

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2001年12月5日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、わが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI 総合インデックスと連動する投資成果をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	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	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の利子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。

## 運用報告書（全体版）

# 三菱UFJ <DC> 日本債券インデックス ファンド



第14期（決算日：2015年5月12日）



### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド」は、去る5月12日に第14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投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となる予定です。



## 三菱UFJ投信

MUFG

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

お客様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)

お客様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

## 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンドのご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	7
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	8
◇利害関係人との取引状況等	9
◇組入資産の明細	10
◇投資信託財産の構成	10
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
◇損益の状況	11
◇お知らせ	11

## 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	12
--------------------	----

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 総合インデックス		債券 組入比率	債券 先物比率	純資 産額		
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				中 落	率
	円		円		%	%	%	百万円		
10期(2011年5月12日)	10,988		0		1.4	331.63	1.9	99.4	—	1,385
11期(2012年5月14日)	11,241		0		2.3	340.97	2.8	99.4	0.1	1,723
12期(2013年5月13日)	11,352		0		1.0	345.99	1.5	98.9	0.8	2,091
13期(2014年5月12日)	11,545		0		1.7	353.58	2.2	99.3	0.2	2,707
14期(2015年5月12日)	11,744		0		1.7	361.38	2.2	99.4	0.3	3,136

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2014年5月12日	11,545	—	353.58	—	99.3	0.2
5月末	11,570	0.2	354.39	0.2	99.5	0.1
6月末	11,599	0.5	355.41	0.5	99.7	0.1
7月末	11,613	0.6	356.01	0.7	99.6	0.1
8月末	11,646	0.9	357.15	1.0	99.3	0.3
9月末	11,649	0.9	357.41	1.1	99.5	0.4
10月末	11,699	1.3	359.08	1.6	98.3	1.1
11月末	11,764	1.9	361.19	2.2	98.9	0.7
12月末	11,880	2.9	364.96	3.2	99.2	0.2
2015年1月末	11,879	2.9	365.07	3.2	100.2	0.2
2月末	11,810	2.3	363.04	2.7	99.5	0.1
3月末	11,812	2.3	363.28	2.7	100.1	—
4月末	11,845	2.6	364.50	3.1	99.7	0.2
(期 末) 2015年5月12日	11,744	1.7	361.38	2.2	99.4	0.3

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

(第14期：2014/5/13～2015/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ1.7%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%)を0.5%下回りました。



## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	世界景気に対する慎重な見方が広がったことや日銀が「量的・質的金融緩和」を拡大したことなどを背景に、債券市況(NOMURA-BPI総合インデックス)が上昇(利回りは低下)したことが基準価額の上昇要因となりました。
------	---

## 投資環境について

(第14期：2014/5/13～2015/5/12)

## ◎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

## &lt;三菱UFJ &lt;DC&gt;日本債券インデックスファンド&gt;

- ・当ファンドは日本債券インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）に資産のほぼ全額を投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

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

(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)

期首 (2014年5月12日)

最終利回り	0.5%
直接利回り	1.2%
デュレーション	7.6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。

期末 (2015年5月12日)

最終利回り	0.4%
直接利回り	1.1%
デュレーション	8.0年

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

<三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

ベンチマークとのカイ離は、 $\Delta 0.5\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

	マザーファンド保有以外の要因	マザーファンド保有による要因	合計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.5\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.5\%$ 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。

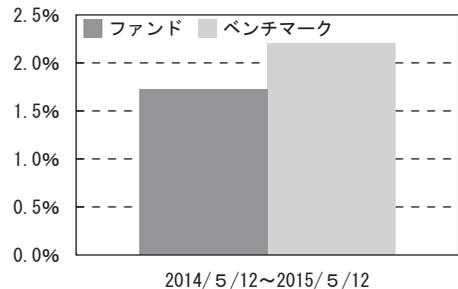
<マザーファンド保有以外の要因>

ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

<マザーファンド保有による要因>

マザーファンド保有による要因は0.0%程度でした。

基準価額 (ハビーファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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。

## 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14期
	2014年5月13日～2015年5月12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	1,977

(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

### <三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックスと連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を日本債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

### <日本債券インデックスマザーファンド>

- ・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) 信 託 報 酬	円 57	% 0.486	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(23)	(0.193)	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 )	(28)	(0.239)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	( 6 )	(0.054)	投資信託財産の保管・管理、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
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 0 )	(0.000)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	57	0.489	
期中の平均基準価額は、11,730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

(2014年5月13日～2015年5月12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
日本債券インデックスマザーファンド	千口 502,612	千円 629,096	千口 208,690	千円 261,531

## ○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

## &lt;三菱UFJ &lt;DC&gt;日本債券インデックスファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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	140,321	38,627	27.5	81,907	24,091	29.4

平均保有割合 1.0%

※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みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日本債券インデックスマザーファンド	千口 2,200,763	千口 2,494,686	千円 3,136,319

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

## ○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
日本債券インデックスマザーファンド	千円 3,136,319	% 99.6
コール・ローン等、その他	13,285	0.4
投資信託財産総額	3,149,604	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	3,149,604,862
コール・ローン等	13,285,111
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,136,319,733
未収利息	18
(B) 負債	12,956,563
未払解約金	5,516,472
未払信託報酬	7,397,407
その他未払費用	42,684
(C) 純資産総額(A-B)	3,136,648,299
元本	2,670,813,691
次期繰越損益金	465,834,608
(D) 受益権総口数	2,670,813,691口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,744円

## &lt;注記事項&gt;

①期首元本額	2,344,663,606円
期中追加設定元本額	816,424,762円
期中一部解約元本額	490,274,677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	4,848
受取利息	4,848
(B) 有価証券売買損益	54,025,319
売買益	65,070,437
売買損	△ 11,045,118
(C) 信託報酬等	△ 14,418,257
(D) 当期損益金(A+B+C)	39,611,910
(E) 前期繰越損益金	94,276,632
(F) 追加信託差損益金	331,946,066
(配当等相当額)	( 393,505,930)
(売買損益相当額)	(△ 61,559,864)
(G) 計(D+E+F)	465,834,608
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	465,834,608
追加信託差損益金	331,946,066
(配当等相当額)	( 394,298,225)
(売買損益相当額)	(△ 62,352,159)
分配準備積立金	133,888,542

- (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) (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。

## ②分配金の計算過程

		第14期
費用控除後の配当等収益額	A	25,425,740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	B	14,186,170円
収益調整金額	C	394,298,225円
分配準備積立金額	D	94,276,632円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	528,186,767円
当ファンドの期末残存口数	F	2,670,813,691口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,977円
1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	-円

※三菱UFJ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】

- ①運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。  
(2014年12月1日)
- ②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)
- ③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)

# 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		NOMURA-BPI 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、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合インデックスは野村證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、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 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	円	%		%	%	%
	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	
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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	
<b>地方債証券</b>				
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
<b>地方債証券</b>	%	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
<b>地方債証券</b>	%	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
<b>地方債証券</b>	%	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
<b>地方債証券</b>	%	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	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,018	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	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	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
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		
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	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	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	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回首都高速道路	0.336	100,000	100,531	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,072	2019/9/20
第10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	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	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回沖繩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	
<b>金融債券</b>				
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
<b>金融債券</b>	%	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	
<b>普通社債券</b>				
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
<b>普通社債券</b>	%	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回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	100,295	2015/9/3
第8回ウエストパック・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

## &lt;注記事項&gt;

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）