

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。 | |
| | <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div> | |

※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17期（決算日：2018年5月14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14日に第17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
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 額 | | | NOMURA-BPI総合 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|---------------|------|------|------|--------------|------|--------|--------|-------|
| | | 税込分配 | み金騰落 | 期中率 | 期中率 | 騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 15期(2016年5月12日) | 12,524 | | 0 | 6.6 | 387.29 | 7.2 | 99.6 | — | 3,890 |
| 16期(2017年5月12日) | 12,192 | | 0 | △2.7 | 378.85 | △2.2 | 99.3 | 0.2 | 4,371 |
| 17期(2018年5月14日) | 12,227 | | 0 | 0.3 | 381.82 | 0.8 | 98.4 | 0.3 | 4,601 |

(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・デフ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。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | N O M U R A - B P I 総 合 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|--------|-------------------------|--------|-------------|-----------|
| | 円 | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2017年5月12日 | 12,192 | % — | 378.85 | % — | 99.3 | 0.2 |
| 5月末 | 12,211 | 0.2 | 379.55 | 0.2 | 99.3 | 0.2 |
| 6月末 | 12,172 | △0.2 | 378.57 | △0.1 | 99.5 | 0.3 |
| 7月末 | 12,170 | △0.2 | 378.55 | △0.1 | 100.2 | 0.1 |
| 8月末 | 12,230 | 0.3 | 380.58 | 0.5 | 99.6 | 0.4 |
| 9月末 | 12,182 | △0.1 | 379.27 | 0.1 | 99.4 | 0.2 |
| 10月末 | 12,176 | △0.1 | 379.27 | 0.1 | 99.4 | 0.3 |
| 11月末 | 12,204 | 0.1 | 380.26 | 0.4 | 99.0 | 0.4 |
| 12月末 | 12,206 | 0.1 | 380.51 | 0.4 | 99.6 | 0.2 |
| 2018年1月末 | 12,182 | △0.1 | 379.85 | 0.3 | 99.4 | 0.3 |
| 2月末 | 12,223 | 0.3 | 381.29 | 0.6 | 97.5 | 0.4 |
| 3月末 | 12,238 | 0.4 | 381.91 | 0.8 | 99.6 | 0.4 |
| 4月末 | 12,224 | 0.3 | 381.64 | 0.7 | 99.3 | 0.4 |
| (期 末) 2018年5月14日 | 12,227 | 0.3 | 381.82 | 0.8 | 98.4 | 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。

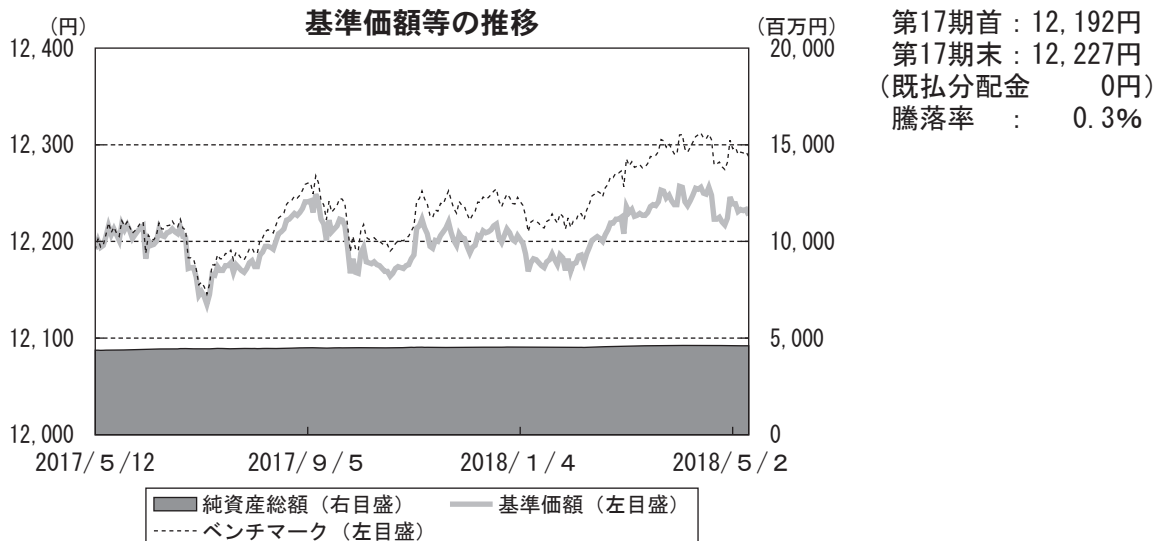
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第17期：2017/5/13～2018/5/14)

| | |
|------------|--|
| 基準価額の動き | 基準価額は期首に比べ0.3%の上昇となりました。 |
| ベンチマークとの差異 | ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.8%)を0.5%下回りました。 |



・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。



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

基準価額の主な変動要因

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | 日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市況が上昇したことなど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17期：2017/5/13～2018/5/14)

◎国内債券市況

- ・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

<三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

- ・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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

基準価額は期首に比べ0.8%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等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。
- ※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

(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 (2017年5月12日)

期末 (2018年5月14日)

| | | | | |
|---------|------|---|---------|------|
| 最終利回り | 0.1% | → | 最終利回り | 0.1% |
| 直接利回り | 1.0% | | 直接利回り | 0.9% |
| デュレーション | 8.7年 | | デュレーション | 8.9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

i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

<三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

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

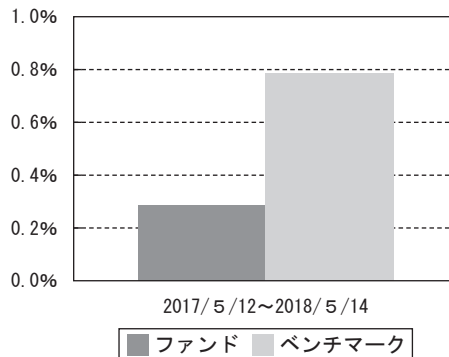
| | マザーファンド 保有以外の要因 | マザーファンド 保有による要因 | 合計 |
|----------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| ベンチマーク との乖離 | $\Delta 0.5\%$ 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.5\%$ 程度 |

(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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

基準価額 (ベビーファンド) と ベンチマークの対比 (騰落率)



<日本債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは0.8%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 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 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | 0.0%程度 | $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 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

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、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17期 |
|-----------|-----------------------|
| | 2017年5月13日～2018年5月14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 | 2,806 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

<三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

- ・ベンチマークに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>

- ・ベンチマークに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

(2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|----------------------------------|---|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 円 60 (24) (29) (7) | % 0.488 (0.195) (0.239) (0.054) | (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) 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 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 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 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 0 (0) | 0.000 (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 |
| (c) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) | 0 (0) | 0.003 (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 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 | 60 | 0.491 | |
| 期中の平均基準価額は、12,201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) 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

(2017年5月13日～2018年5月14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 390,656 | 千円 516,436 | 千口 243,549 | 千円 322,006 |

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド>

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 | 百万円 350,947 | 百万円 82,945 | % 23.6 | 百万円 267,684 | 百万円 61,470 | % 23.0 |

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

<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 319 | 百万円 502 | 百万円 1,547 |

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 2,000 |

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

○組入資産の明細

(2018年5月14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 3,316,415 | 千口 3,463,521 | 千円 4,600,596 |

○投資信託財産の構成

(2018年5月14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 4,600,596 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 15,006 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 4,615,602 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 4,615,602,321 |
| コール・ローン等 | 14,765,123 |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 4,600,596,198 |
| 未収入金 | 241,000 |
| (B) 負債 | 14,279,793 |
| 未払解約金 | 3,099,191 |
| 未払信託報酬 | 11,116,415 |
| 未払利息 | 19 |
| その他未払費用 | 64,168 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 4,601,322,528 |
| 元本 | 3,763,117,563 |
| 次期繰越損益金 | 838,204,965 |
| (D) 受益権総口数 | 3,763,117,563口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,227円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 3,585,432,313円
 期中追加設定元本額 754,253,531円
 期中一部解約元本額 576,568,281円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,227円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2017年5月13日～ 2018年5月14日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 20,300,178円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | －円 |
| 収益調整金額 | 774,284,459円 |
| 分配準備積立金額 | 261,609,681円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 1,056,194,318円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 2,806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 (2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 6,197 |
| 受取利息 | 78 |
| 支払利息 | △ 6,275 |
| (B) 有価証券売買損益 | 34,668,946 |
| 売買益 | 38,162,901 |
| 売買損 | △ 3,493,955 |
| (C) 信託報酬等 | △ 22,177,970 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 12,484,779 |
| (E) 前期繰越損益金 | 153,499,915 |
| (F) 追加信託差損益金 | 672,220,271 |
| (配当等相当額) | (773,842,223) |
| (売買損益相当額) | (△101,621,952) |
| (G) 計(D+E+F) | 838,204,965 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 838,204,965 |
| 追加信託差損益金 | 672,220,271 |
| (配当等相当額) | (774,284,459) |
| (売買損益相当額) | (△102,064,188) |
| 分配準備積立金 | 281,909,859 |
| 繰越損益金 | △115,925,165 |

- (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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ②よりわかりやすい記載を目的として目論見書の特色の配分方針に「分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)」を掲載しました。

日本債券インデックスマザーファンド

《第17期》決算日2018年5月14日

[計算期間：2017年5月13日～2018年5月14日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月14日に第17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17期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 |
| 主要運用対象 | NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資は行いません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | NOMURA-BPI総合 | | 債組入比率 | 債先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|------|--------------|------|-------|-------|---------|
| | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 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 |
| 15期(2016年5月12日) | 13,473 | 7.2 | 387.29 | 7.2 | 99.6 | — | 529,456 |
| 16期(2017年5月12日) | 13,180 | △2.2 | 378.85 | △2.2 | 99.3 | 0.2 | 457,117 |
| 17期(2018年5月14日) | 13,283 | 0.8 | 381.82 | 0.8 | 98.4 | 0.3 | 544,273 |

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、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 総 合 | | 債 組 入 比 率 % | 債 先 物 比 率 % |
|---------------------|---------|------------|-------------------------|------------|----------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2017年5月12日 | 13,180 | — | 378.85 | — | 99.3 | 0.2 |
| 5月末 | 13,204 | 0.2 | 379.55 | 0.2 | 99.3 | 0.2 |
| 6月末 | 13,167 | △0.1 | 378.57 | △0.1 | 99.5 | 0.3 |
| 7月末 | 13,170 | △0.1 | 378.55 | △0.1 | 100.2 | 0.1 |
| 8月末 | 13,240 | 0.5 | 380.58 | 0.5 | 99.6 | 0.4 |
| 9月末 | 13,193 | 0.1 | 379.27 | 0.1 | 99.4 | 0.2 |
| 10月末 | 13,193 | 0.1 | 379.27 | 0.1 | 99.4 | 0.3 |
| 11月末 | 13,228 | 0.4 | 380.26 | 0.4 | 99.0 | 0.4 |
| 12月末 | 13,236 | 0.4 | 380.51 | 0.4 | 99.6 | 0.2 |
| 2018年1月末 | 13,215 | 0.3 | 379.85 | 0.3 | 99.4 | 0.3 |
| 2月末 | 13,265 | 0.6 | 381.29 | 0.6 | 97.5 | 0.4 |
| 3月末 | 13,286 | 0.8 | 381.91 | 0.8 | 99.6 | 0.4 |
| 4月末 | 13,276 | 0.7 | 381.64 | 0.7 | 99.3 | 0.4 |
| (期 末) 2018年5月14日 | 13,283 | 0.8 | 381.82 | 0.8 | 98.4 | 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

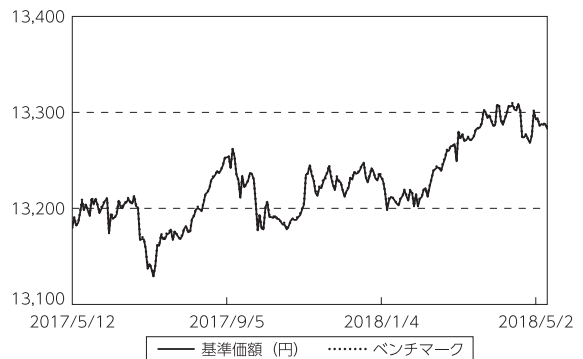
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.8%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市場は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
 ベンチマークは0.8%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 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 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | 0.0%程度 | $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 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

・ベンチマークに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

(2017年5月13日～2018年5月14日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション) | 円 0 (0) | % 0.000 (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合 計 | 0 | 0.000 | |
| 期中の平均基準価額は、13,222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

(2017年5月13日～2018年5月14日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|-------|-------------|------------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | 国債証券 | 303,108,641 | 234,242,516 |
| | 地方債証券 | 15,154,496 | 10,205,885 |
| | 特殊債券 | 22,011,187 | 15,106,140 |
| | 社債券 | 10,673,329 | (8,130,265) (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 15,973 | 百万円 15,079 | 百万円 - | 百万円 - |

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 350,947 | 百万円 82,945 | % 23.6 | 百万円 267,684 | 百万円 61,470 | % 23.0 |

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|------------|--------------|
| 公社債 | 百万円 319 | 百万円 502 | 百万円 1,547 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|--------------|
| 公社債 | 百万円 2,000 |

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

○組入資産の明細

(2018年5月14日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | | 末 | | | |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|-----------------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 408,788,000 (100,000) | 444,023,378 (100,145) | 81.6 (0.0) | — (—) | 51.7 (—) | 19.2 (—) | 10.6 (0.0) |
| 地方債証券 | 28,747,780 (28,747,780) | 30,287,806 (30,287,806) | 5.6 (5.6) | — (—) | 3.9 (3.9) | 1.2 (1.2) | 0.5 (0.5) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 32,520,095 (32,520,095) | 34,739,428 (34,739,428) | 6.4 (6.4) | — (—) | 4.5 (4.5) | 1.5 (1.5) | 0.4 (0.4) |
| 金融債券 | 3,400,000 (3,400,000) | 3,404,958 (3,404,958) | 0.6 (0.6) | — (—) | 0.0 (0.0) | 0.4 (0.4) | 0.2 (0.2) |
| 普通社債券 | 22,683,000 (22,683,000) | 23,349,438 (23,349,438) | 4.3 (4.3) | 0.1 (0.1) | 1.9 (1.9) | 1.8 (1.8) | 0.6 (0.6) |
| 合 計 | 496,138,875 (87,450,875) | 535,805,011 (91,881,777) | 98.4 (16.9) | 0.1 (0.1) | 62.0 (10.3) | 24.1 (4.9) | 12.3 (1.7) |

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第377回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,500,000 | 1,503,900 | 2019/6/15 |
| 第378回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,500,000 | 1,504,200 | 2019/7/15 |
| 第381回利付国債 (2年) | 0.1 | 3,500,000 | 3,511,935 | 2019/10/15 |
| 第382回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,400,000 | 1,405,054 | 2019/11/15 |
| 第383回利付国債 (2年) | 0.1 | 4,190,000 | 4,205,963 | 2019/12/15 |
| 第384回利付国債 (2年) | 0.1 | 2,450,000 | 2,459,849 | 2020/1/15 |
| 第385回利付国債 (2年) | 0.1 | 6,050,000 | 6,075,531 | 2020/2/15 |
| 第386回利付国債 (2年) | 0.1 | 6,350,000 | 6,378,003 | 2020/3/15 |
| 第387回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,500,000 | 1,506,915 | 2020/4/15 |
| 第118回利付国債 (5年) | 0.2 | 2,260,000 | 2,268,452 | 2019/6/20 |
| 第119回利付国債 (5年) | 0.1 | 450,000 | 451,188 | 2019/6/20 |
| 第120回利付国債 (5年) | 0.2 | 2,500,000 | 2,511,325 | 2019/9/20 |
| 第121回利付国債 (5年) | 0.1 | 1,580,000 | 1,585,008 | 2019/9/20 |
| 第122回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,270,000 | 3,282,033 | 2019/12/20 |
| 第123回利付国債 (5年) | 0.1 | 1,560,000 | 1,566,489 | 2020/3/20 |
| 第124回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,430,000 | 2,441,493 | 2020/6/20 |
| 第125回利付国債 (5年) | 0.1 | 4,400,000 | 4,423,320 | 2020/9/20 |
| 第126回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,960,000 | 2,977,345 | 2020/12/20 |
| 第127回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,770,000 | 2,787,783 | 2021/3/20 |
| 第128回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,550,000 | 2,567,824 | 2021/6/20 |
| 第129回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,750,000 | 2,770,350 | 2021/9/20 |
| 第130回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,150,000 | 3,174,475 | 2021/12/20 |
| 第131回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,110,000 | 3,135,222 | 2022/3/20 |
| 第132回利付国債 (5年) | 0.1 | 4,250,000 | 4,285,827 | 2022/6/20 |
| 第133回利付国債 (5年) | 0.1 | 4,620,000 | 4,661,349 | 2022/9/20 |
| 第134回利付国債 (5年) | 0.1 | 6,010,000 | 6,066,914 | 2022/12/20 |
| 第135回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,980,000 | 4,019,720 | 2023/3/20 |
| 第1回利付国債 (40年) | 2.4 | 475,000 | 684,498 | 2048/3/20 |
| 第2回利付国債 (40年) | 2.2 | 680,000 | 948,382 | 2049/3/20 |
| 第3回利付国債 (40年) | 2.2 | 583,000 | 817,109 | 2050/3/20 |
| 第4回利付国債 (40年) | 2.2 | 1,008,000 | 1,419,374 | 2051/3/20 |
| 第5回利付国債 (40年) | 2.0 | 1,045,000 | 1,414,794 | 2052/3/20 |
| 第6回利付国債 (40年) | 1.9 | 1,070,000 | 1,419,740 | 2053/3/20 |
| 第7回利付国債 (40年) | 1.7 | 1,100,000 | 1,393,249 | 2054/3/20 |
| 第8回利付国債 (40年) | 1.4 | 1,140,000 | 1,338,451 | 2055/3/20 |
| 第9回利付国債 (40年) | 0.4 | 1,870,000 | 1,592,548 | 2056/3/20 |
| 第10回利付国債 (40年) | 0.9 | 1,980,000 | 1,994,335 | 2057/3/20 |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,072,000 | 2,109,378 | 2019/6/20 |
| 第302回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,250,000 | 2,288,115 | 2019/6/20 |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,325,000 | 2,373,429 | 2019/9/20 |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,170,000 | 1,192,791 | 2019/9/20 |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3 | 3,258,000 | 3,332,934 | 2019/12/20 |
| 第306回利付国債 (10年) | 1.4 | 3,688,000 | 3,792,444 | 2020/3/20 |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,610,000 | 1,652,600 | 2020/3/20 |

| 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308回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,374,000 | 1,415,343 | 2020/6/20 |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1 | 3,700,000 | 3,795,756 | 2020/6/20 |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0 | 1,486,000 | 1,525,408 | 2020/9/20 |
| 第311回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,100,000 | 2,145,780 | 2020/9/20 |
| 第312回利付国債 (10年) | 1.2 | 6,860,000 | 7,097,081 | 2020/12/20 |
| 第313回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,969,000 | 3,089,838 | 2021/3/20 |
| 第314回利付国債 (10年) | 1.1 | 3,390,000 | 3,508,616 | 2021/3/20 |
| 第315回利付国債 (10年) | 1.2 | 1,853,000 | 1,929,362 | 2021/6/20 |
| 第316回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,780,000 | 1,847,818 | 2021/6/20 |
| 第317回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,757,000 | 1,829,107 | 2021/9/20 |
| 第318回利付国債 (10年) | 1.0 | 1,930,000 | 2,002,703 | 2021/9/20 |
| 第319回利付国債 (10年) | 1.1 | 5,519,000 | 5,761,394 | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債 (10年) | 1.0 | 1,980,000 | 2,059,794 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,515,000 | 2,622,818 | 2022/3/20 |
| 第322回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,170,000 | 1,215,641 | 2022/3/20 |
| 第323回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,675,000 | 1,744,278 | 2022/6/20 |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,800,000 | 2,904,300 | 2022/6/20 |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,835,000 | 3,984,948 | 2022/9/20 |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7 | 730,000 | 756,812 | 2022/12/20 |
| 第327回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,540,000 | 2,645,029 | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6 | 3,700,000 | 3,826,133 | 2023/3/20 |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8 | 7,710,000 | 8,063,503 | 2023/6/20 |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,930,000 | 3,069,350 | 2023/9/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 1,060,000 | 1,099,018 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 5,490,000 | 5,699,992 | 2023/12/20 |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6 | 4,180,000 | 4,345,653 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6 | 4,280,000 | 4,454,238 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5 | 3,370,000 | 3,490,275 | 2024/9/20 |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5 | 4,080,000 | 4,229,980 | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3 | 1,340,000 | 1,371,503 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4 | 3,030,000 | 3,123,657 | 2025/3/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 4,560,000 | 4,704,506 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 3,570,000 | 3,685,775 | 2025/9/20 |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3 | 3,220,000 | 3,302,174 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,450,000 | 3,483,879 | 2026/3/20 |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,360,000 | 3,391,315 | 2026/6/20 |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1 | 2,630,000 | 2,653,065 | 2026/9/20 |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1 | 5,090,000 | 5,131,534 | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1 | 2,640,000 | 2,659,800 | 2027/3/20 |
| 第347回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,450,000 | 3,475,047 | 2027/6/20 |
| 第348回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,250,000 | 3,272,717 | 2027/9/20 |
| 第349回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,590,000 | 3,612,293 | 2027/12/20 |
| 第350回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,820,000 | 1,829,809 | 2028/3/20 |
| 第1回利付国債 (30年) | 2.8 | 76,000 | 99,029 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 98,000 | 123,931 | 2030/2/20 |

| 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3回利付国債(30年) | 2.3 | 117,000 | 147,031 | 2030/5/20 |
| 第4回利付国債(30年) | 2.9 | 127,000 | 169,912 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債(30年) | 2.2 | 108,000 | 136,000 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債(30年) | 2.4 | 169,000 | 218,366 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債(30年) | 2.3 | 164,000 | 210,515 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債(30年) | 1.8 | 142,000 | 173,088 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債(30年) | 1.4 | 116,000 | 134,884 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債(30年) | 1.1 | 185,000 | 207,212 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債(30年) | 1.7 | 137,000 | 165,539 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債(30年) | 2.1 | 220,000 | 279,136 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債(30年) | 2.0 | 205,000 | 257,318 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債(30年) | 2.4 | 493,000 | 650,104 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債(30年) | 2.5 | 346,000 | 462,539 | 2034/6/20 |
| 第16回利付国債(30年) | 2.5 | 302,000 | 404,607 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債(30年) | 2.4 | 327,000 | 433,866 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債(30年) | 2.3 | 427,000 | 560,352 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債(30年) | 2.3 | 303,000 | 398,641 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債(30年) | 2.5 | 495,000 | 668,532 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債(30年) | 2.3 | 379,000 | 499,866 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債(30年) | 2.5 | 570,000 | 772,606 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債(30年) | 2.5 | 554,000 | 752,248 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債(30年) | 2.5 | 411,000 | 559,029 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債(30年) | 2.3 | 742,000 | 983,506 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債(30年) | 2.4 | 884,000 | 1,189,678 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債(30年) | 2.5 | 860,000 | 1,175,912 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債(30年) | 2.5 | 911,000 | 1,248,971 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債(30年) | 2.4 | 1,050,000 | 1,425,070 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債(30年) | 2.3 | 1,196,000 | 1,605,450 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債(30年) | 2.2 | 1,278,000 | 1,695,484 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債(30年) | 2.3 | 1,639,000 | 2,215,682 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債(30年) | 2.0 | 1,794,000 | 2,320,987 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債(30年) | 2.2 | 1,606,000 | 2,152,553 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債(30年) | 2.0 | 2,089,000 | 2,718,603 | 2041/9/20 |
| 第36回利付国債(30年) | 2.0 | 1,829,000 | 2,385,564 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債(30年) | 1.9 | 2,047,000 | 2,629,146 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債(30年) | 1.8 | 1,295,000 | 1,638,097 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債(30年) | 1.9 | 1,280,000 | 1,648,371 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債(30年) | 1.8 | 920,000 | 1,164,195 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債(30年) | 1.7 | 1,070,000 | 1,329,710 | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債(30年) | 1.7 | 1,050,000 | 1,305,517 | 2044/3/20 |
| 第43回利付国債(30年) | 1.7 | 1,180,000 | 1,467,920 | 2044/6/20 |
| 第44回利付国債(30年) | 1.7 | 1,120,000 | 1,395,553 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債(30年) | 1.5 | 1,340,000 | 1,605,588 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債(30年) | 1.5 | 1,350,000 | 1,617,840 | 2045/3/20 |
| 第47回利付国債(30年) | 1.6 | 1,720,000 | 2,103,732 | 2045/6/20 |

| 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48回利付国債 (30年) | 1.4 | 1,380,000 | 1,620,340 | 2045/9/20 |
| 第49回利付国債 (30年) | 1.4 | 1,480,000 | 1,737,712 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,540,000 | 1,575,882 | 2046/3/20 |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3 | 1,550,000 | 1,386,506 | 2046/6/20 |
| 第52回利付国債 (30年) | 0.5 | 1,510,000 | 1,425,062 | 2046/9/20 |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6 | 1,380,000 | 1,335,964 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,370,000 | 1,396,167 | 2047/3/20 |
| 第55回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,300,000 | 1,323,426 | 2047/6/20 |
| 第56回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,360,000 | 1,383,011 | 2047/9/20 |
| 第57回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,560,000 | 1,584,648 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,260,000 | 1,278,471 | 2048/3/20 |
| 第43回利付国債 (20年) | 2.9 | 74,000 | 77,038 | 2019/9/20 |
| 第44回利付国債 (20年) | 2.5 | 480,000 | 503,366 | 2020/3/20 |
| 第47回利付国債 (20年) | 2.2 | 114,000 | 120,255 | 2020/9/21 |
| 第48回利付国債 (20年) | 2.5 | 209,000 | 223,324 | 2020/12/21 |
| 第49回利付国債 (20年) | 2.1 | 515,000 | 547,795 | 2021/3/22 |
| 第51回利付国債 (20年) | 2.0 | 200,000 | 213,232 | 2021/6/21 |
| 第52回利付国債 (20年) | 2.1 | 214,000 | 229,994 | 2021/9/21 |
| 第54回利付国債 (20年) | 2.2 | 480,000 | 520,075 | 2021/12/20 |
| 第55回利付国債 (20年) | 2.0 | 241,000 | 260,655 | 2022/3/21 |
| 第56回利付国債 (20年) | 2.0 | 449,000 | 487,901 | 2022/6/20 |
| 第58回利付国債 (20年) | 1.9 | 147,000 | 159,846 | 2022/9/20 |
| 第59回利付国債 (20年) | 1.7 | 589,000 | 637,845 | 2022/12/20 |
| 第61回利付国債 (20年) | 1.0 | 289,000 | 304,331 | 2023/3/20 |
| 第63回利付国債 (20年) | 1.8 | 442,000 | 484,785 | 2023/6/20 |
| 第64回利付国債 (20年) | 1.9 | 441,000 | 487,917 | 2023/9/20 |
| 第65回利付国債 (20年) | 1.9 | 318,000 | 353,317 | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債 (20年) | 1.8 | 500,000 | 552,720 | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債 (20年) | 2.2 | 846,000 | 958,737 | 2024/3/20 |
| 第70回利付国債 (20年) | 2.4 | 422,000 | 485,540 | 2024/6/20 |
| 第71回利付国債 (20年) | 2.2 | 160,000 | 182,132 | 2024/6/20 |
| 第72回利付国債 (20年) | 2.1 | 534,000 | 607,141 | 2024/9/20 |
| 第73回利付国債 (20年) | 2.0 | 620,000 | 703,929 | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債 (20年) | 2.1 | 318,000 | 363,152 | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債 (20年) | 2.1 | 575,000 | 659,473 | 2025/3/20 |
| 第76回利付国債 (20年) | 1.9 | 200,000 | 226,636 | 2025/3/20 |
| 第77回利付国債 (20年) | 2.0 | 210,000 | 239,410 | 2025/3/20 |
| 第78回利付国債 (20年) | 1.9 | 410,000 | 466,621 | 2025/6/20 |
| 第79回利付国債 (20年) | 2.0 | 50,000 | 57,261 | 2025/6/20 |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1 | 315,000 | 362,987 | 2025/6/20 |
| 第81回利付国債 (20年) | 2.0 | 350,000 | 402,489 | 2025/9/20 |
| 第82回利付国債 (20年) | 2.1 | 662,000 | 766,159 | 2025/9/20 |
| 第83回利付国債 (20年) | 2.1 | 413,000 | 480,005 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) | 2.0 | 670,000 | 773,602 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年) | 2.1 | 490,000 | 571,634 | 2026/3/20 |

| 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86回利付国債 (20年) | 2.3 | 515,000 | 608,894 | 2026/3/20 |
| 第87回利付国債 (20年) | 2.2 | 450,000 | 528,507 | 2026/3/20 |
| 第88回利付国債 (20年) | 2.3 | 804,000 | 954,918 | 2026/6/20 |
| 第89回利付国債 (20年) | 2.2 | 410,000 | 483,636 | 2026/6/20 |
| 第90回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,100,000 | 1,302,620 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 468,000 | 558,118 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,432,000 | 1,689,888 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債 (20年) | 2.0 | 390,000 | 458,394 | 2027/3/20 |
| 第94回利付国債 (20年) | 2.1 | 615,000 | 728,283 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債 (20年) | 2.3 | 1,017,000 | 1,227,590 | 2027/6/20 |
| 第96回利付国債 (20年) | 2.1 | 320,000 | 380,448 | 2027/6/20 |
| 第97回利付国債 (20年) | 2.2 | 343,000 | 412,594 | 2027/9/20 |
| 第98回利付国債 (20年) | 2.1 | 470,000 | 560,977 | 2027/9/20 |
| 第99回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,345,000 | 1,610,731 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,060,000 | 1,283,925 | 2028/3/20 |
| 第101回利付国債 (20年) | 2.4 | 573,000 | 705,282 | 2028/3/20 |
| 第102回利付国債 (20年) | 2.4 | 530,000 | 654,815 | 2028/6/20 |
| 第103回利付国債 (20年) | 2.3 | 640,000 | 784,294 | 2028/6/20 |
| 第104回利付国債 (20年) | 2.1 | 300,000 | 361,611 | 2028/6/20 |
| 第105回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,020,000 | 1,233,404 | 2028/9/20 |
| 第106回利付国債 (20年) | 2.2 | 891,000 | 1,086,583 | 2028/9/20 |
| 第107回利付国債 (20年) | 2.1 | 567,000 | 687,742 | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9 | 800,000 | 953,536 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) | 1.9 | 800,000 | 956,048 | 2029/3/20 |
| 第110回利付国債 (20年) | 2.1 | 976,000 | 1,187,362 | 2029/3/20 |
| 第111回利付国債 (20年) | 2.2 | 711,000 | 875,368 | 2029/6/20 |
| 第112回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,140,000 | 1,391,028 | 2029/6/20 |
| 第113回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,782,000 | 2,180,758 | 2029/9/20 |
| 第114回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,020,000 | 1,251,764 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債 (20年) | 2.2 | 954,000 | 1,181,691 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) | 2.2 | 546,000 | 678,252 | 2030/3/20 |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,860,000 | 2,288,823 | 2030/3/20 |
| 第118回利付国債 (20年) | 2.0 | 776,000 | 948,279 | 2030/6/20 |
| 第119回利付国債 (20年) | 1.8 | 660,000 | 790,812 | 2030/6/20 |
| 第120回利付国債 (20年) | 1.6 | 1,010,000 | 1,186,133 | 2030/6/20 |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,169,000 | 1,417,926 | 2030/9/20 |
| 第122回利付国債 (20年) | 1.8 | 760,000 | 912,608 | 2030/9/20 |
| 第123回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,448,000 | 1,797,170 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0 | 800,000 | 982,408 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2 | 934,000 | 1,173,104 | 2031/3/20 |
| 第126回利付国債 (20年) | 2.0 | 640,000 | 787,737 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9 | 840,000 | 1,023,338 | 2031/3/20 |
| 第128回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,274,000 | 1,555,401 | 2031/6/20 |
| 第129回利付国債 (20年) | 1.8 | 650,000 | 785,252 | 2031/6/20 |
| 第130回利付国債 (20年) | 1.8 | 1,012,000 | 1,224,934 | 2031/9/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|---|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 第131回利付国債 (20年) | | 1.7 | 880,000 | 1,053,694 | 2031/9/20 |
| 第132回利付国債 (20年) | | 1.7 | 1,207,000 | 1,446,698 | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年) | | 1.8 | 1,340,000 | 1,624,937 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年) | | 1.8 | 885,000 | 1,075,053 | 2032/3/20 |
| 第135回利付国債 (20年) | | 1.7 | 600,000 | 720,288 | 2032/3/20 |
| 第136回利付国債 (20年) | | 1.6 | 800,000 | 949,616 | 2032/3/20 |
| 第137回利付国債 (20年) | | 1.7 | 762,000 | 916,213 | 2032/6/20 |
| 第138回利付国債 (20年) | | 1.5 | 750,000 | 881,272 | 2032/6/20 |
| 第139回利付国債 (20年) | | 1.6 | 380,000 | 451,706 | 2032/6/20 |
| 第140回利付国債 (20年) | | 1.7 | 2,127,000 | 2,561,354 | 2032/9/20 |
| 第141回利付国債 (20年) | | 1.7 | 1,550,000 | 1,867,889 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) | | 1.8 | 1,090,000 | 1,329,843 | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債 (20年) | | 1.6 | 1,410,000 | 1,681,284 | 2033/3/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | | 1.5 | 1,100,000 | 1,295,899 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | | 1.7 | 2,560,000 | 3,093,299 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | | 1.7 | 2,180,000 | 2,635,598 | 2033/9/20 |
| 第147回利付国債 (20年) | | 1.6 | 2,690,000 | 3,213,527 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | | 1.5 | 2,190,000 | 2,583,630 | 2034/3/20 |
| 第149回利付国債 (20年) | | 1.5 | 2,570,000 | 3,034,270 | 2034/6/20 |
| 第150回利付国債 (20年) | | 1.4 | 2,440,000 | 2,845,015 | 2034/9/20 |
| 第151回利付国債 (20年) | | 1.2 | 2,590,000 | 2,937,681 | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | | 1.2 | 2,390,000 | 2,708,849 | 2035/3/20 |
| 第153回利付国債 (20年) | | 1.3 | 2,910,000 | 3,345,190 | 2035/6/20 |
| 第154回利付国債 (20年) | | 1.2 | 2,110,000 | 2,389,680 | 2035/9/20 |
| 第155回利付国債 (20年) | | 1.0 | 2,530,000 | 2,779,584 | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債 (20年) | | 0.4 | 2,180,000 | 2,169,143 | 2036/3/20 |
| 第157回利付国債 (20年) | | 0.2 | 2,390,000 | 2,290,002 | 2036/6/20 |
| 第158回利付国債 (20年) | | 0.5 | 2,420,000 | 2,440,497 | 2036/9/20 |
| 第159回利付国債 (20年) | | 0.6 | 1,950,000 | 1,996,761 | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債 (20年) | | 0.7 | 2,340,000 | 2,433,155 | 2037/3/20 |
| 第161回利付国債 (20年) | | 0.6 | 1,990,000 | 2,029,999 | 2037/6/20 |
| 第162回利付国債 (20年) | | 0.6 | 2,190,000 | 2,228,631 | 2037/9/20 |
| 第163回利付国債 (20年) | | 0.6 | 2,080,000 | 2,113,342 | 2037/12/20 |
| 第164回利付国債 (20年) | | 0.5 | 1,800,000 | 1,791,900 | 2038/3/20 |
| 第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013) | | 0.67 | 100,000 | 100,145 | 2018/11/15 |
| 小 | 計 | | 408,788,000 | 444,023,378 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 第1回東京都公募公債 (20年) | | 1.54 | 20,000 | 21,538 | 2023/6/20 |
| 第7回東京都公募公債 (30年) | | 2.51 | 10,000 | 13,389 | 2038/9/17 |
| 第8回東京都公募公債 (30年) | | 2.23 | 80,000 | 102,886 | 2038/9/17 |
| 第16回東京都公募公債 (20年) | | 2.01 | 100,000 | 118,606 | 2028/12/20 |
| 第20回東京都公募公債 (20年) | | 2.09 | 80,000 | 96,297 | 2029/9/20 |
| 第21回東京都公募公債 (20年) | | 2.19 | 80,000 | 97,443 | 2029/12/20 |
| 第22回東京都公募公債 (20年) | | 1.92 | 120,000 | 143,124 | 2030/6/20 |
| 第24回東京都公募公債 (20年) | | 1.98 | 70,000 | 84,667 | 2031/6/20 |

| 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28回東京都公募公債 (20年) | 1.59 | 100,000 | 116,677 | 2033/3/18 |
| 第669回東京都公募公債 | 1.63 | 50,000 | 50,881 | 2019/6/20 |
| 第678回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 102,162 | 2019/12/20 |
| 第680回東京都公募公債 | 1.39 | 100,000 | 102,510 | 2020/3/19 |
| 第681回東京都公募公債 | 1.4 | 100,000 | 102,528 | 2020/3/19 |
| 第686回東京都公募公債 | 1.08 | 100,000 | 102,203 | 2020/6/19 |
| 第693回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 103,839 | 2021/3/19 |
| 第705回東京都公募公債 | 1.06 | 170,000 | 176,686 | 2022/3/18 |
| 第709回東京都公募公債 | 0.78 | 100,000 | 103,051 | 2022/6/20 |
| 第726回東京都公募公債 | 0.73 | 100,000 | 103,799 | 2023/12/20 |
| 第752回東京都公募公債 | 0.126 | 100,000 | 100,233 | 2025/12/19 |
| 第754回東京都公募公債 | 0.06 | 120,000 | 119,578 | 2026/3/19 |
| 第755回東京都公募公債 | 0.06 | 300,000 | 298,947 | 2026/3/19 |
| 第758回東京都公募公債 | 0.03 | 300,000 | 297,855 | 2026/6/19 |
| 第765回東京都公募公債 | 0.21 | 300,000 | 301,701 | 2027/3/19 |
| 第768回東京都公募公債 | 0.185 | 200,000 | 200,626 | 2027/6/18 |
| 第769回東京都公募公債 | 0.21 | 200,000 | 201,076 | 2027/6/18 |
| 平成21年度第12回北海道公募公債 | 1.42 | 100,000 | 102,245 | 2019/12/25 |
| 平成21年度第14回北海道公募公債 | 1.52 | 100,000 | 102,664 | 2020/2/26 |
| 平成22年度第8回北海道公募公債 | 0.96 | 100,000 | 102,286 | 2020/10/29 |
| 平成25年度第4回北海道公募公債 | 0.85 | 100,000 | 104,085 | 2023/6/28 |
| 平成25年度第7回北海道公募公債 | 0.8 | 150,000 | 155,869 | 2023/8/30 |
| 平成25年度第9回北海道公募公債 | 0.7 | 300,000 | 310,374 | 2023/10/31 |
| 平成27年度第1回北海道公募公債 | 0.43 | 100,000 | 102,246 | 2025/4/30 |
| 平成27年度第9回北海道公募公債 | 0.486 | 200,000 | 205,338 | 2025/10/30 |
| 平成27年度第15回北海道公募公債 | 0.22 | 100,000 | 100,655 | 2026/2/26 |
| 第29回1号宮城県公募公債 | 0.68 | 100,000 | 103,396 | 2023/10/25 |
| 第2回神奈川県公募公債 (20年) | 2.23 | 80,000 | 90,902 | 2024/9/20 |
| 第2回神奈川県公募公債 (30年) | 2.87 | 80,000 | 111,036 | 2036/6/20 |
| 第3回神奈川県公募公債 (20年) | 2.11 | 100,000 | 114,255 | 2025/6/20 |
| 第27回神奈川県公募公債 (20年) | 1.398 | 100,000 | 114,008 | 2034/9/20 |
| 第162回神奈川県公募公債 | 1.62 | 140,450 | 142,909 | 2019/6/20 |
| 第163回神奈川県公募公債 | 1.4 | 114,000 | 115,720 | 2019/6/20 |
| 第165回神奈川県公募公債 | 1.4 | 54,660 | 55,672 | 2019/9/20 |
| 第171回神奈川県公募公債 | 1.41 | 100,000 | 102,550 | 2020/3/20 |
| 第191回神奈川県公募公債 | 0.83 | 100,000 | 103,256 | 2022/6/20 |
| 第226回神奈川県公募公債 | 0.195 | 300,000 | 300,783 | 2027/3/19 |
| 第228回神奈川県公募公債 | 0.205 | 200,000 | 200,626 | 2027/6/18 |
| 第5回大阪府公募公債 (20年) | 2.16 | 100,000 | 121,473 | 2030/5/28 |
| 第11回大阪府公募公債 (20年) | 1.693 | 200,000 | 235,548 | 2033/9/27 |
| 第331回大阪府公募公債 | 1.41 | 100,000 | 102,014 | 2019/10/29 |
| 第332回大阪府公募公債 | 1.58 | 71,600 | 73,307 | 2019/11/27 |
| 第343回大阪府公募公債 | 0.98 | 70,000 | 71,633 | 2020/10/28 |
| 第348回大阪府公募公債 | 1.32 | 10,000 | 10,370 | 2021/3/30 |
| 第351回大阪府公募公債 | 1.19 | 100,000 | 103,695 | 2021/7/28 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第358回大阪府公募公債 | 0.97 | 56,000 | 57,972 | 2022/2/28 |
| 第359回大阪府公募公債 | 0.99 | 56,000 | 58,056 | 2022/3/29 |
| 第376回大阪府公募公債 | 0.82 | 106,000 | 110,314 | 2023/9/27 |
| 第385回大阪府公募公債 | 0.65 | 200,000 | 206,880 | 2024/6/27 |
| 第388回大阪府公募公債 | 0.54 | 400,000 | 411,404 | 2024/9/27 |
| 第389回大阪府公募公債 | 0.53 | 100,000 | 102,794 | 2024/10/30 |
| 第393回大阪府公募公債 | 0.468 | 110,000 | 112,729 | 2025/2/26 |
| 第418回大阪府公募公債 | 0.22 | 100,000 | 100,349 | 2027/3/30 |
| 平成21年度第5回京都府公募公債 | 1.35 | 20,000 | 20,425 | 2019/12/24 |
| 平成23年度第9回京都府公募公債 | 1.01 | 140,000 | 145,230 | 2022/3/16 |
| 平成24年度第3回京都府公募公債 (20年) | 1.63 | 200,000 | 233,792 | 2032/8/13 |
| 平成24年度第10回京都府公募公債 | 0.67 | 100,000 | 103,053 | 2023/3/22 |
| 平成25年度第2回京都府公募公債 (15年) | 1.05 | 100,000 | 108,244 | 2028/4/28 |
| 第1回兵庫県公募公債 (18年) | 1.26 | 200,000 | 222,702 | 2032/8/6 |
| 第2回兵庫県公募公債 (30年) | 2.36 | 40,000 | 52,734 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債 (15年) | 1.31 | 100,000 | 110,263 | 2027/12/24 |
| 第5回兵庫県公募公債 (15年) | 1.31 | 100,000 | 110,753 | 2028/5/26 |
| 第8回兵庫県公募公債 (15年) | 1.09 | 100,000 | 108,638 | 2029/4/16 |
| 第15回兵庫県公募公債 (20年) | 1.64 | 300,000 | 349,713 | 2032/7/23 |
| 第16回兵庫県公募公債 (20年) | 1.7 | 100,000 | 117,518 | 2032/11/19 |
| 平成21年度第25回兵庫県公募公債 | 1.54 | 100,000 | 102,295 | 2019/11/20 |
| 平成27年度第6回兵庫県公募公債 | 0.56 | 200,000 | 206,336 | 2025/8/18 |
| 第3回静岡県公募公債 (15年) | 1.368 | 100,000 | 111,001 | 2027/10/29 |
| 平成21年度第4回静岡県公募公債 | 1.56 | 52,920 | 53,946 | 2019/8/20 |
| 平成22年度第1回静岡県公募公債 | 1.455 | 101,700 | 104,501 | 2020/4/20 |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債 | 1.178 | 100,000 | 102,512 | 2020/7/22 |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債 | 1.059 | 100,000 | 102,347 | 2020/8/25 |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債 | 0.581 | 100,000 | 102,671 | 2023/4/19 |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債 | 0.926 | 100,000 | 104,585 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第8回静岡県公募公債 | 0.699 | 130,000 | 134,546 | 2023/10/24 |
| 平成27年度第3回静岡県公募公債 | 0.544 | 121,000 | 124,788 | 2025/5/21 |
| 平成27年度第5回静岡県公募公債 | 0.578 | 100,000 | 103,407 | 2025/6/20 |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 103,442 | 2021/7/29 |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債 | 1.019 | 100,000 | 103,321 | 2021/9/30 |
| 平成23年度第14回愛知県公募公債 | 1.006 | 100,000 | 103,440 | 2021/11/30 |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債 | 0.996 | 100,000 | 103,567 | 2022/1/31 |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債 | 0.772 | 100,000 | 103,346 | 2022/11/30 |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年) | 1.314 | 300,000 | 332,055 | 2027/12/13 |
| 平成26年度第9回愛知県公募公債 | 0.576 | 100,000 | 103,102 | 2024/8/26 |
| 平成26年度第12回愛知県公募公債 | 0.515 | 100,000 | 102,758 | 2024/10/25 |
| 平成27年度第5回愛知県公募公債 | 0.544 | 100,000 | 103,138 | 2025/5/27 |
| 平成27年度第18回愛知県公募公債 | 0.22 | 100,000 | 100,730 | 2026/2/16 |
| 平成28年度第1回愛知県公募公債 | 0.08 | 100,000 | 99,609 | 2026/4/28 |
| 平成28年度第8回愛知県公募公債 | 0.065 | 108,000 | 107,293 | 2026/8/26 |
| 平成28年度第16回愛知県公募公債 | 0.259 | 100,000 | 100,810 | 2027/2/12 |

| 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 | 27,640 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | 1.19 | 100,000 | 103,504 | 2021/5/27 |
| 平成27年度第1回広島県公募公債 | 0.549 | 100,000 | 103,173 | 2025/5/27 |
| 平成27年度第4回広島県公募公債 | 0.476 | 100,000 | 102,696 | 2025/11/25 |
| 平成29年度第3回広島県公募公債 | 0.15 | 100,000 | 99,722 | 2027/9/27 |
| 第4回埼玉県公募公債(20年) | 2.18 | 200,000 | 237,138 | 2027/9/21 |
| 平成21年度第8回埼玉県公募公債 | 1.3 | 100,000 | 102,052 | 2019/12/25 |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債 | 1.37 | 100,000 | 103,946 | 2021/4/27 |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債 | 1.2 | 100,000 | 103,724 | 2021/7/27 |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債 | 0.801 | 100,000 | 103,405 | 2022/10/26 |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債 | 0.335 | 100,000 | 101,634 | 2025/1/28 |
| 平成27年度第6回埼玉県公募公債 | 0.505 | 200,000 | 205,782 | 2025/9/29 |
| 平成29年度第6回埼玉県公募公債 | 0.15 | 100,000 | 99,722 | 2027/9/27 |
| 平成29年度第8回埼玉県公募公債 | 0.245 | 200,000 | 201,046 | 2028/1/26 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債(30年) | 2.62 | 70,000 | 94,930 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債(30年) | 2.28 | 80,000 | 103,606 | 2038/9/17 |
| 平成21年度第11回福岡県公募公債 | 1.44 | 100,000 | 102,517 | 2020/2/25 |
| 平成22年度第3回福岡県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 102,460 | 2020/8/24 |
| 平成22年度第5回福岡県公募公債 | 0.94 | 20,000 | 20,446 | 2020/10/28 |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債(15年) | 1.491 | 100,000 | 111,308 | 2026/11/27 |
| 平成26年度第8回福岡県公募公債 | 0.441 | 100,000 | 102,342 | 2024/12/25 |
| 平成26年度第1回福岡県公募公債 | 0.654 | 100,000 | 103,526 | 2024/6/26 |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債 | 0.464 | 100,000 | 102,635 | 2025/12/25 |
| 第2回千葉県公募公債(20年) | 2.26 | 100,000 | 117,496 | 2026/9/18 |
| 第9回千葉県公募公債(20年) | 1.84 | 80,000 | 94,737 | 2030/10/11 |
| 平成22年度第11回千葉県公募公債 | 1.26 | 80,000 | 82,656 | 2021/1/25 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債 | 1.0 | 20,000 | 20,744 | 2022/3/25 |
| 平成24年度第1回千葉県公募公債 | 1.05 | 20,000 | 20,800 | 2022/4/25 |
| 平成24年度第6回千葉県公募公債 | 0.81 | 100,000 | 103,508 | 2022/11/25 |
| 平成25年度第1回千葉県公募公債 | 0.58 | 82,500 | 84,707 | 2023/4/25 |
| 平成25年度第8回千葉県公募公債 | 0.67 | 100,000 | 103,363 | 2023/11/24 |
| 平成28年度第5回千葉県公募公債 | 0.15 | 100,000 | 99,914 | 2026/12/25 |
| 平成28年度第8回千葉県公募公債 | 0.22 | 200,000 | 200,960 | 2027/3/25 |
| 平成29年度第1回千葉県公募公債 | 0.175 | 120,000 | 120,052 | 2027/5/25 |
| 平成29年度第3回千葉県公募公債 | 0.22 | 100,000 | 100,406 | 2027/7/23 |
| 平成21年度第1回新潟県公募公債 | 1.42 | 23,000 | 23,386 | 2019/7/29 |
| 平成28年度第2回新潟県公募公債 | 0.18 | 100,000 | 100,171 | 2027/1/29 |
| 第15回群馬県公募公債 | 0.08 | 200,000 | 198,734 | 2026/11/25 |
| 平成28年度第1回岐阜県公募公債 | 0.06 | 100,000 | 99,247 | 2026/10/30 |
| 平成24年度第1回大分県公募公債 | 0.8 | 100,260 | 103,679 | 2022/10/31 |
| 第75回共同発行市場公募地方債 | 1.64 | 100,000 | 101,795 | 2019/6/25 |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 1.54 | 10,000 | 10,192 | 2019/8/23 |
| 第78回共同発行市場公募地方債 | 1.39 | 130,000 | 132,415 | 2019/9/25 |
| 第79回共同発行市場公募地方債 | 1.34 | 200,000 | 203,794 | 2019/10/25 |
| 第81回共同発行市場公募地方債 | 1.32 | 109,500 | 111,781 | 2019/12/25 |

| 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90回共同発行市場公募地方債 | 1.12 | 30,000 | 30,773 | 2020/9/25 |
| 第95回共同発行市場公募地方債 | 1.28 | 100,000 | 103,480 | 2021/2/25 |
| 第100回共同発行市場公募地方債 | 1.21 | 100,000 | 103,743 | 2021/7/23 |
| 第101回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 100,000 | 103,325 | 2021/8/25 |
| 第103回共同発行市場公募地方債 | 1.0 | 100,000 | 103,323 | 2021/10/25 |
| 第107回共同発行市場公募地方債 | 1.01 | 200,000 | 207,370 | 2022/2/25 |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 170,000 | 176,800 | 2022/4/25 |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 100,000 | 103,440 | 2022/5/25 |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 103,143 | 2022/8/25 |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 103,416 | 2022/9/22 |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 0.72 | 100,000 | 103,152 | 2022/12/22 |
| 第120回共同発行市場公募地方債 | 0.68 | 100,000 | 103,105 | 2023/3/24 |
| 第126回共同発行市場公募地方債 | 0.81 | 210,000 | 218,542 | 2023/9/25 |
| 第127回共同発行市場公募地方債 | 0.68 | 100,000 | 103,396 | 2023/10/25 |
| 第129回共同発行市場公募地方債 | 0.71 | 200,000 | 207,276 | 2023/12/25 |
| 第130回共同発行市場公募地方債 | 0.76 | 100,000 | 103,977 | 2024/1/25 |
| 第132回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 200,000 | 206,950 | 2024/3/25 |
| 第135回共同発行市場公募地方債 | 0.659 | 200,000 | 207,110 | 2024/6/25 |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 0.505 | 200,000 | 205,458 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債 | 0.345 | 200,000 | 203,396 | 2025/1/24 |
| 第144回共同発行市場公募地方債 | 0.47 | 200,000 | 205,184 | 2025/3/25 |
| 第145回共同発行市場公募地方債 | 0.406 | 100,000 | 102,146 | 2025/4/25 |
| 第146回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 200,000 | 206,392 | 2025/5/23 |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 0.51 | 300,000 | 308,769 | 2025/9/25 |
| 第153回共同発行市場公募地方債 | 0.469 | 100,000 | 102,673 | 2025/12/25 |
| 第163回共同発行市場公募地方債 | 0.06 | 500,000 | 496,245 | 2026/10/23 |
| 第166回共同発行市場公募地方債 | 0.18 | 300,000 | 300,513 | 2027/1/25 |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 0.225 | 200,000 | 200,904 | 2027/7/23 |
| 第178回共同発行市場公募地方債 | 0.23 | 200,000 | 200,760 | 2028/1/25 |
| 平成24年度第2回堺市公募公債 | 0.715 | 200,000 | 206,246 | 2022/12/19 |
| 平成25年度第1回長崎県公募公債 | 0.81 | 200,000 | 208,144 | 2023/9/27 |
| 平成23年度第1回滋賀県公募公債 | 1.02 | 100,000 | 103,490 | 2021/11/30 |
| 平成25年度第1回栃木県公募公債 | 0.65 | 100,000 | 103,261 | 2023/11/29 |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債 | 0.8 | 50,000 | 51,700 | 2022/10/26 |
| 平成28年度第1回熊本市公募公債 | 0.08 | 100,000 | 99,366 | 2026/11/30 |
| 平成22年度第1回新潟市公募公債 | 1.21 | 54,980 | 56,674 | 2020/12/24 |
| 平成26年度第1回新潟市公募公債 | 0.456 | 100,000 | 102,441 | 2024/12/25 |
| 平成23年度第1回浜松市公募公債 | 1.045 | 38,200 | 39,561 | 2021/11/25 |
| 平成25年度第1回浜松市公募公債 | 0.761 | 161,000 | 167,409 | 2024/1/24 |
| 第1回大阪市公募公債(15年) | 1.753 | 200,000 | 226,274 | 2026/7/17 |
| 第5回大阪市公募公債(20年) | 2.47 | 100,000 | 122,843 | 2028/9/21 |
| 平成21年度第6回大阪市公募公債 | 1.57 | 125,000 | 127,951 | 2019/11/25 |
| 平成23年度第10回大阪市公募公債 | 0.956 | 10,000 | 10,340 | 2022/1/27 |
| 平成26年度第5回大阪市公募公債 | 0.593 | 100,000 | 103,252 | 2024/9/27 |
| 第1回名古屋市公募公債(12年) | 1.033 | 100,000 | 106,617 | 2025/6/20 |

| 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1回名古屋市政公債(20年) | | 1.99 | 200,000 | 221,556 | 2023/12/20 |
| 第9回名古屋市政公債(20年) | | 2.07 | 400,000 | 477,404 | 2028/12/20 |
| 第10回名古屋市政公債(20年) | | 2.26 | 80,000 | 97,606 | 2029/8/17 |
| 第477回名古屋市政公債 | | 1.034 | 100,000 | 103,595 | 2021/12/20 |
| 第1回京都市公債(20年) | | 2.14 | 200,000 | 227,064 | 2024/12/20 |
| 第5回京都市公債(20年) | | 2.36 | 50,000 | 59,355 | 2026/12/18 |
| 平成23年度第2回京都市公債 | | 1.049 | 100,000 | 103,325 | 2021/8/26 |
| 平成24年度第4回京都市公債 | | 0.801 | 100,000 | 103,395 | 2022/10/21 |
| 平成18年度第3回神戸市公債(20年) | | 2.54 | 120,000 | 143,248 | 2026/6/19 |
| 平成22年度第4回神戸市公債 | | 1.895 | 100,000 | 119,040 | 2030/9/13 |
| 平成22年度第9回神戸市公債(20年) | | 2.09 | 80,000 | 97,393 | 2031/1/24 |
| 平成29年度第6回神戸市公債 | | 0.23 | 300,000 | 301,107 | 2027/10/15 |
| 第7回横浜市公債(20年) | | 2.06 | 200,000 | 229,398 | 2025/12/19 |
| 第17回横浜市公債(20年) | | 2.07 | 80,000 | 95,283 | 2028/12/20 |
| 第20回横浜市公債(20年) | | 2.1 | 80,000 | 96,338 | 2029/10/19 |
| 平成24年度第4回横浜市公債 | | 0.81 | 100,000 | 103,668 | 2023/2/20 |
| 第25回横浜市公債(20年) | | 1.72 | 100,000 | 118,097 | 2032/7/16 |
| 平成27年度第2回横浜市公債 | | 0.568 | 200,000 | 206,662 | 2025/6/16 |
| 第27回横浜市公債(20年) | | 1.599 | 60,000 | 70,044 | 2033/5/20 |
| 平成21年度第5回札幌市公債 | | 1.36 | 112,000 | 114,014 | 2019/9/20 |
| 平成22年度第8回札幌市公債(30年) | | 2.277 | 80,000 | 104,593 | 2040/9/20 |
| 平成27年度第9回札幌市公債 | | 0.19 | 100,000 | 100,564 | 2025/12/19 |
| 第3回川崎市公債(15年) | | 1.82 | 100,000 | 104,660 | 2020/12/21 |
| 第44回川崎市公債(5年) | | 0.162 | 130,400 | 130,761 | 2020/6/19 |
| 第82回川崎市公債 | | 1.52 | 100,000 | 102,016 | 2019/9/20 |
| 第17回北九州市公債(20年) | | 1.529 | 100,000 | 115,941 | 2034/6/20 |
| 平成25年度第3回北九州市公債 | | 0.728 | 300,000 | 311,223 | 2023/12/26 |
| 平成22年度第9回福岡市公債 | | 1.32 | 106,500 | 110,428 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第6回福岡市公債 | | 1.0 | 100,000 | 103,331 | 2021/10/28 |
| 平成24年度第4回福岡市公債 | | 0.8 | 200,000 | 206,822 | 2022/10/31 |
| 平成25年度第4回福岡市公債 | | 0.68 | 50,000 | 51,697 | 2023/10/24 |
| 平成26年度第6回福岡市公債(20年) | | 1.371 | 100,000 | 113,512 | 2034/9/20 |
| 平成25年度第2回広島市公債 | | 0.72 | 100,000 | 103,698 | 2023/12/27 |
| 平成22年度第2回千葉市公債 | | 0.92 | 100,000 | 102,171 | 2020/10/22 |
| 平成22年度第1回三重県公債 | | 1.056 | 87,050 | 89,323 | 2020/11/30 |
| 平成23年度第1回三重県公債 | | 1.021 | 98,410 | 101,847 | 2021/11/30 |
| 平成24年度第4回福井県公債 | | 0.46 | 100,000 | 102,085 | 2023/4/26 |
| 平成27年度第4回福井県公債 | | 0.085 | 200,000 | 199,296 | 2026/4/27 |
| 平成26年度第1回徳島県公債 | | 0.495 | 100,000 | 102,667 | 2024/11/28 |
| 平成26年度第1回岡山市公債 | | 0.33 | 100,000 | 101,602 | 2025/1/30 |
| 平成28年度第1回岡山市公債 | | 0.18 | 100,000 | 100,171 | 2027/1/29 |
| 平成28年度第1回秋田県公債 | | 0.205 | 100,000 | 100,349 | 2027/3/25 |
| 第4回京都市保証京都市土地開発公社債券 | | 0.06 | 200,000 | 199,616 | 2023/3/29 |
| 第96回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 | | 2.34 | 100,000 | 120,899 | 2028/12/20 |

| 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132回福岡北九州高速道路債券 | | 0.704 | 100,000 | 102,764 | 2024/3/19 |
| 小 | 計 | | 28,747,780 | 30,287,806 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 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 | 241,196 | 2029/5/31 |
| 第85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 | 101,736 | 2019/7/31 |
| 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 | 179,000 | 182,286 | 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 | 120,990 | 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 | 121,088 | 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 | 141,773 | 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 | 214,798 | 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 | 132,141 | 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 | 51,228 | 2020/3/19 |
| 第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 300,000 | 308,418 | 2020/4/30 |
| 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 | 121,629 | 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 | 444,000 | 456,578 | 2020/6/30 |
| 第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.1 | 141,000 | 144,529 | 2020/7/31 |
| 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 | 102,453 | 2020/9/30 |
| 第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 300,000 | 306,876 | 2020/10/30 |
| 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 | 400,000 | 409,484 | 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 | 73,293 | 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 | 121,192 | 2031/1/31 |
| 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 400,000 | 415,736 | 2021/4/30 |
| 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 | 94,122 | 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 | 660,000 | 683,839 | 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 | 126,124 | 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 | 103,548 | 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 | 238,676 | 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 | 140,949 | 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 | 115,933 | 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 | 109,000 | 112,877 | 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 | 103,967 | 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 | 118,770 | 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 | 247,538 | 2042/5/30 |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.895 | 12,000 | 12,456 | 2022/6/30 |
| 第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.819 | 301,000 | 312,070 | 2022/9/30 |
| 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 | 103,755 | 2022/11/30 |
| 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 | 103,309 | 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 | 114,437 | 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 | 157,195 | 2023/4/28 |
| 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 | 104,601 | 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 | 223,000 | 233,746 | 2023/7/31 |
| 第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.801 | 100,000 | 104,336 | 2023/9/29 |
| 第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.66 | 200,000 | 207,472 | 2024/2/29 |
| 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 | 222,000 | 230,209 | 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 | 103,785 | 2024/6/28 |

| 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 | 103,541 | 2024/7/31 |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.39 | 100,000 | 114,712 | 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 | 103,251 | 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 | 100,000 | 102,847 | 2024/12/27 |
| 第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.32 | 100,000 | 101,876 | 2025/1/31 |
| 第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.45 | 100,000 | 102,813 | 2025/3/31 |
| 第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.391 | 200,000 | 204,802 | 2025/4/30 |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.484 | 200,000 | 206,240 | 2025/6/30 |
| 第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.557 | 200,000 | 207,288 | 2025/7/31 |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.32 | 130,000 | 132,594 | 2026/1/30 |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.145 | 100,000 | 100,620 | 2026/2/27 |
| 第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.115 | 200,000 | 200,258 | 2027/1/29 |
| 第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.155 | 100,000 | 100,367 | 2027/8/31 |
| 第344回政府保証道路債券 | 1.6 | 100,000 | 103,539 | 2020/7/15 |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年) | 0.576 | 300,000 | 306,063 | 2021/9/24 |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.4 | 25,000 | 25,415 | 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 | 203,848 | 2019/8/16 |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年) | 0.46 | 400,000 | 407,344 | 2022/2/25 |
| 第4回政府保証公営企業債券(15年) | 2.0 | 100,000 | 107,985 | 2022/4/22 |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年) | 2.2 | 300,000 | 327,792 | 2022/7/15 |
| 第8回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 100,000 | 102,245 | 2020/1/20 |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.4 | 149,000 | 152,742 | 2020/2/14 |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 100,000 | 102,435 | 2020/3/13 |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.1 | 100,000 | 102,460 | 2020/7/17 |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 100,000 | 102,408 | 2020/9/14 |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.15 | 200,000 | 201,066 | 2021/5/28 |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 30,000 | 31,128 | 2021/3/12 |
| 第25回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.2 | 100,000 | 103,780 | 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 | 21,738 | 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 | 52,019 | 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 | 103,769 | 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 | 103,496 | 2022/8/15 |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.668 | 17,000 | 17,562 | 2023/3/17 |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.605 | 36,000 | 37,114 | 2023/5/16 |
| 第55回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.693 | 160,000 | 166,113 | 2023/12/18 |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.601 | 100,000 | 103,518 | 2024/7/16 |
| 第80回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.32 | 100,000 | 101,989 | 2026/1/19 |
| 第89回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.005 | 203,000 | 201,554 | 2026/10/16 |
| 第94回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.145 | 104,000 | 104,362 | 2027/3/15 |
| 第95回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.14 | 114,000 | 114,300 | 2027/4/16 |
| 第97回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.13 | 200,000 | 200,358 | 2027/6/14 |
| 第99回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.155 | 400,000 | 401,460 | 2027/8/13 |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.09 | 100,000 | 99,768 | 2027/9/17 |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年) | 2.1 | 100,000 | 106,226 | 2021/4/16 |
| 第5回政府保証日本政策金融公庫債券 | 1.3 | 123,000 | 125,200 | 2019/9/17 |

| 銘柄 | 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25回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.815 | 100,000 | 103,973 | 2023/2/24 |
| 第27回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.372 | 200,000 | 201,018 | 2019/8/19 |
| 第37回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.425 | 100,000 | 102,743 | 2025/9/16 |
| 第211回政府保証預金保険機構債券 | | 0.1 | 100,000 | 100,428 | 2021/10/19 |
| 第7回政府保証日本政策投資銀行 | | 1.4 | 100,000 | 102,523 | 2020/2/17 |
| 第19回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.668 | 400,000 | 413,220 | 2023/3/15 |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.693 | 20,000 | 20,764 | 2023/12/18 |
| 第39回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.145 | 106,000 | 106,369 | 2027/3/15 |
| 第41回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.09 | 100,000 | 99,768 | 2027/9/15 |
| 第78回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | | 0.225 | 200,000 | 200,436 | 2027/4/13 |
| 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 | 23,558 | 2026/3/19 |
| 第9回道路債券(財投機関債) | | 2.9 | 100,000 | 133,443 | 2032/5/20 |
| 第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.52 | 100,000 | 118,832 | 2026/6/19 |
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.35 | 600,000 | 707,388 | 2026/9/18 |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.87 | 30,000 | 44,624 | 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 | 145,891 | 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 | 187,216 | 2047/3/20 |
| 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 | 119,766 | 2027/10/20 |
| 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 | 364,680 | 2028/6/20 |
| 第42回道路債券(財投機関債) | | 2.22 | 230,000 | 262,561 | 2025/3/21 |
| 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 | 150,000 | 184,090 | 2029/4/20 |
| 第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.14 | 50,000 | 60,542 | 2030/5/10 |
| 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 | 59,874 | 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 | 117,330 | 2032/6/18 |
| 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 | 124,709 | 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 | 101,811 | 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 | 60,710 | 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 | 81,325 | 2019/7/26 |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 1.03 | 20,000 | 20,929 | 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 | 109,364 | 2029/1/26 |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 2.03 | 100,000 | 110,785 | 2023/12/20 |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 2.33 | 50,000 | 56,998 | 2024/9/24 |
| 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 | 121,122 | 2030/12/27 |
| 第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.278 | 100,000 | 102,631 | 2020/6/26 |
| 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 | 98,155 | 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 | 102,667 | 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 | 94,960 | 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 | 119,037 | 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 | 51,638 | 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 | 103,398 | 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 | 234,084 | 2032/6/28 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.68 | 300,000 | 350,901 | 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 | 75,422 | 2023/3/17 |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.785 | 50,000 | 59,333 | 2033/1/28 |
| 第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.035 | 300,000 | 310,431 | 2021/11/26 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| F 77回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.519 | 200,000 | 222,440 | 2026/10/20 |
| 第77回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 0.491 | 100,000 | 102,590 | 2025/10/28 |
| F 89回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.602 | 300,000 | 338,433 | 2027/8/20 |
| F 123回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.6 | 100,000 | 114,606 | 2030/3/19 |
| F 124回地方公共団体金融機構債券 | 1.418 | 200,000 | 221,774 | 2027/6/4 |
| F 131回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.546 | 100,000 | 114,742 | 2031/7/30 |
| F 147回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.291 | 150,000 | 164,370 | 2027/3/19 |
| F 197回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.052 | 500,000 | 539,305 | 2027/10/29 |
| F 226回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | 1.096 | 100,000 | 108,545 | 2029/2/28 |
| 第10回日本政策金融公庫 (財投機関債) | 2.167 | 80,000 | 96,974 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫 (財投機関債) | 1.911 | 80,000 | 95,019 | 2030/10/29 |
| 第78回都市再生債券 (財投機関債) | 1.34 | 400,000 | 443,372 | 2028/3/17 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 16,988 | 17,857 | 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 | 17,039 | 18,020 | 2037/11/10 |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 18,268 | 19,331 | 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 | 17,388 | 18,506 | 2037/11/10 |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 17,922 | 18,988 | 2042/8/10 |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 14,955 | 15,523 | 2036/11/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.26 | 15,603 | 16,491 | 2037/5/10 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 17,790 | 18,768 | 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 | 18,031 | 19,035 | 2038/11/10 |
| 第6回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債) | 2.46 | 200,000 | 240,494 | 2027/6/18 |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.25 | 15,721 | 16,610 | 2037/5/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 11,612 | 11,808 | 2037/10/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.99 | 18,994 | 20,010 | 2042/12/10 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.52 | 11,238 | 11,406 | 2037/12/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 16,484 | 17,450 | 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 | 19,347 | 20,607 | 2039/5/10 |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.43 | 24,318 | 24,760 | 2038/2/10 |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 16,966 | 17,963 | 2037/5/10 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.16 | 20,173 | 21,380 | 2043/5/10 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 12,750 | 13,037 | 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 | 20,188 | 20,759 | 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 | 22,726 | 23,485 | 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 | 23,047 | 23,862 | 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 | 69,732 | 71,934 | 2032/11/10 |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.8 | 14,450 | 14,946 | 2039/6/10 |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.12 | 15,134 | 15,852 | 2039/7/10 |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.28 | 57,330 | 62,307 | 2044/6/10 |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 15,194 | 15,656 | 2040/5/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 33,914 | 35,167 | 2040/6/10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 18,326 | 19,037 | 2040/7/10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.88 | 35,235 | 37,657 | 2045/2/10 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 37,347 | 39,724 | 2045/4/10 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 38,138 | 40,448 | 2045/5/10 |

| 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37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.88 | 17,703 | 18,501 | 2040/12/10 |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.61 | 40,769 | 42,971 | 2045/7/10 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 17,064 | 17,800 | 2041/2/10 |
| 第39回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 2.15 | 300,000 | 361,308 | 2029/9/20 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.36 | 42,994 | 44,949 | 2045/9/10 |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 18,583 | 19,608 | 2041/4/10 |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.34 | 16,806 | 17,788 | 2041/5/10 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 49,219 | 52,145 | 2045/12/10 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.77 | 48,601 | 51,875 | 2046/1/10 |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.79 | 41,406 | 44,067 | 2046/2/10 |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.92 | 37,593 | 40,129 | 2046/4/10 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 116,718 | 124,638 | 2046/5/10 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 38,153 | 40,519 | 2046/6/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.67 | 38,742 | 41,008 | 2046/7/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 16,639 | 17,580 | 2042/2/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 41,958 | 44,444 | 2046/8/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.51 | 44,867 | 47,333 | 2046/9/10 |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.48 | 46,819 | 49,362 | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.42 | 51,286 | 54,035 | 2047/1/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 153,033 | 161,362 | 2047/2/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 52,254 | 55,120 | 2047/4/10 |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 54,651 | 57,396 | 2047/5/10 |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 56,287 | 58,840 | 2047/7/10 |
| 第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 2.13 | 50,000 | 60,796 | 2030/12/13 |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.11 | 55,639 | 57,881 | 2047/8/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.12 | 58,392 | 60,844 | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 53,915 | 56,473 | 2048/3/10 |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.32 | 59,837 | 63,047 | 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 | 97,055 | 2031/6/13 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 365,883 | 382,797 | 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 | 33,792 | 2026/6/19 |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 54,821 | 57,044 | 2048/11/10 |
| 第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 118,700 | 123,546 | 2049/1/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 58,765 | 61,176 | 2049/2/10 |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.04 | 61,511 | 63,956 | 2049/4/10 |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.01 | 124,142 | 128,902 | 2049/5/10 |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.02 | 126,774 | 131,727 | 2049/6/10 |
| 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 | 119,063 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.95 | 67,506 | 69,912 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.87 | 203,562 | 209,917 | 2049/11/10 |
| 第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 138,346 | 142,435 | 2049/12/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 70,001 | 71,667 | 2050/1/10 |
| 第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.6 | 146,784 | 149,029 | 2050/2/10 |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.81 | 246,279 | 253,261 | 2050/4/10 |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.9 | 246,705 | 255,065 | 2050/7/10 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.88 | 165,564 | 170,964 | 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 | 119,668 | 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 | 221,674 | 2027/3/19 |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.86 | 427,765 | 441,487 | 2050/12/10 |
| 第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.472 | 600,000 | 668,190 | 2027/6/18 |
| 第111回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.404 | 100,000 | 110,708 | 2027/6/18 |
| 第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.41 | 282,213 | 283,234 | 2051/12/10 |
| 第117回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.438 | 100,000 | 111,257 | 2027/9/17 |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.47 | 286,368 | 288,741 | 2052/3/10 |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.227 | 130,000 | 169,893 | 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 | 118,688 | 2032/9/17 |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 586,272 | 588,376 | 2052/10/10 |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 98,657 | 99,011 | 2053/1/10 |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.46 | 99,020 | 99,654 | 2053/2/10 |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 99,479 | 99,799 | 2053/3/10 |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 199,702 | 199,941 | 2053/4/10 |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 200,000 | 200,062 | 2053/5/10 |
| 第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.484 | 200,000 | 204,942 | 2025/12/19 |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.24 | 1,100,000 | 1,103,333 | 2027/3/19 |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債) | | 2.04 | 50,000 | 56,720 | 2025/6/20 |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.991 | 70,000 | 84,266 | 2031/6/13 |
| 第11回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.14 | 30,000 | 31,181 | 2021/12/20 |
| 第39回東日本高速道路 | | 0.03 | 300,000 | 299,622 | 2021/12/20 |
| 第33回中日本高速道路 | | 1.084 | 50,000 | 51,691 | 2021/9/17 |
| 第27回西日本高速道路 | | 0.58 | 200,000 | 205,766 | 2025/9/2 |
| 第29回西日本高速道路 | | 0.31 | 400,000 | 403,508 | 2026/2/12 |
| 第30回西日本高速道路 | | 0.17 | 300,000 | 299,184 | 2026/5/22 |
| 小 | 計 | | 32,520,095 | 34,739,428 | |
| 金融債券 | | | | | |
| い第773号商工債券 | | 0.2 | 100,000 | 100,151 | 2019/10/25 |
| い第775号商工債券 | | 0.2 | 600,000 | 600,966 | 2019/12/27 |
| い第776号商工債券 | | 0.17 | 100,000 | 100,119 | 2020/1/27 |
| い第781号商工債券 | | 0.24 | 100,000 | 100,254 | 2020/6/26 |
| い第769号農林債券 | | 0.3 | 100,000 | 100,291 | 2019/6/27 |
| い第774号農林債券 | | 0.24 | 100,000 | 100,307 | 2019/11/27 |
| 第304回信中金債 | | 0.225 | 200,000 | 200,690 | 2020/3/27 |
| 第310回信中金債 | | 0.225 | 200,000 | 200,756 | 2020/9/25 |
| 第311回信中金債 | | 0.225 | 200,000 | 200,784 | 2020/10/27 |
| 第315回信中金債 | | 0.075 | 200,000 | 200,054 | 2021/2/26 |
| 第322回信中金債 | | 0.03 | 400,000 | 399,116 | 2021/9/27 |
| 第325回信中金債 | | 0.04 | 100,000 | 99,801 | 2021/12/27 |
| 第327回信中金債 | | 0.06 | 200,000 | 199,732 | 2022/2/25 |
| 第332回信中金債 | | 0.09 | 300,000 | 299,685 | 2022/7/27 |
| 第336回信中金債 | | 0.1 | 200,000 | 199,864 | 2022/11/25 |
| 第338回信中金債 | | 0.11 | 200,000 | 199,952 | 2023/1/27 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 金融債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第11号商工債券 (10年) | 0.66 | 100,000 | 102,436 | 2024/9/20 |
| 小 計 | | 3,400,000 | 3,404,958 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第534回東京電力 | 2.055 | 100,000 | 102,738 | 2019/10/29 |
| 第559回東京電力 | 1.377 | 60,000 | 61,050 | 2019/10/29 |
| 第563回東京電力 | 1.39 | 100,000 | 102,354 | 2020/5/28 |
| 第567回東京電力 | 1.958 | 100,000 | 112,502 | 2030/7/29 |
| 第568回東京電力 | 1.155 | 100,000 | 102,088 | 2020/9/8 |
| 第490回中部電力 | 1.444 | 70,000 | 71,184 | 2019/7/25 |
| 第499回中部電力 | 1.194 | 50,000 | 52,553 | 2023/6/23 |
| 第500回中部電力 | 0.875 | 100,000 | 103,711 | 2024/5/24 |
| 第518回中部電力 | 0.19 | 200,000 | 199,998 | 2023/1/25 |
| 第496回関西電力 | 0.908 | 100,000 | 103,836 | 2025/2/25 |
| 第499回関西電力 | 0.68 | 200,000 | 204,792 | 2026/1/23 |
| 第508回関西電力 | 0.455 | 200,000 | 200,600 | 2027/4/23 |
| 第510回関西電力 | 0.49 | 100,000 | 100,618 | 2027/7/23 |
| 第512回関西電力 | 0.32 | 200,000 | 199,936 | 2024/10/25 |
| 第381回中国電力 | 0.953 | 100,000 | 104,089 | 2024/4/25 |
| 第382回中国電力 | 0.517 | 100,000 | 101,277 | 2021/5/25 |
| 第385回中国電力 | 0.728 | 100,000 | 103,051 | 2025/7/25 |
| 第402回中国電力 | 0.25 | 200,000 | 199,682 | 2024/10/25 |
| 第304回北陸電力 | 0.989 | 100,000 | 104,141 | 2023/10/25 |
| 第307回北陸電力 | 1.055 | 100,000 | 105,738 | 2026/6/25 |
| 第310回北陸電力 | 0.748 | 200,000 | 206,314 | 2025/6/25 |
| 第322回北陸電力 | 0.38 | 200,000 | 200,086 | 2027/6/25 |
| 第481回東北電力 | 0.803 | 200,000 | 206,868 | 2025/7/25 |
| 第490回東北電力 | 0.22 | 100,000 | 99,999 | 2023/2/24 |
| 第494回東北電力 | 0.425 | 100,000 | 100,307 | 2027/6/25 |
| 第245回四国電力 | 2.0 | 100,000 | 105,881 | 2021/6/25 |
| 第253回四国電力 | 1.0 | 100,000 | 104,071 | 2023/6/23 |
| 第371回九州電力 | 1.43 | 100,000 | 105,616 | 2022/12/22 |
| 第429回九州電力 | 0.909 | 200,000 | 207,480 | 2024/9/25 |
| 第430回九州電力 | 0.54 | 100,000 | 101,406 | 2021/10/25 |
| 第437回九州電力 | 0.685 | 100,000 | 102,548 | 2026/1/23 |
| 第310回北海道電力 | 1.286 | 50,000 | 51,507 | 2020/12/25 |
| 第316回北海道電力 | 1.164 | 400,000 | 408,984 | 2020/6/25 |
| 第319回北海道電力 | 0.514 | 200,000 | 201,266 | 2019/9/25 |
| 第19回沖縄電力 | 1.452 | 80,000 | 82,180 | 2020/4/24 |
| 第347回東京交通債券 | 2.05 | 100,000 | 111,053 | 2024/3/8 |
| 第38回関西国際空港 | 1.112 | 50,000 | 51,872 | 2021/12/20 |
| 第18回成田国際空港 | 0.556 | 100,000 | 102,769 | 2025/10/30 |
| 第7回大和ハウス工業 | 0.06 | 200,000 | 199,500 | 2021/6/18 |
| 第7回明治ホールディングス | 0.22 | 100,000 | 99,897 | 2024/9/13 |
| 第10回アサヒグループホールディングス | 0.17 | 100,000 | 100,098 | 2022/6/13 |
| 第11回アサヒグループホールディングス | 0.23 | 100,000 | 100,112 | 2024/6/13 |

| 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24回味の素 | 0.19 | 100,000 | 100,028 | 2024/3/8 |
| 第6回J. フロント リテイリング | 0.435 | 200,000 | 200,768 | 2027/8/4 |
| 第4回トヨタ紡織 | 0.21 | 300,000 | 299,577 | 2024/12/20 |
| 第22回森ビル | 0.18 | 200,000 | 200,038 | 2023/3/8 |
| 第11回セブン&アイ・ホールディングス | 0.514 | 300,000 | 303,387 | 2022/6/20 |
| 第31回東レ | 0.25 | 100,000 | 100,060 | 2024/7/19 |
| 第21回三菱ケミカルホールディングス | 0.12 | 100,000 | 99,966 | 2021/6/9 |
| 第4回野村総合研究所 | 0.34 | 100,000 | 99,840 | 2028/3/23 |
| 第3回富士フイルムホールディングス | 0.882 | 100,000 | 103,259 | 2022/12/2 |
| 第4回富士フイルムホールディングス | 0.005 | 500,000 | 499,125 | 2020/3/3 |
| 第9回資生堂 | 0.001 | 100,000 | 99,823 | 2019/12/17 |
| 第23回ジェイ エフ イー ホールディングス | 0.09 | 300,000 | 299,208 | 2022/5/23 |
| 第1回リクルートホールディングス | 0.09 | 300,000 | 299,703 | 2022/3/9 |
| 第19回豊田自動織機 | 1.109 | 100,000 | 103,259 | 2021/9/17 |
| 第5回日本電産 | 0.001 | 300,000 | 299,580 | 2019/11/25 |
| 第15回パナソニック | 0.19 | 300,000 | 300,540 | 2021/9/17 |
| 第12回デンソー | 0.01 | 100,000 | 99,664 | 2021/9/17 |
| 第18回デンソー | 0.315 | 200,000 | 199,806 | 2028/3/17 |
| 第29回三菱重工業 | 0.662 | 300,000 | 307,290 | 2024/9/3 |
| 第1回日本生命2012基金 | 0.87 | 100,000 | 100,172 | 2018/8/3 |
| 第1回明治安田生命2014基金 | 0.51 | 100,000 | 100,360 | 2019/8/7 |
| 第7回J A三井リース | 0.2 | 200,000 | 199,648 | 2022/9/15 |
| 第9回J A三井リース | 0.22 | 100,000 | 100,089 | 2023/1/26 |
| 第1回日本生命2015基金 | 0.406 | 100,000 | 100,256 | 2019/8/5 |
| 第1回日本生命2017基金 | 0.304 | 100,000 | 100,105 | 2021/8/2 |
| 第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 0.25 | 200,000 | 200,258 | 2022/10/31 |
| 第13回アイシン精機 | 0.827 | 100,000 | 103,562 | 2023/9/20 |
| 第20回ニコン | 0.652 | 100,000 | 101,696 | 2022/3/14 |
| 第78回三菱商事 | 1.155 | 100,000 | 103,695 | 2022/3/9 |
| 第67回クレディセゾン | 0.06 | 200,000 | 199,934 | 2021/4/30 |
| 第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付) | 1.62 | 100,000 | 104,804 | 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 | 114,344 | 2026/10/30 |
| 第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | 1.56 | 100,000 | 103,732 | 2021/1/20 |
| 第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | 2.46 | 100,000 | 121,636 | 2031/1/20 |
| 第57回三菱東京UFJ銀行 | 2.22 | 200,000 | 218,660 | 2022/10/27 |
| 第6回住友信託銀行 (劣後特約付) | 2.78 | 100,000 | 118,194 | 2026/4/27 |
| 第8回三井住友信託銀行 (社債間限定同順位特約付) | 0.234 | 500,000 | 501,140 | 2019/7/22 |
| 第13回住友信託銀行 (劣後特約付) | 2.341 | 100,000 | 114,966 | 2026/6/15 |
| 第22回三井住友銀行 (劣後特約付) | 1.43 | 100,000 | 102,989 | 2020/9/28 |
| 第23回三井住友銀行 (劣後特約付) | 1.61 | 100,000 | 103,729 | 2020/12/17 |
| 第25回三井住友銀行 (劣後特約付) | 2.21 | 200,000 | 227,756 | 2026/6/1 |
| 第5回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.49 | 100,000 | 115,541 | 2026/1/30 |
| 第9回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.52 | 100,000 | 117,799 | 2027/4/27 |
| 第18回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.14 | 100,000 | 113,689 | 2026/9/11 |
| 第11回芙蓉総合リース | 0.21 | 100,000 | 99,820 | 2021/5/7 |

| 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13回芙蓉総合リース | 0.2 | 200,000 | 200,104 | 2022/2/3 |
| 第20回東京センチュリーリース | 0.19 | 100,000 | 99,777 | 2022/10/18 |
| 第22回東京センチュリーリース | 0.06 | 100,000 | 99,968 | 2021/4/13 |
| 第23回東京センチュリーリース | 0.2 | 100,000 | 99,971 | 2023/4/13 |
| 第29回ホンダファイナンス | 0.428 | 200,000 | 201,398 | 2021/3/19 |
| 第38回ホンダファイナンス | 0.01 | 300,000 | 298,800 | 2021/3/19 |
| 第77回トヨタファイナンス | 0.145 | 200,000 | 199,814 | 2024/7/25 |
| 第23回リコーリース | 0.05 | 200,000 | 199,290 | 2021/9/24 |
| 第30回リコーリース | 0.16 | 200,000 | 200,140 | 2022/1/21 |
| 第47回日立キャピタル | 0.874 | 100,000 | 102,837 | 2023/3/20 |
| 第52回日立キャピタル | 0.508 | 200,000 | 201,394 | 2021/6/18 |
| 第62回日立キャピタル | 0.001 | 300,000 | 299,508 | 2019/9/20 |
| 第188回オリックス | 0.15 | 100,000 | 99,827 | 2022/2/25 |
| 第36回三菱UFJリース | 0.355 | 100,000 | 100,638 | 2022/1/21 |
| 第39回三菱UFJリース | 0.12 | 100,000 | 99,844 | 2021/6/9 |
| 第41回三菱UFJリース | 0.06 | 200,000 | 199,296 | 2021/7/23 |
| 第48回三菱UFJリース | 0.15 | 100,000 | 99,868 | 2022/1/26 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 112,681 | 2025/9/24 |
| 第50回野村ホールディングス | 0.22 | 200,000 | 200,244 | 2022/8/10 |
| 第58回三井不動産 | 0.1 | 300,000 | 299,916 | 2023/2/24 |
| 第105回三菱地所 | 1.178 | 100,000 | 103,819 | 2022/3/23 |
| 第116回三菱地所 | 0.643 | 100,000 | 102,479 | 2024/9/19 |
| 第120回三菱地所 | 0.24 | 100,000 | 99,541 | 2027/6/18 |
| 第125回三菱地所 | 0.19 | 300,000 | 299,256 | 2025/3/14 |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 1.12 | 100,000 | 103,140 | 2021/9/17 |
| 第17回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 0.61 | 100,000 | 101,828 | 2024/9/20 |
| 第36回京王電鉄 | 0.325 | 100,000 | 100,029 | 2027/9/17 |
| 第38回京王電鉄 | 0.295 | 100,000 | 99,937 | 2027/11/29 |
| 第19回東日本旅客鉄道 | 2.36 | 100,000 | 108,626 | 2022/2/25 |
| 第26回東日本旅客鉄道 | 1.19 | 100,000 | 105,018 | 2022/12/20 |
| 第39回東日本旅客鉄道 | 2.05 | 500,000 | 566,560 | 2025/6/20 |
| 第83回東日本旅客鉄道 | 1.633 | 100,000 | 112,081 | 2026/12/22 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 1.981 | 100,000 | 125,040 | 2044/1/29 |
| 第9回西日本旅客鉄道 | 2.28 | 123,000 | 133,445 | 2022/3/25 |
| 第9回東海旅客鉄道 | 1.74 | 100,000 | 107,179 | 2022/9/20 |
| 第11回東海旅客鉄道 | 1.15 | 100,000 | 104,835 | 2022/12/20 |
| 第53回東海旅客鉄道 | 1.797 | 100,000 | 117,256 | 2030/10/25 |
| 第56回東海旅客鉄道 | 2.083 | 100,000 | 121,453 | 2031/5/26 |
| 第74回東海旅客鉄道 | 1.685 | 100,000 | 118,101 | 2045/3/6 |
| 第8回東京地下鉄 | 2.31 | 200,000 | 239,092 | 2027/12/20 |
| 第11回東京地下鉄 | 1.16 | 100,000 | 103,940 | 2021/12/9 |
| 第16回三菱倉庫 | 0.21 | 200,000 | 199,720 | 2024/12/6 |
| 第5回関西高速鉄道 | 1.238 | 100,000 | 102,542 | 2020/9/10 |
| 第8回関西高速鉄道 | 0.861 | 200,000 | 206,808 | 2023/8/30 |
| 第63回日本電信電話 | 0.69 | 100,000 | 102,451 | 2023/3/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第21回KDDI | 0.669 | 100,000 | 102,005 | 2024/9/20 |
| 第20回エス・ティ・ティ・ドコモ | 0.73 | 100,000 | 102,829 | 2023/9/20 |
| 第38回電源開発 | 0.978 | 100,000 | 104,016 | 2023/12/20 |
| 第39回電源開発 | 0.929 | 100,000 | 103,768 | 2024/2/20 |
| 第40回電源開発 | 0.889 | 200,000 | 207,352 | 2024/6/20 |
| 第4回東京電力パワーグリッド | 0.69 | 100,000 | 101,057 | 2024/6/20 |
| 第6回東京電力パワーグリッド | 0.85 | 100,000 | 101,426 | 2027/8/31 |
| 第7回東京電力パワーグリッド | 0.46 | 100,000 | 100,390 | 2022/10/24 |
| 第13回東京電力パワーグリッド | 0.77 | 200,000 | 200,428 | 2028/4/19 |
| 第23回東京ガス | 1.01 | 200,000 | 209,124 | 2023/6/9 |
| 第3回ファーストリテイリング | 0.491 | 100,000 | 101,182 | 2022/12/16 |
| 第4回ファーストリテイリング | 0.749 | 100,000 | 103,054 | 2025/12/18 |
| 第14回フランス相互信用連合銀行 | 0.563 | 200,000 | 202,682 | 2021/10/15 |
| 第19回フランス相互信用連合銀行 | 0.999 | 200,000 | 209,204 | 2025/10/15 |
| 第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 0.793 | 100,000 | 100,430 | 2018/12/13 |
| 第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 0.55 | 100,000 | 100,537 | 2019/7/10 |
| 第15回GEキャピタルコーポレーション | 2.215 | 100,000 | 104,982 | 2020/11/20 |
| 第9回ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.457 | 100,000 | 100,224 | 2019/1/17 |
| 第11回ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.284 | 100,000 | 100,211 | 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 | 300,762 | 2019/5/2 |
| 第9回ラボバンク・ネダーランド | 1.81 | 100,000 | 104,310 | 2021/1/28 |
| 第23回ラボバンク・ネダーランド | 0.557 | 100,000 | 100,271 | 2018/12/19 |
| 第27回ラボバンク・ネダーランド | 0.38 | 100,000 | 100,456 | 2020/5/22 |
| 小 計 | | 22,683,000 | 23,349,438 | |
| 合 計 | | 496,138,875 | 535,805,011 | |

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 | 百万円 |
| | | 1,809 | — |

○投資信託財産の構成

(2018年5月14日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 | % |
| | 535,805,011 | 97.8 |
| コール・ローン等、その他 | 12,055,504 | 2.2 |
| 投資信託財産総額 | 547,860,515 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 547,859,511,078 |
| コール・ローン等 | 5,042,435,444 |
| 公社債(評価額) | 535,805,011,235 |
| 未収入金 | 5,769,189,640 |
| 未収利息 | 1,116,487,095 |
| 前払費用 | 122,047,664 |
| 差入委託証拠金 | 4,340,000 |
| (B) 負債 | 3,585,675,107 |
| 未払解約金 | 3,585,668,566 |
| 未払利息 | 6,541 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 544,273,835,971 |
| 元本 | 409,751,145,196 |
| 次期繰越損益金 | 134,522,690,775 |
| (D) 受益権総口数 | 409,751,145,196口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,283円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 346,837,954,485円
 期中追加設定元本額 281,379,480,290円
 期中一部解約元本額 218,466,289,579円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3283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)

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| ファンド・マネジャー(国内債券) | 92,344,972,614円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | 10,228,758,948円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,277,999,627円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 319,063,837円 |
| コアバランス | 2,614,245円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 98,910,299円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 53,477,598円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 29,455,843円 |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス | 1,115,900,070円 |
| 国内債券セレクション(ラップ向け) | 2,360,720,038円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 990,687,117円 |
| つみたて8資産均等バランス | 104,175,310円 |
| つみたて4資産均等バランス | 22,724,603円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 2,235,739円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 506,925円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 47,243円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 3,961,943円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 2,758,495円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 1,951,529円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型) | 9,641,759,053円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型) | 5,327,947,204円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型) | 1,589,582,590円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN) | 951,376,615円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型) | 8,598,910,038円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 309,198,880円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 341,308,020円 |

○損益の状況 (2017年5月13日~2018年5月14日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 4,312,236,077 |
| 受取利息 | 4,315,372,251 |
| 支払利息 | △ 3,136,174 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 710,478,843 |
| 売買益 | 2,004,455,090 |
| 売買損 | △ 2,714,933,933 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 11,487,520 |
| 取引益 | 20,756,360 |
| 取引損 | △ 9,268,840 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,613,244,754 |
| (E) 前期繰越損益金 | 110,279,766,379 |
| (F) 追加信託差損益金 | 90,981,888,848 |
| (G) 解約差損益金 | △ 70,352,209,206 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 134,522,690,775 |
| 次期繰越損益金(H) | 134,522,690,775 |

(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。

| | |
|--|------------------|
| eMAXIS 債券バランス (2資産均等型) | 67,724,560円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 163,735,048円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 242,487,266円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 171,968,867円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 345,986,862円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 40,212,937円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 9,660,235円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 117,368,629円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 13,439,522,607円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 1,549,611,819円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 5,794,747,777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) | 183,095,542,105円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 762,835,368円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型 (適格機関投資家限定) | 69,300,121円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 31,260,927円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定) | 332,506,421円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 117,071,148円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 5,292,932,149円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 3,757,737,914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) | 13,238,391,136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) | 3,484,249,970円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 1,249,247,920円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 122,247,459円 |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定) | 23,987,554,035円 |
| MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付) | 259,317,356円 |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定) | 1,942,177,943円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 25,125,134円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 41,242,427円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 31,421,175円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 22,394,761円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 176,818,011円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 344,182,091円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 127,434,054円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 288,750,447円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 3,463,521,944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) | 1,892,868,301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) | 3,685,325,273円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型) | 2,021,052,400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) | 1,224,606,176円 |
| 合計 | 409,751,145,196円 |

【お知らせ】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)