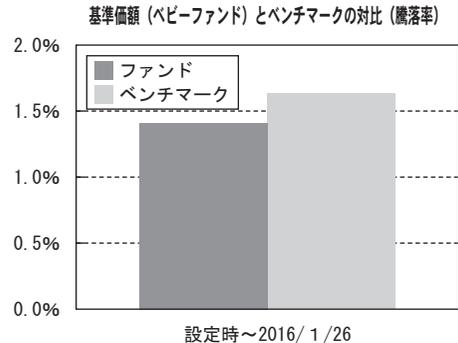
- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）＞
 基準価額の騰落率は1.4%の上昇となり、ベンチマークの1.6%の上昇を0.2%下回りました。
 差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

日本債券インデックスマザーファンド 0.0%程度
 ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド △0.0%程度
 その他（信託報酬等） △0.2%程度



＜日本債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークは1.7%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は0.0%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・ 公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
- ・ ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・ 年限構成、種別構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・ 流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、0.0%程度となりました。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは1.6%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・ 期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・ 為替ヘッジ効果、コストディーフィー、取引コスト等による要因です。
 為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%程度でした。

- ・ 為替の効果および債券の効果による要因です。
 為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
 債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

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1期
	2015年8月27日～2016年1月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	141

(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

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

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

< ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

- ・今後の運用についても、当ファンドの運用方針を堅持します。
- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1万口当たりの費用明細

（2015年8月27日～2016年1月26日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	18	0.181	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× （期中の日数÷年間日数）
（ 投 信 会 社 ）	（ 8 ）	（ 0.079 ）	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 ）	（ 0.079 ）	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 ）	（ 2 ）	（ 0.023 ）	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	（ 0 ）	（ 0.000 ）	
(c) そ の 他 費 用	3	0.028	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	（ 1 ）	（ 0.006 ）	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	（ 0 ）	（ 0.002 ）	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	（ 2 ）	（ 0.019 ）	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	21	0.209	
期中の平均基準価額は、10,044円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年8月27日～2016年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	218,864	272,793	5,795	7,229
日本債券インデックスマザーファンド	211,683	270,645	5,159	6,573

○利害関係人との取引状況等

(2015年8月27日～2016年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

該当事項はございません。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	94,960	29,444	31.0	40,778	24,597	60.3

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

< ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	254,583	114,420	44.9	266,726	125,795	47.2
為替直物取引	13,055	10,314	79.0	910	89	9.8

平均保有割合 0.2%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

< 日本債券インデックスマザーファンド >

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 528	百万円 -	百万円 1,784

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2016年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 213,069	千円 268,744
日本債券インデックスマザーファンド	206,524	266,250

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 268,744	% 50.0
日本債券インデックスマザーファンド	266,250	49.5
コール・ローン等、その他	3,022	0.5
投資信託財産総額	538,016	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（55,640,906千円）の投資信託財産総額（57,482,001千円）に対する比率は96.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=118.14円	1 カナダドル=82.70円	1 メキシコペソ=6.35円	1 ユーロ=128.15円
1 イギリスポンド=167.92円	1 スイスフラン=116.51円	1 スウェーデンクローネ=13.79円	1 ノルウェークローネ=13.48円
1 デンマーククローネ=17.17円	1 ポーランドズロチ=28.60円	1 オーストラリアドル=82.02円	1 シンガポールドル=82.49円
1 南アフリカランド=7.14円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年1月26日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	538,016,771
コール・ローン等	3,021,273
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	268,744,702
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	266,250,792
未収利息	4
(B) 負債	358,706
未払解約金	92,490
未払信託報酬	263,883
その他未払費用	2,333
(C) 純資産総額(A-B)	537,658,065
元本	530,165,987
次期繰越損益金	7,492,078
(D) 受益権総口数	530,165,987口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,141円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 546,580,518円
 期中一部解約元本額 17,414,531円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0141円です。

②分配金の計算過程

項目	2015年8月27日～ 2016年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,417,828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	3,675,549円
収益調整金額	2,398,701円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	7,492,078円
1万口当たり収益分配対象額	141円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2015年8月27日～2016年1月26日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	21,785
受取利息	185
その他収益金	21,600
(B) 有価証券売買損益	5,359,408
売買益	5,393,442
売買損	△ 34,034
(C) 信託報酬等	△ 287,816
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,093,377
(E) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	2,398,701 (2,398,701)
(F) 計(D+E)	7,492,078
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	7,492,078
追加信託差損益金 (配当等相当額)	2,398,701 (779,419)
(売買損益相当額)	(1,619,282)
分配準備積立金	5,093,377

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (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) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*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 (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

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

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年1月26日現在）

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体（358,800,295千円）の内容です。

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	343,831,000 (100,000)	372,014,683 (100,401)	80.4 (0.0)	— (—)	49.1 (—)	22.2 (0.0)	9.1 (—)	
地方債証券	25,157,360 (25,157,360)	26,619,600 (26,619,600)	5.8 (5.8)	— (—)	3.9 (3.9)	1.7 (1.7)	0.2 (0.2)	
特殊債券 (除く金融債)	31,776,680 (31,776,680)	33,746,423 (33,746,423)	7.3 (7.3)	— (—)	5.1 (5.1)	1.5 (1.5)	0.7 (0.7)	
金融債券	4,040,000 (4,040,000)	4,055,157 (4,055,157)	0.9 (0.9)	— (—)	0.0 (0.0)	0.7 (0.7)	0.2 (0.2)	
普通社債券	21,797,000 (21,797,000)	22,623,825 (22,623,825)	4.9 (4.9)	0.2 (0.2)	1.5 (1.5)	2.3 (2.3)	1.1 (1.1)	
合 計	426,602,040 (82,871,040)	459,059,690 (87,145,408)	99.2 (18.8)	0.2 (0.2)	59.6 (10.5)	28.4 (6.2)	11.3 (2.1)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の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349回利付国債（2年）	0.1	1,220,000	1,221,598
第350回利付国債（2年）	0.1	1,200,000	1,201,680
第351回利付国債（2年）	0.1	1,240,000	1,241,872
第353回利付国債（2年）	0.1	1,960,000	1,963,371
第355回利付国債（2年）	0.1	4,850,000	4,858,972
第356回利付国債（2年）	0.1	2,250,000	2,254,387
第357回利付国債（2年）	0.1	250,000	250,535
第358回利付国債（2年）	0.1	3,800,000	3,808,512
第360回利付国債（2年）	0.1	450,000	451,147
第103回利付国債（5年）	0.3	1,360,000	1,365,032
第104回利付国債（5年）	0.2	1,150,000	1,152,944
第105回利付国債（5年）	0.2	2,640,000	2,648,263
第106回利付国債（5年）	0.2	3,130,000	3,141,299
第107回利付国債（5年）	0.2	3,120,000	3,132,698
第108回利付国債（5年）	0.1	1,530,000	1,533,320
第109回利付国債（5年）	0.1	2,350,000	2,356,016
第110回利付国債（5年）	0.3	1,080,000	1,087,398
第111回利付国債（5年）	0.4	1,410,000	1,422,675
第112回利付国債（5年）	0.4	1,400,000	1,413,888
第113回利付国債（5年）	0.3	4,190,000	4,221,550
第114回利付国債（5年）	0.3	1,390,000	1,401,578
第115回利付国債（5年）	0.2	3,670,000	3,690,845
第116回利付国債（5年）	0.2	4,280,000	4,305,979
第117回利付国債（5年）	0.2	4,670,000	4,700,775
第118回利付国債（5年）	0.2	2,560,000	2,577,792
第119回利付国債（5年）	0.1	1,670,000	1,675,945
第120回利付国債（5年）	0.2	2,690,000	2,709,583
第121回利付国債（5年）	0.1	2,880,000	2,890,483
第122回利付国債（5年）	0.1	4,770,000	4,788,555
第123回利付国債（5年）	0.1	4,450,000	4,468,378
第124回利付国債（5年）	0.1	5,430,000	5,453,837
第125回利付国債（5年）	0.1	3,990,000	4,007,595
第126回利付国債（5年）	0.1	1,390,000	1,396,116
第1回利付国債（40年）	2.4	385,000	505,643
第2回利付国債（40年）	2.2	600,000	757,530
第3回利付国債（40年）	2.2	603,000	762,891
第4回利付国債（40年）	2.2	948,000	1,201,618
第5回利付国債（40年）	2.0	955,000	1,156,323
第6回利付国債（40年）	1.9	850,000	1,004,139
第7回利付国債（40年）	1.7	980,000	1,098,148
第8回利付国債（40年）	1.4	900,000	924,543
第285回利付国債（10年）	1.7	3,468,000	3,536,388
第286回利付国債（10年）	1.8	1,070,000	1,097,178
第287回利付国債（10年）	1.9	2,400,000	2,464,320
第288回利付国債（10年）	1.7	2,026,000	2,083,295

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289回利付国債（10年）	1.5	2,453,000	2,523,352	2017/12/20
第290回利付国債（10年）	1.4	1,640,000	1,689,839	2018/3/20
第291回利付国債（10年）	1.3	940,000	966,555	2018/3/20
第292回利付国債（10年）	1.7	794,000	823,227	2018/3/20
第293回利付国債（10年）	1.8	1,081,000	1,127,937	2018/6/20
第294回利付国債（10年）	1.7	1,570,000	1,634,417	2018/6/20
第295回利付国債（10年）	1.5	1,240,000	1,284,937	2018/6/20
第296回利付国債（10年）	1.5	2,020,000	2,100,658	2018/9/20
第297回利付国債（10年）	1.4	836,000	870,108	2018/12/20
第298回利付国債（10年）	1.3	2,640,000	2,740,082	2018/12/20
第299回利付国債（10年）	1.3	2,760,000	2,873,077	2019/3/20
第300回利付国債（10年）	1.5	957,000	1,002,227	2019/3/20
第301回利付国債（10年）	1.5	1,512,000	1,589,187	2019/6/20
第302回利付国債（10年）	1.4	1,250,000	1,309,575	2019/6/20
第303回利付国債（10年）	1.4	2,065,000	2,170,335	2019/9/20
第304回利付国債（10年）	1.3	1,170,000	1,225,411	2019/9/20
第305回利付国債（10年）	1.3	3,808,000	3,999,923	2019/12/20
第306回利付国債（10年）	1.4	2,488,000	2,631,632	2020/3/20
第307回利付国債（10年）	1.3	1,610,000	1,696,279	2020/3/20
第308回利付国債（10年）	1.3	1,374,000	1,452,125	2020/6/20
第309回利付国債（10年）	1.1	2,190,000	2,295,273	2020/6/20
第310回利付国債（10年）	1.0	3,236,000	3,384,694	2020/9/20
第311回利付国債（10年）	0.8	1,980,000	2,052,586	2020/9/20
第312回利付国債（10年）	1.2	4,030,000	4,264,546	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	2,969,000	3,165,725	2021/3/20
第314回利付国債（10年）	1.1	1,590,000	1,679,024	2021/3/20
第315回利付国債（10年）	1.2	2,013,000	2,142,073	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	1,080,000	1,143,428	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	1,557,000	1,653,191	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	1,790,000	1,890,490	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	1,519,000	1,616,990	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	2,850,000	3,017,038	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	2,515,000	2,667,761	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	1,100,000	1,160,071	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	1,675,000	1,769,654	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	2,480,000	2,604,297	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	3,635,000	3,823,111	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	1,230,000	1,287,121	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	2,440,000	2,570,125	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	2,860,000	2,976,116	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	3,210,000	3,388,540	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	2,390,000	2,523,601	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	1,480,000	1,540,798	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	3,110,000	3,236,825	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	4,060,000	4,225,607	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	3,820,000	3,975,626	2024/6/20

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335回利付国債（10年）	0.5	3,540,000	3,653,492	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	1,360,000	1,403,003	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	2,500,000	2,535,125	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	4,500,000	4,599,315	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	5,180,000	5,287,640	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	4,720,000	4,811,568	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	1,260,000	1,270,369	2025/12/20
第1回利付国債（30年）	2.8	76,000	99,662	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	98,000	123,601	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	117,000	146,093	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	127,000	169,849	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	108,000	133,914	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	169,000	214,633	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	164,000	206,023	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	142,000	167,261	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	116,000	129,143	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	196,625	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	158,732	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	269,214	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	247,180	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	626,888	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	445,661	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	389,078	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	415,597	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	535,086	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	379,298	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	495,000	637,307	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	474,121	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	490,000	630,654	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	654,000	841,541	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	411,000	529,166	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	502,000	627,801	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	974,000	1,236,775	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	850,000	1,097,358	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,091,000	1,410,652	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	1,050,000	1,338,708	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,256,000	1,579,143	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	1,368,000	1,694,869	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,369,000	1,726,815	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,634,000	1,958,986	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,476,000	1,835,509	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	1,769,000	2,123,542	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,599,000	1,920,399	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	1,637,000	1,926,683	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	985,000	1,136,227	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,280,000	1,506,636	2043/6/20

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40回利付国債（30年）	1.8	970,000	1,118,671	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	850,000	959,879	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	1,010,000	1,141,441	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,070,000	1,208,886	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	1,250,000	1,411,812	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	1,130,000	1,221,066	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	1,310,000	1,414,695	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,380,000	1,523,092	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,530,000	1,610,998	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	440,000	462,924	2045/12/20
第35回利付国債（20年）	3.3	117,000	121,434	2017/3/20
第36回利付国債（20年）	3.0	201,000	210,981	2017/9/20
第38回利付国債（20年）	2.7	400,000	423,244	2018/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	601,000	637,709	2018/9/20
第42回利付国債（20年）	2.6	869,000	940,231	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	74,000	81,819	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	480,000	529,785	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	114,000	125,623	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	209,000	234,523	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	515,000	570,640	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	200,000	221,578	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	214,000	239,307	2021/9/21
第54回利付国債（20年）	2.2	480,000	542,068	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	241,000	270,522	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	449,000	506,072	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	147,000	165,391	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	589,000	657,111	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	289,000	308,969	2023/3/20
第63回利付国債（20年）	1.8	442,000	499,146	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	441,000	502,740	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	318,000	363,537	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	500,000	567,675	2023/12/20
第68回利付国債（20年）	2.2	846,000	990,234	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	422,000	502,770	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	160,000	187,961	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	534,000	624,721	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	620,000	721,928	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	318,000	373,074	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	575,000	675,786	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	200,000	231,452	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	210,000	244,916	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	410,000	475,567	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	50,000	58,458	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	315,000	371,199	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	350,000	409,993	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	662,000	782,113	2025/9/20

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第83回利付国債（20年）	2.1	413,000	488,884
第84回利付国債（20年）	2.0	670,000	786,613
第85回利付国債（20年）	2.1	490,000	581,654
第86回利付国債（20年）	2.3	515,000	621,553
第87回利付国債（20年）	2.2	450,000	538,636
第88回利付国債（20年）	2.3	504,000	610,192
第89回利付国債（20年）	2.2	410,000	492,221
第90回利付国債（20年）	2.2	980,000	1,179,351
第91回利付国債（20年）	2.3	468,000	568,058
第92回利付国債（20年）	2.1	1,392,000	1,664,191
第93回利付国債（20年）	2.0	510,000	605,742
第94回利付国債（20年）	2.1	865,000	1,036,745
第95回利付国債（20年）	2.3	917,000	1,122,105
第96回利付国債（20年）	2.1	380,000	456,349
第97回利付国債（20年）	2.2	853,000	1,036,505
第98回利付国債（20年）	2.1	620,000	746,393
第99回利付国債（20年）	2.1	1,345,000	1,622,070
第100回利付国債（20年）	2.2	970,000	1,183,099
第101回利付国債（20年）	2.4	573,000	712,691
第102回利付国債（20年）	2.4	680,000	847,572
第103回利付国債（20年）	2.3	550,000	678,584
第104回利付国債（20年）	2.1	280,000	338,797
第105回利付国債（20年）	2.1	940,000	1,138,481
第106回利付国債（20年）	2.2	531,000	649,938
第107回利付国債（20年）	2.1	607,000	736,679
第108回利付国債（20年）	1.9	1,230,000	1,461,584
第109回利付国債（20年）	1.9	700,000	832,636
第110回利付国債（20年）	2.1	966,000	1,173,931
第111回利付国債（20年）	2.2	531,000	652,901
第112回利付国債（20年）	2.1	1,210,000	1,472,388
第113回利付国債（20年）	2.1	1,672,000	2,037,097
第114回利付国債（20年）	2.1	1,260,000	1,536,859
第115回利付国債（20年）	2.2	614,000	756,969
第116回利付国債（20年）	2.2	996,000	1,229,342
第117回利付国債（20年）	2.1	1,110,000	1,354,366
第118回利付国債（20年）	2.0	666,000	803,895
第119回利付国債（20年）	1.8	660,000	778,324
第120回利付国債（20年）	1.6	800,000	921,232
第121回利付国債（20年）	1.9	1,369,000	1,634,969
第122回利付国債（20年）	1.8	710,000	838,226
第123回利付国債（20年）	2.1	1,338,000	1,635,865
第124回利付国債（20年）	2.0	700,000	846,125
第125回利付国債（20年）	2.2	734,000	908,978
第126回利付国債（20年）	2.0	810,000	979,622
第127回利付国債（20年）	1.9	520,000	621,145
第128回利付国債（20年）	1.9	1,014,000	1,211,689

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129回利付国債（20年）		1.8	600,000	707,934	2031/6/20
第130回利付国債（20年）		1.8	912,000	1,076,205	2031/9/20
第131回利付国債（20年）		1.7	890,000	1,036,680	2031/9/20
第132回利付国債（20年）		1.7	827,000	963,182	2031/12/20
第133回利付国債（20年）		1.8	1,010,000	1,191,901	2031/12/20
第134回利付国債（20年）		1.8	965,000	1,137,899	2032/3/20
第135回利付国債（20年）		1.7	320,000	372,342	2032/3/20
第136回利付国債（20年）		1.6	770,000	883,952	2032/3/20
第137回利付国債（20年）		1.7	472,000	548,662	2032/6/20
第138回利付国債（20年）		1.5	510,000	577,207	2032/6/20
第139回利付国債（20年）		1.6	780,000	894,402	2032/6/20
第140回利付国債（20年）		1.7	1,877,000	2,179,534	2032/9/20
第141回利付国債（20年）		1.7	1,370,000	1,590,172	2032/12/20
第142回利付国債（20年）		1.8	750,000	882,630	2032/12/20
第143回利付国債（20年）		1.6	1,380,000	1,578,513	2033/3/20
第144回利付国債（20年）		1.5	1,020,000	1,151,039	2033/3/20
第145回利付国債（20年）		1.7	2,190,000	2,539,370	2033/6/20
第146回利付国債（20年）		1.7	1,950,000	2,256,228	2033/9/20
第147回利付国債（20年）		1.6	2,310,000	2,632,198	2033/12/20
第148回利付国債（20年）		1.5	1,820,000	2,039,583	2034/3/20
第149回利付国債（20年）		1.5	2,600,000	2,908,100	2034/6/20
第150回利付国債（20年）		1.4	2,420,000	2,659,870	2034/9/20
第151回利付国債（20年）		1.2	2,180,000	2,315,508	2034/12/20
第152回利付国債（20年）		1.2	2,370,000	2,510,659	2035/3/20
第153回利付国債（20年）		1.3	2,480,000	2,663,569	2035/6/20
第154回利付国債（20年）		1.2	2,070,000	2,180,931	2035/9/20
第155回利付国債（20年）		1.0	850,000	862,155	2035/12/20
第14回ポーランド共和国円貨債券（2013）		0.67	100,000	100,401	2018/11/15
小 計			343,831,000	372,014,683	
地方債証券					
第1回東京都公募公債（20年）		1.54	20,000	22,041	2023/6/20
第2回東京都公募公債（7年）		0.62	100,000	100,906	2017/9/20
第7回東京都公募公債（30年）		2.51	10,000	12,487	2038/9/17
第8回東京都公募公債（30年）		2.23	80,000	95,436	2038/9/17
第16回東京都公募公債（20年）		2.01	100,000	118,508	2028/12/20
第20回東京都公募公債（20年）		2.09	80,000	95,943	2029/9/20
第21回東京都公募公債（20年）		2.19	80,000	97,068	2029/12/20
第22回東京都公募公債（20年）		1.92	120,000	141,368	2030/6/20
第24回東京都公募公債（20年）		1.98	70,000	83,058	2031/6/20
第28回東京都公募公債（20年）		1.59	100,000	112,161	2033/3/18
第648回東京都公募公債		1.84	100,000	102,472	2017/6/20
第658回東京都公募公債		1.95	200,000	209,000	2018/6/20
第666回東京都公募公債		1.46	150,000	156,520	2019/3/20
第669回東京都公募公債		1.63	50,000	52,635	2019/6/20
第678回東京都公募公債		1.38	100,000	105,093	2019/12/20
第680回東京都公募公債		1.39	100,000	105,452	2020/3/19

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
	%	千円	千円
地方債証券			
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,493
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	104,424
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,164
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,656
第697回東京都公募公債	1.11	200,000	211,000
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	126,129
第705回東京都公募公債	1.06	70,000	74,168
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	103,502
第719回東京都公募公債	0.86	250,000	262,825
第723回東京都公募公債	0.76	200,000	208,988
第728回東京都公募公債	0.65	200,000	207,318
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	103,551
第733回東京都公募公債	0.581	100,000	102,806
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	114,542
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,519
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	103,071
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,181
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	105,016
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,960
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,727
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,005
平成24年度第13回北海道公募公債（5年）	0.23	100,000	100,156
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	202,182
第1回神奈川県公募公債（20年）	2.55	100,000	118,962
第2回神奈川県公募公債（20年）	2.23	80,000	93,289
第2回神奈川県公募公債（30年）	2.87	80,000	104,822
第3回神奈川県公募公債（20年）	2.11	100,000	116,433
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	107,697
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	113,429
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	147,805
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,295
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	252,993
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	105,538
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,372
第5回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	120,356
第11回大阪府公募公債（20年）	1.693	200,000	225,208
第89回大阪府公募公債（5年）	0.2	100,000	100,075
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	99,958
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,836
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,368
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,148
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	104,239
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,414
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,497
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,675
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,486

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
	%	千円	千円
地方債証券			
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,817
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,970
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,639
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,586
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,512
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,633
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,731
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	162,101
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	101,746
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,998
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,252
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	147,813
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	226,070
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	103,862
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	106,657
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	48,370
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	109,411
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	106,329
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	113,170
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	52,138
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	125,707
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	199,256
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	105,308
平成19年度第1回静岡県公募公債	1.77	66,900	68,421
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,060
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	104,435
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	104,076
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,458
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,710
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	107,640
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,930
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,489
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	105,732
平成23年度第6回静岡県公募公債	1.201	170,000	180,279
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	103,881
平成25年度第9回静岡県公募公債	0.679	100,000	103,808
平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年)	0.204	100,000	100,408
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	102,865
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	123,395
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	105,568
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	105,466
平成25年度第2回愛知県公募公債	0.576	200,000	206,328
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	140,000	147,249
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	102,566
平成19年度第2回広島県公募公債	1.94	46,050	47,400
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	62,799

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回広島県公募公債	1.33	26,650	28,339	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,779	2021/5/27
平成25年度第3回広島県公募公債	0.8	100,000	104,764	2023/9/25
平成19年度第3回埼玉県公募公債	1.94	39,100	40,257	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	100,000	103,118	2018/1/30
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,686	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	106,055	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	104,592	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	153,541	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	100,307	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	88,677	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	96,240	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	105,576	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	104,719	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,799	2020/10/28
平成25年度第11回福岡県公募公債	0.694	300,000	310,923	2024/2/26
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	93,345	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	93,613	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	83,398	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	83,253	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,670	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	84,643	2021/1/25
平成23年度第6回千葉県公募公債	1.11	200,000	211,986	2021/12/24
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	21,108	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,185	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	104,673	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,132	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	190,509	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,066	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	125,322	2021/11/30
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	29,724	2017/5/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	308	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,629	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	103,896	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,851	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	208,664	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	104,235	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	93,570	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	104,923	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	105,292	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,517	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,429	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	114,795	2019/12/25
第82回共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	105,335	2020/1/24
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,442	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,959	2021/2/25

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101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,260	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	210,778	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	105,476	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	70,000	74,102	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,932	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	104,309	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,655	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	261,515	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,107	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,958	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	314,097	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,899	2023/3/24
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	311,352	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	239,570	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	206,720	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	500,000	517,725	2024/4/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	206,566	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	102,873	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	400,000	409,920	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	300,000	307,080	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	500,000	509,255	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	200,788	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	101,380	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	100,772	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	204,124	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	305,877	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	304,344	2025/9/25
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	103,055	2017/12/19
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,275	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,962	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,291	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	63,517	2024/1/24
第1回大阪市公募公債（15年）	1.753	200,000	227,502	2026/7/17
第5回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	123,510	2028/9/21
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	30,750	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	131,953	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,478	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	102,562	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債（12年）	1.033	100,000	106,455	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債（20年）	2.56	100,000	119,044	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債（20年）	2.26	80,000	97,625	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	105,537	2021/12/20
第5回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	60,321	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	105,112	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,374	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	2.54	120,000	146,132	2026/6/19

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	
平成22年度第9回神戸市公募公債（20年）		2.09	80,000	95,738	2031/1/24
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	200,000	233,262	2025/12/19
第17回横浜市公募公債（20年）		2.07	80,000	95,389	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債		1.71	100,000	104,578	2018/11/16
第20回横浜市公募公債（20年）		2.1	80,000	96,011	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債		0.81	100,000	104,835	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債		0.729	100,000	104,205	2022/12/22
第25回横浜市公募公債（20年）		1.72	100,000	114,469	2032/7/16
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	60,000	67,290	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債		1.36	112,000	117,215	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）		2.277	80,000	96,394	2040/9/20
第44回川崎市公募公債（5年）		0.162	130,400	130,925	2020/6/19
第82回川崎市公募公債		1.52	100,000	105,259	2019/9/20
第17回北九州市公募公債（20年）		1.529	100,000	109,930	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債		1.52	100,000	103,458	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	91,000	94,710	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	106,500	113,196	2021/3/25
平成24年度第1回福岡市公募公債（5年）		0.25	34,700	34,783	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債（5年）		0.25	42,500	42,620	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債（5年）		0.31	31,500	31,696	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債		0.68	50,000	51,928	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）		1.371	100,000	107,012	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	104,133	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	104,632	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	101,808	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,104	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,764	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	59,800	62,565	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,258	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,666	2018/11/28
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	101,722	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,795	2018/12/25
小	計		25,157,360	26,619,600	
特殊債券（除く金融債）					
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	200,000	205,420	2017/7/31
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	106,000	109,143	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	102,789	2018/1/31
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	102,773	2018/3/23
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	103,720	2018/5/30
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	34,000	35,359	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	156,000	162,016	2018/8/29
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	224,000	232,323	2018/9/28
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	115,000	119,849	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	159,000	164,819	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	123,000	127,585	2019/3/19
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	104,631	2019/5/31

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第81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	240,630	2029/5/31
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	210,000	219,949	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	79,000	82,444	2019/9/30
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	100,000	120,394	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,445	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	139,000	144,938	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	210,000	220,029	2020/1/31
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	123,679	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	52,464	2020/3/19
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,658	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	200,000	210,526	2020/6/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,140	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	116,262	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	74,788	2020/12/28
第127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	119,363	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	95,783	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	60,000	63,258	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	128,063	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	105,119	2021/10/29
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	200,000	232,878	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	143,067	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	117,359	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	370,000	387,822	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	105,382	2022/4/28
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	115,306	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	200,000	227,500	2042/5/30
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	300,000	314,121	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	350,000	365,750	2022/10/31
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	100,000	104,649	2022/11/30
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	222,000	231,352	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	209,856	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	100,000	103,803	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	109,428	2033/4/28
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	157,403	2023/4/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	474,000	489,836	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	105,412	2023/6/30
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	121,000	127,836	2023/7/31
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.835	200,000	210,206	2023/8/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	228,000	236,711	2023/11/30
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	322,000	333,649	2024/3/29
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	103,590	2024/6/28
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	100,000	103,182	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	108,152	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	102,609	2024/10/31
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	241,000	245,646	2024/12/27
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	106,645	2020/7/15

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第3回政府保証首都高速道路債券	1.7	9,000	9,166	2017/3/27
第4回政府保証首都高速道路債券	1.7	179,000	183,725	2017/9/25
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	34,959	2017/8/24
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	29,135	2018/10/19
第17回政府保証中日本高速道路債券	1.7	100,000	102,604	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,274	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	47,684	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	10,000	10,468	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	26,107	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	200,000	209,828	2019/8/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	0.4	200,000	201,154	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券（15年）	2.0	100,000	111,738	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	200,000	207,106	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券（15年）	2.2	100,000	113,416	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	0.25	300,000	301,155	2018/10/29
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	104,136	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	48,000	50,209	2019/5/24
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	0.32	100,000	100,680	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,909	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,136	2020/5/22
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	104,102	2020/9/14
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,829	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,069	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,907	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,979	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	104,459	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	254,000	266,263	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	144,000	148,186	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,209	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	157,608	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	166,451	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	207,286	2024/3/15
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,210	2024/7/16
第63回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.556	200,000	205,640	2024/8/16
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	104,665	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,759	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	117,264	2018/4/17
第2回政府保証公営企業債券（15年）	2.1	100,000	110,354	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	103,000	107,444	2019/9/17
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	30,000	31,257	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	104,841	2023/2/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	216,477	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	197,000	205,029	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,052	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	199,930	2019/2/13
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,235	2020/2/17

銘柄	利 率	当 期 末		
		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11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	137,000	143,860	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	200,818	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,806	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	199,978	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	155,172	2018/1/24
第8回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	102,084	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	31,903	2017/11/28
第21回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.46	100,000	100,403	2017/3/17
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	51,691	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,008	2022/6/20
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	20,000	23,937	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	130,864	2032/5/20
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	200,000	227,666	2022/9/20
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	39,796	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	129,514	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	165,932	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	60,000	72,427	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	205,630	2017/9/20
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	100,000	120,390	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	103,212	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	365,733	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	151,678	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	104,303	2018/12/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	122,408	2029/4/20
第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.17	100,000	105,398	2021/6/18
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.14	100,000	105,238	2021/6/18
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	50,000	57,865	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	112,956	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,044	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	104,023	2022/12/20
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	300,000	315,375	2023/6/20
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.85	200,000	208,942	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	103,906	2023/12/20
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	108,223	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	105,135	2019/6/28
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	60,496	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	83,515	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,162	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	107,204	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	113,741	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,566	2024/9/24
第10回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.28	100,000	100,231	2017/5/26
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	119,121	2030/12/27
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	96,446	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,752	2020/9/28
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	92,549	2031/8/28

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17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	116,106	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,771	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,625	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	226,072	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,259	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,634	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	250,000	282,275	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	77,266	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,915	2021/8/27
第28回公営企業債券(財投機関債)	1.89	100,000	103,104	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	200,000	210,342	2022/4/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	100,000	104,194	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	208,090	2023/1/27
第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.887	200,000	209,660	2023/6/28
第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.922	300,000	315,306	2023/7/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	336,885	2027/8/20
F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,364	2019/4/25
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	112,463	2030/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	111,035	2031/7/30
F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	100,000	108,812	2027/3/19
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	106,149	2029/2/28
第10回首都高速道路	0.336	400,000	401,388	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,192	2019/9/20
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	116,013	2025/3/21
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	96,038	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	93,333	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	104,267	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)	0.854	100,000	104,531	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	102,266	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	28,596	30,710	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	23,913	25,744	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	30,010	32,374	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	24,501	26,602	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.8	100,000	101,931	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	29,527	31,961	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	21,028	22,254	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	22,004	23,770	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	29,449	31,699	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	25,899	27,681	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	22,083	23,842	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	16,138	16,731	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	30,744	32,920	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	70,000	71,872	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	15,585	16,060	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	22,752	24,554	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	27,493	29,558	2039/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	33,420	34,484	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	23,490	25,345	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	33,527	36,121	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	18,334	19,123	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	33,535	35,029	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	35,997	37,667	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	36,911	38,738	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	110,913	115,812	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	20,548	21,590	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	21,361	22,709	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.92	100,000	104,796	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	26,246	27,657	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	57,792	61,132	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	30,859	32,636	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	52,300	55,965	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	57,690	61,646	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	59,588	63,514	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	29,677	31,629	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	62,099	65,613	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	28,084	29,865	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	68,711	71,846	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	30,473	32,807	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	28,310	30,796	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	73,752	78,233	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	74,195	79,450	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	69,705	74,577	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	67,464	72,606	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	204,132	219,386	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	67,925	72,497	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	67,693	71,915	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	27,999	30,359	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	72,383	76,865	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	74,979	79,117	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	75,992	80,078	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	78,549	82,699	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	237,525	250,327	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	79,791	84,104	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	80,247	84,108	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	81,620	84,865	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	82,224	84,982	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	83,563	86,440	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	84,184	87,777	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	87,092	91,259	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	94,615	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	250,104	260,180	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	33,959	2026/6/19

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78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	86,106	88,870	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	178,274	184,096	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	88,846	91,747	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	90,491	93,228	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	182,434	187,598	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	115,486	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	94,588	96,799	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	283,443	288,587	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	191,152	194,013	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	95,832	96,574	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	192,228	191,605	2050/2/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	294,057	299,773	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	196,524	199,912	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	115,763	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	220,454	2027/3/19
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.472	100,000	110,475	2027/6/18
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	152,925	2042/9/19
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	114,197	2032/9/17
第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.748	300,000	311,448	2023/12/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	57,791	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	82,404	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,745	2021/12/20
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,422	2017/9/20
第21回東日本高速道路		0.58	100,000	101,039	2018/6/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,611	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,321	2019/12/20
第3回中日本高速道路		1.92	300,000	308,862	2017/9/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	100,768	2017/9/20
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	104,437	2022/3/18
第43回中日本高速道路		0.362	100,000	100,390	2017/9/20
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	200,742	2017/9/20
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	100,606	2021/12/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	103,586	2023/9/20
第21回西日本高速道路		0.754	300,000	310,626	2023/12/20
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.86	200,000	209,274	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.026	100,000	104,927	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.193	100,000	100,210	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	102,797	2017/9/20
小	計		31,776,680	33,746,423	
金融債券					
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,263	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,044	2019/10/25
い第744号農林債券		0.4	100,000	100,270	2017/5/26
い第752号農林債券		0.3	150,000	150,262	2018/1/26
い第760号農林債券		0.4	400,000	402,068	2018/9/27
い第761号農林債券		0.3	250,000	250,615	2018/10/26

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763号農林債券	0.3	340,000	340,894	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,243	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,257	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,090	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	300,834	2020/5/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,144	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,122	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,263	2017/6/27
第279回信金中金債	0.25	300,000	300,414	2018/2/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,464	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	200,678	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,182	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,195	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	200,330	2020/3/27
第8号商工債券（10年）	1.66	100,000	104,239	2018/12/20
第11号商工債券（10年）	0.66	100,000	102,645	2024/9/20
第179号商工債券（3年）	0.14	300,000	299,823	2017/12/27
第184号商工債券（3年）	0.15	300,000	299,817	2018/5/25
小 計		4,040,000	4,055,157	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,720	2019/1/29
第524回東京電力	1.795	100,000	101,334	2017/3/14
第532回東京電力	1.75	120,000	122,173	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	104,775	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	102,012	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	103,148	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	154,210	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,367	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	102,686	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	104,470	2030/7/29
第490回中部電力	1.444	70,000	72,849	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,817	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	103,161	2024/5/24
第448回関西電力	2.16	100,000	104,378	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	102,599	2017/7/25
第472回関西電力	1.79	100,000	104,054	2018/11/22
第473回関西電力	1.665	100,000	104,270	2019/4/25
第478回関西電力	1.448	200,000	208,608	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,372	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,217	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	101,630	2021/1/25
第288回北陸電力	1.89	100,000	102,978	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	101,645	2019/6/25
第383回東北電力	2.9	100,000	105,023	2017/12/25
第448回東北電力	1.608	100,000	104,391	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	103,997	2020/11/25

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245回四国電力	2.0	100,000	109,052	2021/6/25
第394回九州電力	1.86	100,000	102,624	2017/9/25
第400回九州電力	1.777	100,000	105,919	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	104,476	2019/6/25
第422回九州電力	1.164	100,000	103,446	2020/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,203	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	102,334	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	100,588	2021/10/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	80,213	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	25,083	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,248	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,141	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,558	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	201,260	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,229	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,850	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	113,812	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	400,000	420,688	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,642	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	168,398	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	105,392	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	104,352	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	103,852	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	101,000	2025/2/20
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	104,368	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,796	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	305,565	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	104,296	2022/12/2
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	106,101	2019/3/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,097	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,288	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,408	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	300,000	300,909	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金	1.12	400,000	405,320	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,519	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,689	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,360	2019/8/5
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,428	2019/3/20
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,793	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,523	2020/12/18
第59回三井物産	2.11	100,000	106,071	2019/3/20
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,480	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行（同順位特約付）	2.08	100,000	102,827	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.5	100,000	107,218	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	106,919	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.2	100,000	115,032	2026/10/30

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
普通社債券	%	千円	千円	
第10回みずほコーポレート銀行	1.945	400,000	412,224	2017/10/27
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	600,000	602,112	2017/4/21
第30回みずほコーポレート銀行	0.34	100,000	100,241	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行	0.33	200,000	200,476	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行	0.27	100,000	100,142	2018/1/24
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	600,000	602,892	2018/4/20
第7回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.11	400,000	428,560	2019/12/20
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	110,185	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.16	100,000	102,876	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	106,169	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	120,915	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	102,089	2017/4/20
第93回三菱東京UFJ銀行	1.985	200,000	206,206	2017/10/17
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,655	2021/4/16
第1回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.345	100,000	100,281	2017/6/7
第2回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.26	100,000	100,183	2017/12/20
第5回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.285	200,000	200,608	2018/11/28
第6回住友信託銀行（劣後特約付）	2.78	100,000	120,837	2026/4/27
第13回住友信託銀行（劣後特約付）	2.341	100,000	116,641	2026/6/15
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,383	2017/6/20
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	105,146	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	106,251	2020/12/17
第25回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	200,000	231,634	2026/6/1
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,420	2017/10/20
第5回みずほ銀行（劣後特約付）	2.49	100,000	117,260	2026/1/30
第8回みずほ銀行（劣後特約付）	1.99	100,000	102,125	2017/4/27
第9回みずほ銀行（劣後特約付）	2.52	100,000	118,757	2027/4/27
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	114,320	2026/9/11
第8回芙蓉総合リース	0.318	100,000	100,262	2019/7/30
第4回興銀リース	0.36	100,000	100,603	2019/5/23
第5回興銀リース	0.272	100,000	100,341	2019/12/5
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,154	2019/6/20
第10回東京センチュリーリース	0.298	100,000	100,246	2019/11/21
第29回ホンダファイナンス	0.428	100,000	100,920	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス	0.203	100,000	100,108	2019/12/20
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	103,480	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	202,622	2021/6/18
第176回オリックス	0.354	100,000	100,051	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	202,882	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	200,000	200,410	2020/10/30
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	99,997	2022/1/21
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	112,293	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,328	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	301,713	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,052	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	100,493	2020/6/10

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2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	103,812	2018/6/20
第87回三菱地所	1.77	100,000	103,018	2017/11/15
第98回三菱地所	1.165	100,000	103,965	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,526	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	203,104	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	101,748	2024/9/19
第11回エス・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	104,950	2021/9/17
第17回エス・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	101,052	2024/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	101,595	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	102,934	2017/11/29
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	111,291	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	106,482	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	225,992	2023/9/20
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	104,535	2018/12/20
第58回東日本旅客鉄道	1.58	100,000	104,511	2019/3/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	104,554	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	104,688	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,310	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	111,714	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	111,583	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	138,478	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	114,131	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	118,053	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	105,597	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	105,486	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	104,718	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	101,897	2017/3/17
第59回日本電信電話	1.69	100,000	105,207	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	103,088	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,176	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	102,391	2024/9/20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	103,302	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,256	2019/11/20
第38回電源開発	0.978	100,000	103,564	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	205,468	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	210,688	2023/6/9
第9回大阪ガス	2.9	100,000	105,552	2018/1/30
第25回エス・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,325	2020/3/19
第1回ファーストリテイリング	0.11	100,000	100,022	2018/12/18
第2回ファーストリテイリング	0.291	100,000	100,140	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	100,482	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	100,941	2025/12/18
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	108,787	2020/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,414	2016/9/20
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	100,063	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	101,146	2017/2/9

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5回ナショナル・オーストラリア銀行		1.01	100,000	100,017	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行		1.3	100,000	101,150	2017/1/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行		0.457	100,000	100,818	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	100,337	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行		0.407	300,000	302,163	2019/5/2
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション		1.0	100,000	100,475	2016/8/12
第9回ラボバンク・ネダーランド		1.81	100,000	107,076	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド		0.778	100,000	100,979	2017/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド		0.377	100,000	100,182	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド		0.557	100,000	100,881	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド		0.38	100,000	100,213	2020/5/22
小 計			21,797,000	22,623,825	
合 計			426,602,040	459,059,690	

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 149	百万円 -

日本債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015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14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	NOMURA-BPI総合インデックス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総合インデックス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総合インデックス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		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		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
10期(2011年5月12日)	11,540	1.9	331.63	1.9	99.4	—	207,058
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834

(注) NOMURA-BPI総合インデックスとは、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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合インデックスは野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I S 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年5月12日	円	%		%	%	%
	12,299	—	353.58	—	99.4	0.2
5月末	12,328	0.2	354.39	0.2	99.5	0.1
6月末	12,364	0.5	355.41	0.5	99.7	0.1
7月末	12,384	0.7	356.01	0.7	99.6	0.1
8月末	12,424	1.0	357.15	1.0	99.3	0.3
9月末	12,433	1.1	357.41	1.1	99.5	0.4
10月末	12,491	1.6	359.08	1.6	98.3	1.1
11月末	12,565	2.2	361.19	2.2	98.9	0.7
12月末	12,695	3.2	364.96	3.2	99.2	0.2
2015年1月末	12,699	3.3	365.07	3.2	100.2	0.2
2月末	12,630	2.7	363.04	2.7	99.5	0.1
3月末	12,637	2.7	363.28	2.7	100.1	—
4月末	12,678	3.1	364.50	3.1	99.7	0.2
(期 末) 2015年5月12日	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3

(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2.2%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(2.2%)とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・日銀による大規模国債買い入れオペの効果や世界景気に対する慎重な見方を受けて、債券市況は緩やかな上昇（利回りは低下）基調となっていました。日銀が2014年10月末に「量的・質的金融緩和」の拡大を決定したことから、2015年1月中旬にかけて一段の上昇となりました。
- ・その後は、日銀の追加金融緩和観測の後退や米国金利の上昇などから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総合インデックス）の構成銘柄を種別や年限など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2.2%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

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

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
- ・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、0.0%程度となりました。

◎今後の運用方針

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

○1万口当たりの費用明細

(2014年5月13日～2015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 有価証券等を売買する際に発生する費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、12,527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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	124,120,865	73,164,875
	地方債証券	4,545,751	2,079,656
	特殊債券	6,813,914	3,855,323
	社債券	4,840,919	(421,588)
			2,808,070
			(100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 15,425	百万円 14,852	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 140,321	百万円 38,627	% 27.5	百万円 81,907	百万円 24,091	% 29.4

(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 200	百万円 518	百万円 1,151

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 300

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015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	259,668,000 (100,000)	276,063,134 (100,693)	80.3 (0.0)	— (—)	47.8 (—)	22.4 (0.0)	10.2 (—)
地方債証券	18,432,040 (18,432,040)	19,456,471 (19,456,471)	5.7 (5.7)	— (—)	3.6 (3.6)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	23,778,319 (23,778,319)	25,080,571 (25,080,571)	7.3 (7.3)	— (—)	4.7 (4.7)	2.1 (2.1)	0.5 (0.5)
金融債券	3,190,000 (3,190,000)	3,205,684 (3,205,684)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.7 (0.7)	0.2 (0.2)
普通社債券	17,347,000 (17,347,000)	17,990,217 (17,990,217)	5.2 (5.2)	0.2 (0.2)	1.9 (1.9)	2.3 (2.3)	1.1 (1.1)
合 計	322,415,359 (62,847,359)	341,796,080 (65,833,638)	99.4 (19.1)	0.2 (0.2)	58.0 (10.3)	29.0 (6.7)	12.4 (2.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第341回利付国債 (2年)	0.1	800,000	800,864	2016/6/15
第342回利付国債 (2年)	0.1	1,110,000	1,111,287	2016/7/15
第343回利付国債 (2年)	0.1	1,400,000	1,401,750	2016/8/15
第344回利付国債 (2年)	0.1	1,430,000	1,431,901	2016/9/15
第345回利付国債 (2年)	0.1	940,000	941,334	2016/10/15
第346回利付国債 (2年)	0.1	1,250,000	1,251,875	2016/11/15
第347回利付国債 (2年)	0.1	350,000	350,553	2016/12/15
第348回利付国債 (2年)	0.1	1,050,000	1,051,753	2017/1/15
第349回利付国債 (2年)	0.1	1,220,000	1,222,135	2017/2/15
第350回利付国債 (2年)	0.1	1,200,000	1,202,196	2017/3/15
第351回利付国債 (2年)	0.1	1,240,000	1,242,380	2017/4/15
第97回利付国債 (5年)	0.4	1,210,000	1,215,396	2016/6/20
第98回利付国債 (5年)	0.3	1,000,000	1,003,350	2016/6/20
第99回利付国債 (5年)	0.4	990,000	995,355	2016/9/20
第100回利付国債 (5年)	0.3	1,360,000	1,365,521	2016/9/20
第101回利付国債 (5年)	0.4	850,000	855,448	2016/12/20
第102回利付国債 (5年)	0.3	2,990,000	3,004,352	2016/12/20
第103回利付国債 (5年)	0.3	1,360,000	1,367,534	2017/3/20
第104回利付国債 (5年)	0.2	1,150,000	1,154,243	2017/3/20
第105回利付国債 (5年)	0.2	2,640,000	2,650,533	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,130,000	3,143,991	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	1,570,000	1,577,755	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	2,130,000	2,134,984	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,450,000	2,455,929	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,088,758	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,425,453	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,200,000	1,213,944	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	2,700,000	2,723,004	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	1,390,000	1,402,329	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	2,170,000	2,181,978	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	3,780,000	3,800,374	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	3,990,000	4,010,668	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,690,000	1,698,281	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	1,670,000	1,671,352	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,440,000	2,451,102	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	2,360,000	2,360,495	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	3,580,000	3,578,353	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,960,000	1,957,628	2020/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	275,000	335,368	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	500,000	584,480	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	493,000	576,593	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	708,000	828,367	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	645,000	719,826	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	690,000	750,292	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	700,000	720,216	2054/3/20

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8回利付国債(40年)	1.4	170,000	159,781	2055/3/20
第280回利付国債(10年)	1.9	600,000	612,588	2016/6/20
第281回利付国債(10年)	2.0	1,053,000	1,076,250	2016/6/20
第282回利付国債(10年)	1.7	1,790,000	1,831,295	2016/9/20
第283回利付国債(10年)	1.8	1,732,000	1,774,312	2016/9/20
第284回利付国債(10年)	1.7	2,866,000	2,944,299	2016/12/20
第285回利付国債(10年)	1.7	3,468,000	3,577,346	2017/3/20
第286回利付国債(10年)	1.8	1,070,000	1,110,349	2017/6/20
第287回利付国債(10年)	1.9	2,400,000	2,495,544	2017/6/20
第288回利付国債(10年)	1.7	1,596,000	1,659,456	2017/9/20
第289回利付国債(10年)	1.5	1,593,000	1,654,760	2017/12/20
第290回利付国債(10年)	1.4	350,000	363,856	2018/3/20
第291回利付国債(10年)	1.3	940,000	974,535	2018/3/20
第292回利付国債(10年)	1.7	794,000	832,215	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	521,000	549,743	2018/6/20
第294回利付国債(10年)	1.7	940,000	988,945	2018/6/20
第295回利付国債(10年)	1.5	1,040,000	1,087,704	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	1,600,000	1,678,224	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	836,000	876,579	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,240,000	1,295,738	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,319,749	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	957,000	1,009,721	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,512,000	1,600,089	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	1,250,000	1,317,712	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,615,000	1,706,732	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	800,000	841,976	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,938,000	3,098,796	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	2,488,000	2,641,534	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,331,681	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	1,474,000	1,561,393	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	2,190,000	2,297,638	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	2,036,000	2,128,454	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	1,230,000	1,272,791	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,430,000	2,571,037	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,859,000	1,981,229	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	950,000	1,001,452	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	2,013,000	2,136,900	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	830,000	876,081	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	657,000	694,527	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,790,000	1,881,003	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	719,000	760,917	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	2,100,000	2,208,759	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,575,000	1,656,774	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	783,877	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,875,000	1,959,337	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,250,000	1,297,062	2022/6/20

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325回利付国債 (10年)	0.8	2,885,000	2,992,004	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,000,000	1,029,350	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	1,110,000	1,150,825	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	2,330,000	2,379,931	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,327,710	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,990,000	2,062,674	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,510,029	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,260,000	3,323,896	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,650,000	3,717,123	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,170,000	3,225,665	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,810,000	2,831,496	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,360,000	1,368,772	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	2,100,000	2,073,855	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	2,210,000	2,199,568	2025/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	96,564	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	119,266	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	140,809	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	163,934	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	128,372	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	205,754	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	197,152	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	159,177	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	122,577	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	186,110	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	150,658	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	255,939	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	234,759	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	596,781	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	424,804	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	370,348	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	395,228	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	507,997	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	360,185	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	435,000	531,852	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	449,349	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	370,000	452,099	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	354,000	432,577	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	341,000	417,060	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	412,000	488,487	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	834,000	1,003,769	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	650,000	794,729	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	801,000	980,688	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	850,000	1,024,845	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	926,000	1,099,578	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	888,000	1,037,743	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,079,000	1,284,063	2040/3/20

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33回利付国債 (30年)	2.0	1,204,000	1,358,232	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,206,000	1,411,900	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,259,000	1,420,831	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,069,000	1,204,741	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,157,000	1,279,005	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	885,000	956,888	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	900,000	993,753	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	700,000	756,063	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	660,000	696,880	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	760,000	801,906	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	900,000	947,979	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	850,000	894,667	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	970,000	972,987	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	580,000	581,194	2045/3/20
第33回利付国債 (20年)	3.8	36,000	37,851	2016/9/20
第35回利付国債 (20年)	3.3	117,000	124,139	2017/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	215,164	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	430,648	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	646,591	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	953,762	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	83,016	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	535,464	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,551	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	236,234	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	572,947	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	222,110	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	239,744	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	542,380	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	269,956	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	503,472	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	164,157	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	650,291	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	304,163	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	493,457	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	496,676	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	359,161	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	560,545	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	979,075	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	496,769	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	185,534	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	616,401	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	710,749	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	367,480	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	666,045	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	227,780	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	241,266	2025/3/20

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78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	467,666	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	57,543	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	365,570	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	200,000	230,438	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	769,674	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	293,000	341,060	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	773,133	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	330,000	384,532	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	610,707	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	250,000	293,887	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	504,000	598,782	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	482,799	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	670,000	790,244	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	557,303	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	902,000	1,055,060	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	270,000	313,027	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	665,000	778,794	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	677,000	809,123	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	445,310	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,010,540	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	220,000	257,952	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,075,000	1,261,706	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	620,000	735,704	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	693,971	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	824,166	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	659,961	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	329,016	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	690,000	810,936	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	381,000	452,445	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	713,874	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	630,000	724,796	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	940,000	1,081,723	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	246,000	289,480	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	381,000	453,473	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	860,000	1,012,572	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,252,000	1,473,879	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,200,438	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	494,000	588,270	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	596,000	709,567	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	890,000	1,047,031	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	296,000	344,088	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	460,000	521,626	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	884,440	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	929,000	1,065,813	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	620,000	702,850	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	828,000	973,256	2030/12/20

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124回利付国債 (20年)	2.0	500,000	580,405	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	724,000	861,719	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	220,000	255,336	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	520,000	595,842	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	644,000	737,154	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	600,000	677,844	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	852,000	961,303	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	400,000	445,296	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	827,000	919,243	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	650,000	732,381	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	965,000	1,085,711	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	170,000	188,654	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	330,000	361,152	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	812,000	899,606	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	410,000	441,549	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	150,000	163,860	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,507,000	1,666,681	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,200,000	1,324,728	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	620,000	694,238	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	990,000	1,075,080	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	610,000	652,730	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,670,000	1,836,499	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,580,000	1,734,018	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,800,000	1,941,966	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,610,000	1,706,535	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,800,000	1,903,122	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,600,000	1,660,688	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,630,000	1,630,000	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,250,000	1,246,000	2035/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,693	2018/11/15
小 計		259,668,000	276,063,134	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,818	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	11,941	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	91,089	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	115,474	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	93,284	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	94,324	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	136,918	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	80,186	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	107,314	2033/3/18
第638回東京都公募公債	1.9	100,000	102,485	2016/9/20
第648回東京都公募公債	1.84	100,000	103,745	2017/6/20
第666回東京都公募公債	1.46	100,000	105,141	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	53,065	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	105,579	2019/12/20

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680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,871	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,920	2020/3/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,312	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,702	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	125,587	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	70,000	73,669	2022/3/18
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,944	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	150,000	155,554	2023/3/20
第728回東京都公募公債	0.65	200,000	203,816	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,948	2024/3/19
第733回東京都公募公債	0.581	100,000	101,095	2024/6/20
平成18年度第6回北海道公募公債	2.1	118,000	121,034	2016/8/31
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	115,952	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,790	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	104,165	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,774	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	105,926	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	105,512	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,769	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	102,826	2022/10/31
第1回神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	118,668	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	92,696	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	100,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	115,375	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	102,446	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	114,592	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	149,002	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,630	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	100,000	105,827	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,453	2020/9/18
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	116,776	2030/5/28
第74回大阪府公募公債(5年)	0.46	100,000	100,407	2016/6/29
第285回大阪府公募公債	1.5	50,000	50,434	2015/12/25
第300回大阪府公募公債	1.8	135,000	139,306	2017/3/29
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	31,231	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	104,596	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,540	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	105,553	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	53,000	56,125	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,600	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	105,423	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	76,083	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	44,000	46,609	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	116,631	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,790	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,616	2021/3/30

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351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,584	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,444	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,522	2022/3/29
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	21,081	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,339	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	146,763	2022/3/16
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	103,545	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	46,217	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	106,535	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	102,886	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	108,559	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	52,826	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	20,000	21,149	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	90,000	95,278	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	106,080	2019/11/20
平成18年度第2回静岡県公募公債	2.0	41,300	42,197	2016/6/27
平成19年度第1回静岡県公募公債	1.77	66,900	69,232	2017/5/30
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,227	2018/5/28
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	105,114	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,563	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	56,104	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	105,045	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,473	2020/8/25
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	105,540	2021/6/28
平成25年度第9回静岡県公募公債	0.679	100,000	102,131	2023/11/22
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	101,277	2024/7/25
平成18年度第4回愛知県公募公債	1.8	110,700	113,449	2016/10/17
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	105,323	2021/7/29
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,776	2022/1/31
平成25年度第2回愛知県公募公債	0.576	200,000	202,944	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	140,000	145,052	2023/7/25
平成19年度第2回広島県公募公債	1.94	46,050	48,005	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	63,398	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,338	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,599	2021/5/27
平成18年度第3回埼玉県公募公債	2.1	107,600	110,243	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公募公債	1.9	62,100	63,861	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公募公債	1.85	112,600	116,197	2017/2/27
平成19年度第3回埼玉県公募公債	1.94	39,100	40,776	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	100,000	104,236	2018/1/30
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,687	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,837	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	103,277	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	150,996	2024/9/26
平成18年度第3回福岡県公募公債	1.9	100,000	102,683	2016/10/31
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	84,812	2037/9/18

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20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	91,792	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	105,986	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	104,711	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,782	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	90,235	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	94,692	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	84,326	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	84,033	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,586	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	84,688	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,962	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,025	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	103,337	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	83,706	2023/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,210	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	124,632	2021/11/30
第45回共同発行市場公募地方債	1.7	37,500	38,482	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債	1.8	117,000	120,605	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	30,066	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	102,000	106,112	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	311	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,859	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	104,990	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	105,032	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,603	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	105,408	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	94,500	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	105,778	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,168	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,594	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,615	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	115,299	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,458	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	106,030	2021/2/25
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,949	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	209,850	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,873	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	70,000	73,590	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,000	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,094	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,451	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	258,160	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	102,623	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,519	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	309,645	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,290	2023/3/24

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128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	305,799	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	130,000	133,598	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	203,660	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,737	2024/6/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	300,000	302,556	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	100,000	100,664	2024/9/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	197,120	2025/1/24
平成18年度第1回堺市公募公債	1.84	30,000	30,839	2016/12/26
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	104,195	2017/12/19
平成18年度第2回熊本県公募公債	1.8	84,540	86,661	2016/10/27
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,597	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,984	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	62,614	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	223,658	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	120,746	2028/9/21
平成18年度第6回大阪市公募公債	2.0	75,000	77,080	2016/10/26
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	31,143	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	132,791	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,429	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	100,788	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	104,846	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	118,600	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	95,127	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,958	2021/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	59,417	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	144,304	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	92,712	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	100,000	115,190	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	93,031	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	105,572	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	93,384	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,247	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	102,651	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	109,989	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	64,356	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,815	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	91,835	2040/9/20
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,931	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	104,779	2034/6/20
平成17年度第3回福岡市公募公債	1.6	60,000	60,502	2015/11/30
平成18年度第6回福岡市公募公債	1.8	70,000	71,954	2016/12/26
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	95,546	2018/10/24
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.25	34,700	34,828	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.25	42,500	42,671	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,706	2018/9/26

銘柄	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25年度第4回福岡市公募公債	(20年)	0.68	50,000	51,018	2023/10/24	
平成26年度第6回福岡市公募公債		1.371	100,000	102,183	2034/9/20	
平成18年度第1回千葉市公募公債		1.8	50,000	51,250	2016/10/25	
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	103,258	2022/11/22	
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,065	2020/11/30	
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	12,750	13,371	2021/11/30	
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	40,400	41,723	2022/10/25	
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	100,457	2023/4/26	
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	38,022	2018/11/28	
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	99,815	2024/11/28	
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	51,218	2018/12/25	
小		計		18,432,040	19,456,471	
特殊債券(除く金融債)						
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	120,000	122,833	2016/7/28	
第17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	102,542	2016/8/31	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	102,680	2016/12/28	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	200,000	208,214	2017/7/31	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	112,000	116,757	2017/8/31	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	90,000	93,519	2017/9/28	
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	106,000	110,565	2017/10/31	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	103,929	2018/1/31	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	56,000	58,216	2018/4/20	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	104,996	2018/5/30	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	34,000	35,783	2018/7/31	
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	56,000	58,803	2018/8/29	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	124,000	129,913	2018/9/28	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	115,000	121,123	2018/11/28	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	159,000	166,185	2019/2/27	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	123,000	128,638	2019/3/19	
第81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	234,080	2029/5/31	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	110,000	116,260	2019/6/28	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	79,000	83,011	2019/9/30	
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	100,000	116,982	2029/9/28	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	116,988	2029/10/31	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	139,000	145,703	2019/12/27	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	210,000	221,323	2020/1/31	
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	117,538	2040/2/29	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	50,000	52,757	2020/3/19	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	116,986	2030/4/30	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	100,000	105,749	2020/6/30	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,316	2020/9/30	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	116,334	2020/11/30	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	71,000	74,972	2020/12/28	
第127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	115,387	2031/1/31	
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	95,785	2021/5/31	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	60,000	63,216	2021/7/30	

銘柄	利 率	当 期 末		評 価 額	償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	127,834	2021/8/31	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,856	2021/10/29	
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	112,027	2031/10/31	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	142,630	2021/11/30	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	116,756	2022/2/28	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	270,000	281,529	2022/3/18	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	104,778	2022/4/28	
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	110,690	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	200,000	214,782	2042/5/30	
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	150,000	155,040	2022/10/31	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	100,000	103,421	2022/11/30	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	117,000	120,376	2022/12/28	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	207,276	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	100,000	102,350	2023/3/17	
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	300,000	305,388	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	104,005	2023/6/30	
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	121,000	126,124	2023/7/31	
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.835	100,000	103,581	2023/8/31	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,787	2024/6/28	
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	102,962	2034/8/31	
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	107,303	2020/7/15	
第3回政府保証首都高速道路債券	1.7	9,000	9,278	2017/3/27	
第4回政府保証首都高速道路債券	1.7	179,000	185,998	2017/9/25	
第1回政府保証阪神高速道路債券	1.6	5,000	5,068	2016/3/31	
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	38,000	38,461	2016/2/22	
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	75,000	76,562	2016/6/27	
第6回政府保証東日本高速道路債券	1.8	62,000	63,662	2016/11/24	
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	35,432	2017/8/24	
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	107,000	111,045	2017/12/21	
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	29,452	2018/10/19	
第3回政府保証中日本高速道路債券	1.6	27,000	27,328	2016/2/24	
第17回政府保証中日本高速道路債券	1.7	100,000	103,853	2017/9/15	
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,383	2018/3/16	
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	48,178	2018/9/14	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	10,000	10,564	2019/6/14	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	26,325	2019/7/12	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,816	2019/8/16	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.4	200,000	201,900	2018/1/30	
第4回政府保証公営企業債券(15年)	2.0	100,000	111,791	2022/4/22	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.093	200,000	200,154	2017/2/24	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	113,403	2022/7/15	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	105,043	2019/4/15	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	48,000	50,669	2019/5/24	
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,642	2020/5/22	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	104,311	2020/9/14	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,015	2021/10/18	

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,774	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,170	2022/6/17
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	254,000	262,834	2023/2/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,643	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	155,404	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	39,000	39,932	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	203,830	2024/3/15
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	101,372	2024/7/16
第63回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.556	200,000	201,882	2024/8/16
第864回政府保証公営企業債券	1.9	14,000	14,287	2016/6/22
第866回政府保証公営企業債券	2.0	63,000	64,553	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	52,000	53,381	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	105,948	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	103,845	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	118,482	2018/4/17
第885回政府保証公営企業債券	1.7	104,000	109,159	2018/5/22
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	111,094	2021/4/16
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	30,000	30,873	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,487	2023/2/24
第190回政府保証中小企業債券	1.8	13,000	13,386	2017/1/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	219,129	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	80,000	81,985	2023/10/20
第17回政府保証国民生活債券	1.6	41,000	41,537	2016/3/17
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,075	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	199,956	2019/2/13
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,894	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	137,000	143,591	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,140	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,478	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	198,904	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	156,892	2018/1/24
第11回政府保証中部国際空港債券	0.7	100,000	101,160	2017/2/23
第5回政府保証西日本高速道路債券	1.8	41,000	42,220	2017/1/25
第6回政府保証西日本高速道路債券	1.8	51,000	52,597	2017/2/27
第8回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	103,335	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	32,297	2017/11/28
第21回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.46	100,000	100,645	2017/3/17
第27回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.98	100,000	102,538	2016/9/20
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	52,248	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,153	2022/6/20
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	20,000	23,733	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	127,051	2032/5/20
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	100,000	113,501	2022/9/20
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.05	100,000	102,626	2016/9/20
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	37,329	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	121,296	2047/3/20

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
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	130,000	155,048	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	60,000	71,344	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	208,046	2017/9/20
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	100,000	118,428	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	104,269	2018/3/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	30,000	34,696	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	105,290	2018/12/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	119,837	2029/4/20
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	50,000	55,923	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	108,787	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	102,675	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	102,653	2022/12/20
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.85	200,000	206,176	2023/6/20
第1回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	106,038	2019/6/28
第1回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	58,985	2029/6/28
第2回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	84,087	2019/7/26
第3回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,921	2023/3/22
第3回回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	104,017	2029/1/26
第6回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	112,975	2023/12/20
第9回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,157	2024/9/24
第10回回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.28	100,000	100,353	2017/5/26
第14回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	93,330	2031/4/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,823	2020/9/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	89,291	2031/8/28
第17回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	111,924	2031/9/26
第19回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,797	2020/12/28
第20回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,683	2021/1/28
F23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,903	2018/5/29
第23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,658	2021/4/28
第23回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	250,000	270,955	2032/7/28
F24回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	76,715	2023/3/17
第27回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,530	2021/8/27
第35回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	100,000	104,476	2022/4/28
第44回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	205,534	2023/1/27
第49回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.887	200,000	206,936	2023/6/28
F89回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	109,856	2027/8/20
F110回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,538	2019/4/25
F123回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	108,916	2030/3/19
F131回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	107,221	2031/7/30
F147回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	100,000	106,371	2027/3/19
F226回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	102,926	2029/2/28
第10回回首都高速道路	0.336	100,000	100,531	2017/9/20
第13回回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,072	2019/9/20
第10回回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	93,266	2030/3/19
第15回回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	90,296	2030/10/29
第21回回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	105,283	2018/9/20

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第54回都市再生債券(財投機関債)	0.434	100,000	100,440	2016/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	100,306	2024/11/20
第10回福祉医療機構債券(財投機関債)	2.16	100,000	102,267	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	32,819	35,277	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	26,188	28,163	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	33,979	36,637	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	27,045	29,348	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.8	100,000	103,124	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	33,693	36,484	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	23,189	24,578	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	24,112	26,089	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	33,025	35,528	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	28,402	30,302	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	24,166	26,126	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	17,570	18,324	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	34,639	37,050	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	70,000	72,667	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	17,044	17,673	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	24,831	26,818	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	30,322	32,544	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	36,536	37,860	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	25,613	27,630	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	37,789	40,676	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	20,521	21,504	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	37,850	39,671	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	40,542	42,526	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	41,354	43,507	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	124,686	130,478	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	22,501	23,728	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,671	25,265	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.92	100,000	105,952	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	29,877	31,544	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	66,990	70,915	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	36,000	38,080	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	58,191	62,006	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	63,751	67,895	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	65,022	69,161	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	34,177	36,474	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	32,392	34,496	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	73,698	76,709	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	34,607	37,297	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	31,839	34,696	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	77,865	82,248	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	78,179	83,439	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	74,823	79,857	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	73,034	78,474	2046/4/10

銘	柄	当 期 末			償 還 年 月 日
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	147,680	158,442	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	73,895	78,672	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	73,997	78,379	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	31,992	34,726	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	78,221	82,760	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	79,876	83,896	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	80,668	84,586	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	82,694	86,420	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	249,591	261,164	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	83,868	87,747	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	84,153	87,561	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	85,975	88,657	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	86,049	88,151	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	87,646	89,851	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	88,406	91,504	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	90,881	94,518	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	91,754	2031/6/13
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	33,429	2026/6/19
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	185,814	189,844	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	92,875	94,877	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	94,357	96,113	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	190,094	193,221	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	111,360	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	97,714	98,741	2049/10/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	98,541	97,884	2050/1/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	215,914	2027/3/19
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	144,517	2042/9/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	57,075	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	79,722	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,622	2021/12/20
第16回国際協力機構債券(財投機関債)		0.3	85,800	86,229	2018/12/26
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,639	2017/9/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,838	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,122	2019/12/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	101,134	2017/9/20
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	103,852	2022/3/18
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	201,134	2017/9/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	102,156	2023/9/20
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.86	200,000	211,502	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.026	100,000	104,586	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.193	100,000	100,225	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	104,053	2017/9/20
小	計		23,778,319	25,080,571	
金融債券					
い第733号商工債券		0.55	100,000	100,450	2016/6/27
い第735号商工債券		0.4	100,000	100,322	2016/8/26

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736号商工債券	0.45	100,000	100,413	2016/9/27
い第745号商工債券	0.35	100,000	100,433	2017/6/27
い第773号商工債券	0.2	100,000	99,818	2019/10/25
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,253	2016/7/27
い第740号農林債券	0.5	100,000	100,547	2017/1/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	100,573	2017/2/27
い第744号農林債券	0.4	100,000	100,454	2017/5/26
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,586	2017/10/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,465	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	200,000	201,236	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	250,707	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	340,843	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,242	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,201	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	99,837	2019/11/27
第263回信金中金債	0.5	100,000	100,525	2016/10/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,255	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,217	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,454	2017/6/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,586	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	200,812	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,204	2019/2/27
第8号商工債券（10年）	1.66	100,000	105,247	2018/12/20
第175号商工債券（3年）	0.15	100,000	100,003	2017/8/25
小 計		3,190,000	3,205,684	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,313	2019/1/29
第524回東京電力	1.795	100,000	101,508	2017/3/14
第532回東京電力	1.75	120,000	122,220	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	103,028	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	101,630	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	102,765	2018/6/25
第559回東京電力	1.377	60,000	60,063	2019/10/29
第567回東京電力	1.958	100,000	97,149	2030/7/29
第490回中部電力	1.444	70,000	73,271	2019/7/25
第498回中部電力	0.566	100,000	100,888	2017/9/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,176	2023/6/23
第448回関西電力	2.16	100,000	105,482	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	103,703	2017/7/25
第473回関西電力	1.665	100,000	104,658	2019/4/25
第485回関西電力	1.285	100,000	103,539	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,063	2020/2/25
第376回中国電力	0.628	100,000	101,138	2018/6/25
第379回中国電力	0.619	100,000	100,989	2021/1/25
第288回北陸電力	1.89	100,000	104,179	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	101,710	2019/6/25

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383回東北電力	2.9	100,000	106,945	2017/12/25
第445回東北電力	1.792	100,000	105,218	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	105,129	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	103,863	2020/11/25
第245回四国電力	2.0	100,000	109,362	2021/6/25
第279回四国電力	0.579	100,000	100,994	2018/2/23
第394回九州電力	1.86	100,000	103,773	2017/9/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,365	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	105,199	2019/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,310	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	99,463	2024/9/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	82,175	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	25,482	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,118	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,427	2018/4/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,653	2020/4/24
第7回新関西国際空港	0.217	200,000	200,298	2016/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,292	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	113,118	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	100,000	105,493	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,476	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,808	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	104,752	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	103,351	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	102,707	2023/2/8
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	105,540	2018/6/20
第8回旭化成	1.455	100,000	105,530	2019/12/11
第48回住友化学	0.623	100,000	101,208	2018/6/12
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,375	2022/12/2
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	107,364	2019/3/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,973	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,346	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,536	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	100,000	99,857	2020/3/19
第22回三菱重工業	2.03	100,000	104,428	2017/9/12
第29回三菱重工業	0.662	100,000	100,232	2024/9/3
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,780	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,580	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,158	2019/8/7
第55回日産自動車	0.415	100,000	100,605	2018/3/20
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,229	2019/3/20
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,949	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,728	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	104,353	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	107,225	2019/3/20
第69回三菱商事	1.99	100,000	105,488	2018/5/22

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78回三菱商事	1.155	100,000	105,100	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行 (同順位特約付)	2.08	100,000	104,164	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.5	100,000	108,521	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	106,950	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.2	100,000	113,366	2026/10/30
第27回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	200,950	2016/10/20
第28回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	201,124	2017/1/25
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	100,000	100,532	2017/4/21
第30回みずほコーポレート銀行	0.34	100,000	100,336	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行	0.33	200,000	200,690	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行	0.27	100,000	100,213	2018/1/24
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	111,596	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.16	100,000	104,286	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.56	100,000	106,366	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.46	100,000	117,405	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	103,330	2017/4/20
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,882	2021/4/16
第126回三菱東京UFJ銀行	0.545	200,000	200,926	2016/7/14
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.345	100,000	100,401	2017/6/7
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.285	200,000	200,656	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.78	100,000	119,577	2026/4/27
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,519	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	105,449	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	106,585	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	100,000	114,182	2026/6/1
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	100,405	2016/7/20
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,614	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	116,154	2026/1/30
第6回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.25	100,000	102,894	2016/11/4
第8回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.99	100,000	103,321	2017/4/27
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	117,021	2027/4/27
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,151	2019/6/20
第29回ホンダファイナンス	0.428	100,000	100,359	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス	0.203	100,000	99,871	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,196	2021/6/18
第152回オリックス	0.92	100,000	100,944	2016/8/31
第176回オリックス	0.354	100,000	100,095	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	202,120	2021/1/29
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	110,948	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,585	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	100,000	100,394	2019/2/25
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	104,812	2018/6/20
第87回三菱地所	1.77	100,000	104,135	2017/11/15
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,646	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,457	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	100,000	101,682	2020/12/25

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114回三菱地所	0.187	100,000	100,156	2018/3/15
第116回三菱地所	0.643	100,000	100,764	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	104,628	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	99,713	2024/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	102,136	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	104,007	2017/11/29
第5回東日本旅客鉄道	3.3	100,000	105,705	2017/2/25
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	112,391	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,714	2022/12/20
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	105,466	2018/12/20
第58回東日本旅客鉄道	1.58	100,000	105,258	2019/3/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	105,128	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	105,173	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,002	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	110,172	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	105,096	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	138,980	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,096	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	114,968	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	105,312	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	106,440	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	105,114	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	103,059	2017/3/17
第59回日本電信電話	1.69	100,000	106,093	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	101,818	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,260	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	100,636	2024/9/20
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1.96	100,000	105,570	2018/6/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	101,936	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,613	2019/11/20
第40回電源開発	0.889	100,000	101,301	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	104,448	2023/6/9
第9回大阪ガス	2.9	100,000	107,510	2018/1/30
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,925	2020/3/19
第14回GEキャピタルコーポレーション	1.84	100,000	100,901	2015/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,758	2016/9/20
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	100,670	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	101,873	2017/2/9
第5回パークレイズ・バンク	1.29	100,000	100,364	2015/9/9
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	1.01	100,000	100,636	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	101,919	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	99,795	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	200,000	201,606	2016/6/10
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	100,295	2015/9/3
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	101,070	2016/8/12
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.98	200,000	201,164	2016/1/21

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9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	106,490	2021/1/28
第17回ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,192	2015/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,246	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,544	2018/12/19
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	100,179	2015/7/28
第2回エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー	1.01	100,000	100,286	2015/9/10
小 計		17,347,000	17,990,217	
合 計		322,415,359	341,796,080	

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 1,172	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 341,796,080	% 99.0
コール・ローン等、その他	3,417,894	1.0
投資信託財産総額	345,213,974	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	345,213,974,303
コール・ローン等	2,445,886,194
公社債(評価額)	341,796,080,298
未収利息	901,049,847
前払費用	63,447,964
差入委託証拠金	7,510,000
(B) 負債	1,379,465,348
未払金	1,049,268,240
未払解約金	330,197,108
(C) 純資産総額(A-B)	343,834,508,955
元本	273,489,284,775
次期繰越損益金	70,345,224,180
(D) 受益権総口数	273,489,284,775口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,572円

<注記事項>

①期首元本額	230,228,174,698円
期中追加設定元本額	135,484,008,244円
期中一部解約元本額	92,222,898,167円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	3,580,137,465
受取利息	3,580,137,465
(B) 有価証券売買損益	2,569,001,889
売買益	3,955,960,885
売買損	△ 1,386,958,996
(C) 先物取引等取引損益	20,317,520
取引益	37,611,520
取引損	△ 17,294,000
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,169,456,874
(E) 前期繰越損益金	52,934,367,849
(F) 追加信託差損益金	35,101,089,484
(G) 解約差損益金	△ 23,859,690,027
(H) 計(D+E+F+G)	70,345,224,180
次期繰越損益金(H)	70,345,224,180

(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。

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）

ファンド・マネジャー（国内債券）	11,743,442,447円
eMAXIS 国内債券インデックス	15,203,434,833円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,125,523,640円
eMAXIS バランス（波乗り型）	68,871,133円
コアバランス	2,230,302円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,259,490,415円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,114,470,182円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	159,053,540円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	44,439,863,200円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	18,281,244,331円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,609,072,273円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	7,926,797,815円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	113,326,227,570円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	8,784,466,902円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	3,742,701,820円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	2,524,370,601円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	915,214,832円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	241,721,037円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,553,563,529円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,817,510,263円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	63,861,023円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	114,650,402円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	231,532,019円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	202,662,382円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	122,882,547円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	26,872,804円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	409,759,981円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	1,194,737,135円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	494,881,793円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,203,556,358円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,494,686,393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）	1,702,858,889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）	3,505,625,283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）	1,792,846,196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）	1,044,074,228円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	533,454,470円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	228,713,599円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	224,657,170円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	57,701,438円
合計	273,489,284,775円

【お知らせ】

①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第7期》決算日2016年1月26日

[計算期間：2015年1月27日～2016年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第7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7期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
3期(2012年1月26日)	10,886	6.3	328.49	6.6	99.9	—	15,380
4期(2013年1月28日)	11,375	4.5	343.56	4.6	103.8	—	22,835
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年1月26日	円	%		%	%	%
	12,640	—	382.26	—	91.3	—
1月末	12,656	0.1	382.74	0.1	92.3	—
2月末	12,602	△0.3	381.07	△0.3	96.4	—
3月末	12,687	0.4	383.58	0.3	96.7	—
4月末	12,581	△0.5	380.53	△0.5	98.1	—
5月末	12,448	△1.5	376.31	△1.6	100.2	—
6月末	12,241	△3.2	370.37	△3.1	97.6	—
7月末	12,412	△1.8	375.40	△1.8	97.5	—
8月末	12,408	△1.8	375.47	△1.8	96.9	—
9月末	12,519	△1.0	378.64	△0.9	96.8	—
10月末	12,526	△0.9	378.92	△0.9	97.9	—
11月末	12,546	△0.7	379.61	△0.7	97.9	—
12月末	12,443	△1.6	376.44	△1.5	102.4	—
(期 末) 2016年1月26日	12,613	△0.2	381.71	△0.1	95.6	—

(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

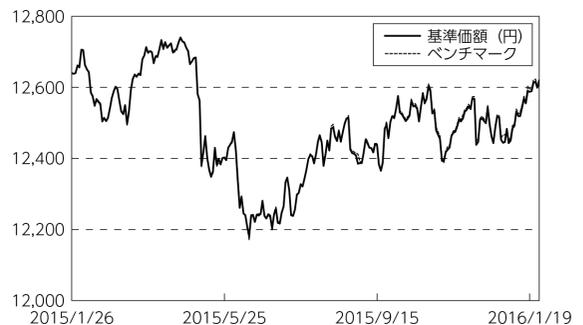
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.2%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(−0.1%)を0.1%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国債券市況

- ・外国債券市況は、2015年6月まではFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げ期待やユーロ圏の景況感の改善などを背景に低下しましたが、6月以降は新興国の景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

◎為替

- ・為替変動の影響を回避するため、組入外貨建資産は原則として100%程度の為替ヘッジを行いました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 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0.1%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト 等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト、為替ヘッジ効果等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.017)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.017	
期中の平均基準価額は、12,505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

(2015年1月27日～2016年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 151,877	千アメリカドル 56,200
	カナダ	千カナダドル 9,385	千カナダドル 3,590
	メキシコ	千メキシコペソ 56,446	千メキシコペソ 16,287
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 21,331	6,579
	イタリア	国債証券 27,141	7,997
	フランス	国債証券 27,439	7,759
	オランダ	国債証券 6,689	1,813
	スペイン	国債証券 16,085	4,658
	ベルギー	国債証券 7,097	2,030
	オーストリア	国債証券 3,880	839
	フィンランド	国債証券 1,739	489
	アイルランド	国債証券 1,931	518
	国	イギリス	千イギリスポンド 16,875
スイス		千スイスフラン 676	千スイスフラン 275
スウェーデン		千スウェーデンクローネ 12,336	千スウェーデンクローネ 3,411
ノルウェー		千ノルウェークローネ 6,957	千ノルウェークローネ 911
デンマーク		千デンマーククローネ 11,821	千デンマーククローネ 3,943
ポーランド		千ポーランドズロチ 6,136	千ポーランドズロチ 1,471
オーストラリア		千オーストラリアドル 8,287	千オーストラリアドル 2,052
シンガポール		千シンガポールドル 1,920	千シンガポールドル 342
南アフリカ		千南アフリカランド 19,677	千南アフリカランド 3,292

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月27日～2016年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	518,378	188,601	36.4	544,849	212,708	39.0
為替直物取引	34,580	24,867	71.9	8,576	5,260	61.3

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 197,140	千アメリカドル 203,768	千円 24,073,185	% 42.0	% —	% 17.0	% 15.9	% 9.1
カナダ	千カナダドル 11,240	千カナダドル 12,793	1,058,028	1.8	—	0.9	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 71,600	千メキシコペソ 78,936	501,248	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	27,360	32,378	4,149,241	7.2	—	4.0	2.1	1.1
イタリア	34,850	41,563	5,326,399	9.3	—	5.9	2.4	0.9
フランス	34,670	41,289	5,291,272	9.2	—	5.7	2.6	0.9
オランダ	9,280	10,842	1,389,435	2.4	—	1.4	0.7	0.4
スペイン	19,720	23,230	2,976,976	5.2	—	3.0	1.6	0.7
ベルギー	8,740	10,878	1,394,060	2.4	—	1.7	0.5	0.2
オーストリア	5,590	6,736	863,280	1.5	—	0.9	0.3	0.2
フィンランド	2,300	2,616	335,283	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	2,790	3,340	428,116	0.7	—	0.3	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 21,680	千イギリスポンド 26,242	4,406,615	7.7	—	5.5	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 1,010	千スイスフラン 1,236	144,006	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,280	千スウェーデンクローネ 18,853	259,995	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,300	千ノルウェークローネ 11,248	151,633	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 15,430	千デンマーククローネ 19,654	337,463	0.6	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 9,450	千ポーランドズロチ 10,032	286,937	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 10,430	千オーストラリアドル 11,386	933,880	1.6	—	1.0	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 3,490	千シンガポールドル 3,603	297,267	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 33,300	千南アフリカランド 28,987	206,969	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	54,811,296	95.6	—	50.0	30.3	15.3

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(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。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	0.5 T-NOTE 170131	0.5	3,200	3,194	377,398	2017/1/31
		0.5 T-NOTE 170731	0.5	700	696	82,297	2017/7/31
		0.625 T-NOTE 161231	0.625	1,100	1,099	129,928	2016/12/31
		0.625 T-NOTE 170215	0.625	1,200	1,199	141,673	2017/2/15
		0.625 T-NOTE 170531	0.625	1,600	1,596	188,603	2017/5/31
		0.625 T-NOTE 170831	0.625	1,400	1,395	164,820	2017/8/31
		0.625 T-NOTE 170930	0.625	1,600	1,593	188,293	2017/9/30
		0.625 T-NOTE 171130	0.625	900	895	105,844	2017/11/30
		0.625 T-NOTE 180430	0.625	1,400	1,389	164,129	2018/4/30
		0.75 T-NOTE 170115	0.75	2,200	2,201	260,141	2017/1/15
		0.75 T-NOTE 170315	0.75	900	900	106,371	2017/3/15
		0.75 T-NOTE 170630	0.75	1,000	999	118,056	2017/6/30
		0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,700	2,694	318,317	2017/10/31
		0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,800	2,793	329,965	2017/12/31
		0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,100	1,096	129,486	2018/2/28
		0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,992	235,366	2018/3/31
		0.875 T-NOTE 161231	0.875	800	801	94,715	2016/12/31
		0.875 T-NOTE 170131	0.875	700	701	82,869	2017/1/31
		0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,400	3,406	402,444	2017/2/28
		0.875 T-NOTE 170415	0.875	1,100	1,101	130,162	2017/4/15
		0.875 T-NOTE 170430	0.875	1,600	1,602	189,304	2017/4/30
		0.875 T-NOTE 170515	0.875	1,000	1,001	118,301	2017/5/15
		0.875 T-NOTE 170615	0.875	700	700	82,791	2017/6/15
		0.875 T-NOTE 170715	0.875	400	400	47,294	2017/7/15
		0.875 T-NOTE 170815	0.875	900	900	106,388	2017/8/15
		0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	105,981	2018/7/15
		0.875 T-NOTE 181015	0.875	500	497	58,795	2018/10/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	58,350	2019/7/31
		1 T-NOTE 170331	1.0	800	802	94,811	2017/3/31
		1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	141,812	2018/5/31
		1 T-NOTE 180815	1.0	700	699	82,656	2018/8/15
		1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,897	224,229	2018/9/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	400	397	46,938	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	700	694	82,000	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	500	495	58,523	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	300	296	35,040	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,207	260,831	2018/6/15
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,297	153,234	2019/5/31
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	301	35,616	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,800	3,818	451,124	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	401	47,479	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,306	154,307	2018/12/15
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,300	2,305	272,348	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	299	35,425	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	897	106,010	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	605	71,562	2018/6/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	807	95,390	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	600	605	71,498	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	500	504	59,563	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	300	302	35,717	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	503	59,496	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	400	400	47,337	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,602	189,289	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	900	106,417	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,500	1,500	177,251	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	997	117,863	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,300	1,296	153,114	2020/10/31
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	1,200	1,214	143,529	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	707	83,634	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	800	808	95,567	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	600	606	71,653	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	404	47,758	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	808	95,468	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,100	1,109	131,020	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	900	906	107,148	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,407	166,274	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	792	93,581	2022/1/31
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	300	304	35,948	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,028	239,658	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,700	2,738	323,488	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,621	191,608	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	1,100	1,114	131,725	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,619	191,298	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,514	178,940	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,400	1,413	166,985	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,300	1,311	154,913	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,100	3,072	362,929	2022/11/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	305	36,096	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	800	814	96,188	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	400	405	47,857	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	800	803	94,873	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	400	401	47,403	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,600	1,603	189,437	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,202	142,089	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,300	1,293	152,826	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	500	508	60,027	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	600	610	72,071	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	600	610	72,116	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,020	120,567	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	500	506	59,856	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,712	202,328	2022/8/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,500	1,537	181,681	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	500	512	60,495	2020/11/30

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2 T-NOTE 210228	2.0	1,400	1,433	169,388	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,534	181,280	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,021	120,632	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,122	132,553	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	600	611	72,285	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	600	612	72,345	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,133	252,009	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	202	23,965	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	1,400	1,420	167,773	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,000	2,000	236,353	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,000	1,996	235,818	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,030	121,730	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	721	85,204	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,500	1,543	182,304	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,200	1,234	145,832	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	700	719	84,972	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	700	718	84,894	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	900	921	108,867	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,400	2,423	286,304	2025/5/15
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	600	614	72,636	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	300	309	36,557	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,864	220,294	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	700	724	85,650	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	724	85,598	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	1,800	1,839	217,353	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	1,100	1,122	132,593	2025/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	800	818	96,682	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,342	158,567	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	930	109,906	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	729	86,206	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,400	2,479	292,905	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	800	750	88,641	2045/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	700	716	84,658	2017/6/30
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,100	1,152	136,106	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,100	2,191	258,928	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	200	206	24,441	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,473	174,105	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	2,300	2,421	286,019	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	1,000	996	117,733	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	1,400	1,391	164,426	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	600	615	72,725	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	200	207	24,515	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	500	524	61,954	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,600	1,703	201,266	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	2,300	2,446	288,980	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	900	915	108,195	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,500	1,519	179,522	2045/8/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-BOND 420515	3.0	1,200	1,257	148,513	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	700	727	85,992	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	600	623	73,636	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	850	884	104,443	2045/11/15
	3 T-NOTE 170228	3.0	550	563	66,606	2017/2/28
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,500	1,611	190,403	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,500	1,611	190,431	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	600	641	75,746	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	700	746	88,189	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	880	901	106,533	2017/1/31
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	3,000	3,088	364,872	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	733	86,662	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	500	539	63,781	2021/5/15
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	1,050	1,081	127,715	2017/3/31
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,300	1,454	171,879	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,142	134,982	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	400	460	54,344	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	470	494	58,406	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,196	141,350	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	900	1,056	124,775	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	700	820	96,937	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	779	92,141	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,130	1,232	145,596	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	900	991	117,162	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,312	155,061	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,920	226,828	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	970	114,669	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	230	245	28,979	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	721	85,238	2018/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	1,026	121,263	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	480	508	60,109	2017/11/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	652	77,067	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	848	100,200	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	600	785	92,777	2041/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	663	78,401	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	730	765	90,402	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	500	675	79,774	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	800	1,102	130,201	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	290	307	36,340	2017/8/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	320	428	50,628	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	100	134	15,866	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	450	627	74,137	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	500	681	80,524	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	120	163	19,284	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	440	623	73,602	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	260	341	40,344	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	100	148	17,584	2030/5/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	国債証券	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	199	23,610	2026/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	160	198	23,446	2019/8/15
小 計						24,073,185	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	400	399	33,006	2017/5/1
		0.25 CAN GOVT 171101	0.25	300	299	24,733	2017/11/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	350	352	29,138	2020/9/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	500	506	41,861	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	200	203	16,813	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	500	508	42,059	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	357	29,552	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170201	1.5	600	606	50,155	2017/2/1
		1.5 CAN GOVT 170301	1.5	400	404	33,465	2017/3/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	200	203	16,821	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	560	577	47,787	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	100	100	8,352	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	730	60,439	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	500	543	44,920	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	250	276	22,880	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	430	478	39,585	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	300	346	28,640	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	100	121	10,058	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	400	452	37,404	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	450	506	41,895	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	480	632	52,279	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	560	620	51,316	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	400	419	34,663	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	470	647	53,585	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	400	435	36,019	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	450	680	56,262	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	340	504	41,741	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	410	642	53,138	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	140	235	19,447	2027/6/1
小 計						1,058,028	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,500	9,537	60,564	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,700	2,271	14,423	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	5,800	5,840	37,089	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	3,200	3,251	20,645	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	4,600	4,579	29,079	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	800	770	4,889	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	4,900	5,122	32,527	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	3,000	3,120	19,813	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	2,700	2,940	18,671	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	5,200	5,564	35,336	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,200	4,600	29,212	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,700	2,942	18,683	2034/11/23

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	4,000	4,351	27,630	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	3,500	3,878	24,630	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,000	3,378	21,454	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	7,900	8,706	55,285	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	3,100	3,621	22,997	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	3,800	4,458	28,311	2038/11/18
小		計				501,248	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	400	405	51,905	2020/4/17
		0 SCHATS 170310	—	400	401	51,508	2017/3/10
		0 SCHATS 170616	—	300	301	38,681	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	300	302	38,727	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	300	302	38,771	2017/12/15
		0.25 OBL 180413	0.25	500	507	65,061	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	715	91,750	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	700	716	91,763	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	700	710	91,059	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	600	606	77,747	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,000	1,016	130,232	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	600	611	78,404	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	500	514	65,939	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	500	506	64,891	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	500	532	68,185	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	700	739	94,750	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	400	415	53,251	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	400	417	53,476	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	700	770	98,801	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	400	441	56,562	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	552	70,802	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	600	664	85,178	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	500	558	71,514	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,014	129,965	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	600	675	86,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	500	571	73,269	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	500	558	71,542	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	500	567	72,731	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	453	58,162	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	350	460	58,976	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	400	528	67,691	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	600	687	88,115	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	700	799	102,434	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	950	1,126	144,410	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	600	882	113,120	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,030	1,167	149,675	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	520	540	69,270	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	490	550	70,507	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	560	608	77,989	2018/1/4

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4 BUND 370104	4.0	480	739	94,805	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	430	459	58,835	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	691	88,554	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	400	655	84,025	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	450	670	85,970	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	600	978	125,457	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	710	1,254	160,777	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	500	827	106,044	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	450	710	91,039	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	340	504	64,655	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	250	433	55,504	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	330	548	70,228	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	500	502	64,414	2018/5/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	300	301	38,671	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	300	303	38,925	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	800	811	104,042	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	514	65,913	2019/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	719	92,162	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	514	65,962	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,044	133,820	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	600	602	77,205	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	500	475	60,996	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	400	416	53,343	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	450	484	62,058	2021/12/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	500	537	68,919	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	500	545	69,844	2024/12/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	400	447	57,349	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	750	796	102,081	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	600	648	83,133	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	600	658	84,375	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	500	594	76,214	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	700	810	103,802	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	550	638	81,766	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,130	1,314	168,485	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	750	892	114,436	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	850	885	113,415	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	696	89,238	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	860	1,083	138,868	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	700	787	100,873	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	900	1,028	131,839	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,309	167,769	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	872	111,798	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	710	789	101,176	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	500	567	72,712	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	300	349	44,842	2020/2/1
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	500	617	79,167	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	750	933	119,655	2024/3/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	500	636	81,586	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,000	1,060	135,883	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	800	975	124,982	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	730	918	117,755	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,191	152,738	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	500	710	90,996	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	600	747	95,728	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	1,015	130,198	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	500	706	90,550	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	700	1,009	129,341	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	470	674	86,478	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	520	561	71,975	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	800	1,118	143,276	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	450	579	74,298	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	645	82,727	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	640	965	123,749	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	850	1,287	164,959	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,197	153,508	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	300	465	59,622	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	380	598	76,756	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	900	906	116,176	2018/2/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	600	608	77,989	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,200	1,231	157,778	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	200	196	25,181	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,100	1,122	143,890	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	600	618	79,296	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	750	777	99,649	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	700	728	93,405	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	800	816	104,637	2025/11/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	300	305	39,140	2031/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	600	613	78,673	2017/2/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,000	1,101	141,093	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,700	1,868	239,389	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,000	1,133	145,264	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,598	204,823	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	900	1,009	129,371	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,050	1,217	156,019	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	700	833	106,798	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	800	941	120,619	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	1,500	1,772	227,190	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	500	659	84,527	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,293	165,717	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,400	1,769	226,747	2026/4/25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	910	957	122,651	2017/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,733	222,164	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,100	1,316	168,678	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	800	878	112,561	2018/4/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O. A. T 381025	4.0	750	1,081	138,647	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	450	701	89,834	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	380	599	76,768	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	1,160	1,253	160,694	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	680	765	98,095	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	770	883	113,185	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	1,050	1,359	174,238	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	820	1,286	164,843	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	840	1,291	165,500	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	850	1,304	167,111	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	770	1,271	162,982	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	510	766	98,194	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	300	398	51,010	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	200	317	40,724	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	200	201	25,841	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	713	91,454	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	500	484	62,133	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	500	505	64,799	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	400	413	52,941	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	418	53,687	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	400	444	56,913	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	400	453	58,082	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	569	72,962	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	300	308	39,536	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	400	485	62,186	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	300	404	51,806	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	500	590	75,624	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	360	419	53,755	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	499	64,008	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	490	758	97,138	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	630	698	89,469	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	450	517	66,294	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	400	606	77,689	2037/1/15		
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	560	600	76,974	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	390	599	76,791	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	100	150	19,343	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	500	501	64,292	2018/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	90,471	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	600	622	79,754	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	500	499	63,956	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	300	289	37,053	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	400	410	52,626	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	600	623	79,904	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	600	648	83,056	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	656	84,113	2024/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	550	604	77,495	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	720	748	95,861	2017/1/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	900	1,058	135,605	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	780	893	114,495	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	380	417	53,544	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	470	583	74,830	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	960	1,099	140,923	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	550	671	86,115	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	600	653	83,737	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	689	88,373	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	840	1,059	135,720	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	420	560	71,869	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	390	488	62,658	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	800	956	122,629	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	500	684	87,683	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	550	736	94,435	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	350	501	64,298	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	600	767	98,380	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	970	1,050	134,610	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	700	870	111,525	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	560	819	104,972	2032/7/30
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	899	115,288	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	500	693	88,865	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	530	763	97,824	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	500	502	64,344	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	300	311	39,936	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	350	397	50,977	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	550	641	82,256	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	200	223	28,670	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	200	246	31,610	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	350	369	47,337	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	600	708	90,760	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	330	473	60,664	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	360	378	48,519	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	400	438	56,145	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	500	568	72,824	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	480	593	76,090	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	480	61,537	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	450	556	71,360	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	500	632	81,106	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	510	773	99,132	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	544	69,716	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	600	943	120,951	2035/3/28
5.5 BEL GOVT 170928	5.5	310	340	43,655	2017/9/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	500	752	96,461	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	305	39,154	2019/10/18
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	150	156	20,010	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	150	156	20,115	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	438	56,165	2024/10/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
					評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	200	221	28,359	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	300	322	41,339	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	230	268	34,439	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	200	273	35,019	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	240	249	31,940	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	364	46,739	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	370	443	56,787	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	400	488	62,557	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	80	134	17,181	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	270	319	40,901	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	523	67,132	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	320	344	44,173	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	400	458	58,743	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	330	362	46,509	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	350	44,870	2026/3/15
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	350	555	71,138	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	100	102	13,107	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOV 310415	0.75	100	93	11,963	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	50	6,497	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	150	155	19,976	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	150	162	20,883	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	100	109	14,038	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	200	205	26,350	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	21,581	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	100	127	16,311	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	240	30,877	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	200	230	29,479	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	296	37,969	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	100	107	13,717	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	300	391	50,220	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	150	174	22,308	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	2 IRISH GOVT 450218	2.0	150	149	19,140	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	240	268	34,429	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	300	362	46,422	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	250	309	39,656	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	320	369	47,298	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	250	282	36,173	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	240	285	36,602	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	431	55,321	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	340	472	60,592	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	150	165	21,157	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	200	244	31,322	2019/10/18
小 計						22,154,065	
イギリス	国債証券	1 GILT 170907	1.0	900	908	152,548	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	800	812	136,492	2018/7/22
		1.75 GILT 170122	1.75	400	405	68,104	2017/1/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	1.75 GILT 190722	1.75	600	618	103,880	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	500	512	86,067	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	800	833	139,971	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	700	719	120,799	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	650	685	115,178	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	150	158	26,689	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	800	874	146,862	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	550	637	107,017	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	380	461	77,525	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	540	736	123,701	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	420	464	77,935	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	700	787	132,195	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	860	980	164,628	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	400	536	90,115	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	700	815	136,885	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	310	456	76,588	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	410	515	86,551	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	940	1,210	203,201	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	300	391	65,765	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	640	849	142,643	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	760	1,017	170,907	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	420	587	98,631	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	500	717	120,528	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	700	1,056	177,426	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	700	782	131,443	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	480	641	107,784	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,010	1,420	238,507	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	700	808	135,839	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	560	753	126,543	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	470	664	111,619	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	650	712	119,686	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	400	516	86,720	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	330	486	81,735	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	350	475	79,794	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	200	226	38,094	2017/8/25
小	計					4,406,615	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	120	137	16,013	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	120	136	15,914	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	120	129	15,067	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	150	169	19,765	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	200	264	30,819	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	180	270	31,467	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	120	128	14,959	2017/6/5
小	計					144,006	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	900	904	12,467	2026/11/12

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
スウェーデン			%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,400	2,583	35,619	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,950	2,265	31,234	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	2,650	3,183	43,904	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,400	1,853	25,553	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	2,060	2,196	30,291	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	2,450	2,802	38,641	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	2,470	3,066	42,283	2020/12/1
小	計					259,995	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,000	1,025	13,821	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,840	24,803	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,300	1,464	19,746	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,350	2,686	36,207	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	1,970	2,061	27,795	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	1,930	2,170	29,258	2019/5/22
小	計					151,633	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,800	1,944	33,395	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,200	2,407	41,336	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	2,600	3,026	51,965	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	1,500	1,616	27,751	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	2,710	3,133	53,798	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,830	6,291	108,025	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	790	1,234	21,191	2024/11/10
小	計					337,463	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	850	823	23,546	2020/4/25
		2 POLAND 210425	2.0	700	681	19,491	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	700	714	20,425	2018/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	600	625	17,892	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	950	958	27,410	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	600	628	17,970	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	800	855	24,477	2023/10/25
		4.75 POLAND 170425	4.75	400	416	11,903	2017/4/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	890	946	27,072	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	500	564	16,144	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	560	629	18,007	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	450	525	15,018	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	600	707	20,247	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	500	613	17,532	2029/4/25
		POLAND 170725	—	350	342	9,794	2017/7/25
小	計					286,937	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	350	343	28,184	2020/11/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	400	410	33,684	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	600	605	49,692	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	184	15,138	2035/6/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	350	362	29,700	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	900	941	77,210	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	300	308	25,327	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	200	196	16,084	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	220	234	19,261	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	650	671	55,108	2017/7/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	650	737	60,448	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	650	714	58,584	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	290	341	28,028	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	700	829	68,066	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	780	857	70,348	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	854	70,100	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	700	838	68,793	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	660	775	63,631	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	650	780	64,007	2022/7/15
		6 AUST GOVT 170215	6.0	380	395	32,476	2017/2/15
小	計					933,880	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	200	196	16,245	2018/4/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	100	100	8,260	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	400	402	33,199	2020/7/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	200	201	16,648	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 170401	2.375	400	406	33,556	2017/4/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	50	49	4,118	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	100	103	8,518	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	200	206	17,030	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	270	265	21,931	2042/4/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	102	8,456	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	203	16,793	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	200	210	17,339	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	150	158	13,108	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	110	116	9,623	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	300	326	26,902	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	270	295	24,359	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	240	256	21,173	2018/9/1
小	計					297,267	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド			
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	5,100	5,396	38,527	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	2,700	1,808	12,912	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	2,800	1,863	13,304	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,400	1,255	8,965	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	2,500	1,920	13,715	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	1,900	1,783	12,733	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,400	2,188	15,627	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,500	1,467	10,475	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,600	2,215	15,816	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	1,300	1,296	9,259	2017/9/15

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	8.25 SOUTH AFRICA 320331	2,700	2,306	16,465	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	2,500	2,129	15,201	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	700	600	4,287	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	2,800	2,399	17,132	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	400	356	2,544	2035/2/28
小	計				206,969	
合	計				54,811,296	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	54,811,296	95.4
コール・ローン等、その他	2,670,705	4.6
投資信託財産総額	57,482,001	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(55,640,906千円)の投資信託財産総額(57,482,001千円)に対する比率は96.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=118.14円	1 カナダドル=82.70円	1 メキシコペソ=6.35円	1 ユーロ=128.15円
1 イギリスポンド=167.92円	1 スイスフラン=116.51円	1 スウェーデンクローネ=13.79円	1 ノルウェークローネ=13.48円
1 デンマーククローネ=17.17円	1 ポーランドズロチ=28.60円	1 オーストラリアドル=82.02円	1 シンガポールドル=82.49円
1 南アフリカランド=7.14円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	112,479,821,880
コール・ローン等	418,058,424
公社債(評価額)	54,811,296,824
未収入金	56,751,650,466
未収利息	429,104,276
前払費用	69,711,890
(B) 負債	55,125,001,759
未払金	54,998,177,800
未払解約金	126,823,959
(C) 純資産総額(A-B)	57,354,820,121
元本	45,472,741,060
次期繰越損益金	11,882,079,061
(D) 受益権総口数	45,472,741,060口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,613円

<注記事項>

- ①期首元本額 26,203,208,067円
 期中追加設定元本額 26,366,591,851円
 期中一部解約元本額 7,097,058,858円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2613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 バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,069,577,478円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	6,280,361,977円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	327,327,497円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	50,864,041円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	805,655,070円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	213,069,613円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	16,974,419,433円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,951,816,138円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	288,533,978円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	355,477,673円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	155,535,118円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	103,044円
合計	45,472,741,060円

[お知らせ]

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,062,184,568
受取利息	1,062,184,568
(B) 有価証券売買損益	△ 640,874,450
売買益	7,913,002,727
売買損	△ 8,553,877,177
(C) 保管費用等	△ 7,222,062
(D) 当期損益金(A+B+C)	414,088,056
(E) 前期繰越損益金	6,918,703,275
(F) 追加信託差損益金	6,409,673,417
(G) 解約差損益金	△ 1,860,385,687
(H) 計(D+E+F+G)	11,882,079,061
次期繰越損益金(H)	11,882,079,061

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (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。