

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 (2002年2月5日設定)
運用方針	わが国の公社債に投資し、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。公社債の実質投資比率は原則として高位を維持します。
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。
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国内債券 インデックスファンド

第14期 (決算日: 2015年3月31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国内債券インデックスファンド」は、去る3月31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。



東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
URL:<http://www.am.mufg.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 TEL. 0120-151034
お客様専用フリーダイヤル (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国内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	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	8
◇利害関係人との取引状況等	8
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	21
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	22
◇損益の状況	22
◇お知らせ	23

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 総額	
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				中 落
	円		円		騰	率		円	
10期(2011年3月31日)	11,344		0		1.6	328.52	1.8	99.6	53,443
11期(2012年4月2日)	11,640		0		2.6	337.69	2.8	99.6	62,738
12期(2013年4月1日)	12,051		0		3.5	350.38	3.8	99.6	69,880
13期(2014年3月31日)	12,114		0		0.5	352.80	0.7	99.7	75,169
14期(2015年3月31日)	12,451		0		2.8	363.28	3.0	99.7	81,822

(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総合インデックスは野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I S 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年3月31日	円 12,114	% —	352.80	% —	% 99.7	% —
4月末	12,130	0.1	353.31	0.1	99.4	—
5月末	12,164	0.4	354.39	0.4	99.6	—
6月末	12,198	0.7	355.41	0.7	99.8	—
7月末	12,216	0.8	356.01	0.9	99.3	0.2
8月末	12,253	1.1	357.15	1.2	99.3	0.2
9月末	12,260	1.2	357.41	1.3	99.6	—
10月末	12,316	1.7	359.08	1.8	99.4	0.2
11月末	12,387	2.3	361.19	2.4	99.3	0.2
12月末	12,514	3.3	364.96	3.4	99.4	0.2
2015年1月末	12,516	3.3	365.07	3.5	99.4	0.2
2月末	12,447	2.7	363.04	2.9	99.4	0.2
(期 末) 2015年3月31日	12,451	2.8	363.28	3.0	99.7	—

(注) 騰落率は期首比。

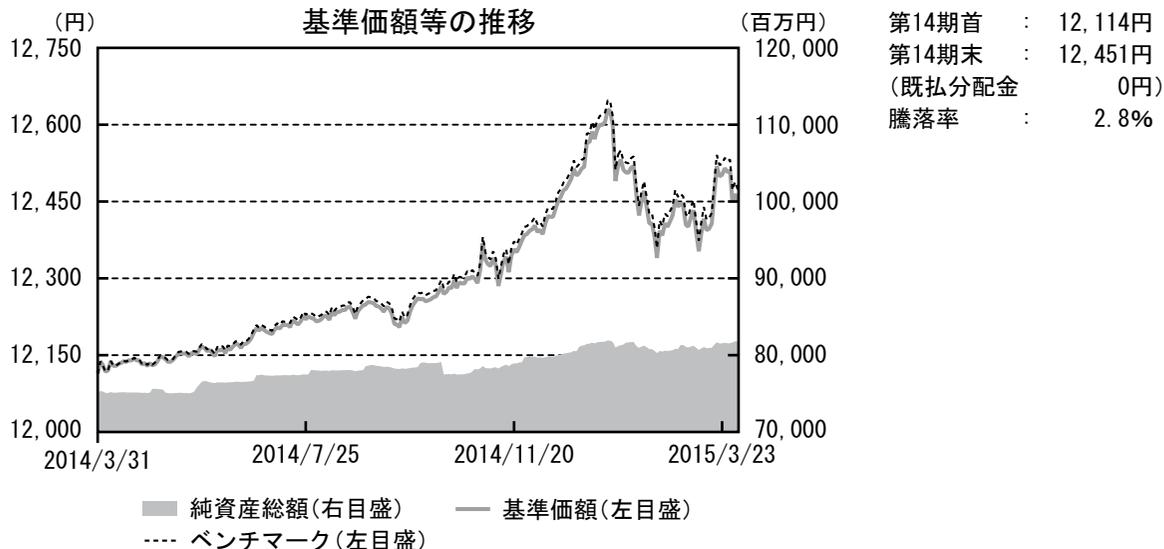
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第14期：2014/4/1～2015/3/31)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ2.8%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(3.0%)を0.2%下回りました。



基準価額の変動要因

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)したことが上昇要因となりました。
------	--

投資環境について

(第14期：2014/4/1～2015/3/31)

◎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

- ・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。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。
- ・ベンチマーク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3月31日）

最終利回り	0.6%
直接利回り	1.3%
デュレーション	7.7年

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

期末（2015年3月31日）

最終利回り	0.4%
直接利回り	1.2%
デュレーション	8.1年

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

	管理コスト等 による要因	ポートフォリオによる要因		その他の 要因	合計
		組入比率 要因	銘柄選択 要因		
ベンチマーク との乖離	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 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。

◎管理コスト等による要因

ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

◎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、ベンチマークとの運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運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。

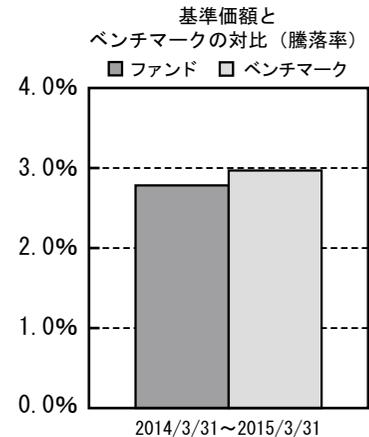
◎銘柄選択要因

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、 $\Delta 0.0\%$ 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4月1日～2015年3月31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	2,712

(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

- ・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4月1日～2015年3月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 21	% 0.173	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(7)	(0.054)	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 ）	(9)	(0.076)	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 ）	(5)	(0.043)	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	21	0.176	
期中の平均基準価額は、12,292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) 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4月1日～2015年3月31日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 18,707,384	千円 13,492,891
	地方債証券	801,285	454,556
	特殊債券	1,160,478	1,109,040 (103,703)
	社債券	1,161,666	1,321,716

(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 732	百万円 733	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2014年4月1日～2015年3月31日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 5,875	26.9	%	百万円 3,839		23.4

(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 100	百万円 100	百万円 517

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 100

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MUFJG証券です。

○組入資産の明細

(2015年3月31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	60,767,000	65,191,906	79.7	—	47.5	22.4	9.8
地方債証券	4,836,240	5,129,455	6.3	—	3.7	1.8	0.7
	(4,836,240)	(5,129,455)	(6.3)	(—)	(3.7)	(1.8)	(0.7)
特殊債券 (除く金融債)	5,483,534	5,843,578	7.1	—	5.3	1.6	0.3
	(5,483,534)	(5,843,578)	(7.1)	(—)	(5.3)	(1.6)	(0.3)
金融債券	750,000	757,258	0.9	—	—	0.9	0.1
	(750,000)	(757,258)	(0.9)	(—)	(—)	(0.9)	(0.1)
普通社債券	4,467,000	4,650,807	5.7	—	2.1	2.4	1.2
	(4,467,000)	(4,650,807)	(5.7)	(—)	(2.1)	(2.4)	(1.2)
合 計	76,303,774	81,573,005	99.7	—	58.5	29.0	12.2
	(15,536,774)	(16,381,099)	(20.0)	(—)	(11.1)	(6.6)	(2.4)

(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	償還年月日
	利率	額面金額	評価額		
国債証券	%	千円	千円		
第340回利付国債(2年)	0.1	260,000	260,202		2016/5/15
第341回利付国債(2年)	0.1	50,000	50,042		2016/6/15
第342回利付国債(2年)	0.1	270,000	270,240		2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	210,000	210,199		2016/8/15
第344回利付国債(2年)	0.1	410,000	410,414		2016/9/15
第345回利付国債(2年)	0.1	280,000	280,299		2016/10/15
第346回利付国債(2年)	0.1	160,000	160,180		2016/11/15
第347回利付国債(2年)	0.1	110,000	110,130		2016/12/15
第348回利付国債(2年)	0.1	150,000	150,187		2017/1/15
第97回利付国債(5年)	0.4	270,000	271,212		2016/6/20
第98回利付国債(5年)	0.3	500,000	501,640		2016/6/20
第100回利付国債(5年)	0.3	450,000	451,782		2016/9/20
第101回利付国債(5年)	0.4	50,000	50,317		2016/12/20
第102回利付国債(5年)	0.3	600,000	602,778		2016/12/20
第103回利付国債(5年)	0.3	60,000	60,306		2017/3/20
第104回利付国債(5年)	0.2	320,000	321,004		2017/3/20
第105回利付国債(5年)	0.2	710,000	712,435		2017/6/20
第106回利付国債(5年)	0.2	1,135,000	1,139,335		2017/9/20
第107回利付国債(5年)	0.2	590,000	592,401		2017/12/20
第108回利付国債(5年)	0.1	420,000	420,567		2017/12/20
第109回利付国債(5年)	0.1	620,000	620,824		2018/3/20
第110回利付国債(5年)	0.3	150,000	151,087		2018/3/20
第111回利付国債(5年)	0.4	250,000	252,552		2018/3/20
第112回利付国債(5年)	0.4	230,000	232,509		2018/6/20
第113回利付国債(5年)	0.3	980,000	987,546		2018/6/20
第114回利付国債(5年)	0.3	140,000	141,113		2018/9/20
第115回利付国債(5年)	0.2	630,000	632,828		2018/9/20
第116回利付国債(5年)	0.2	920,000	924,084		2018/12/20
第117回利付国債(5年)	0.2	1,050,000	1,054,557		2019/3/20
第118回利付国債(5年)	0.2	250,000	251,047		2019/6/20
第119回利付国債(5年)	0.1	550,000	550,000		2019/6/20
第120回利付国債(5年)	0.2	270,000	271,080		2019/9/20
第121回利付国債(5年)	0.1	740,000	739,667		2019/9/20
第122回利付国債(5年)	0.1	850,000	849,201		2019/12/20
第123回利付国債(5年)	0.1	350,000	349,482		2020/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	67,000	85,085		2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	116,000	141,262		2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	113,000	137,777		2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	151,000	184,303		2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	155,000	180,288		2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	170,000	192,501		2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	190,000	203,854		2054/3/20
第281回利付国債(10年)	2.0	316,000	323,568		2016/6/20
第282回利付国債(10年)	1.7	520,000	532,745		2016/9/20
第283回利付国債(10年)	1.8	991,000	1,016,746		2016/9/20

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284回利付国債 (10年)	1.7	1,078,000	1,108,906	2016/12/20
第285回利付国債 (10年)	1.7	770,000	795,163	2017/3/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	764,000	795,377	2017/6/20
第288回利付国債 (10年)	1.7	288,000	299,750	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	287,000	298,293	2017/12/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	674,000	706,911	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	154,000	162,627	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	180,000	188,350	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	302,000	316,997	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	594,000	623,177	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	40,000	41,816	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	170,000	178,160	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	206,000	217,515	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	184,000	194,856	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	250,000	263,700	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	670,000	708,431	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	50,000	52,645	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	729,000	769,350	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	578,000	614,356	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	180,000	190,434	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	190,000	201,517	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	510,000	535,627	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	486,000	508,681	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	210,000	217,520	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	623,000	660,454	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	406,000	433,725	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	220,000	232,423	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	422,000	449,425	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	170,000	180,001	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	203,000	215,354	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	380,000	400,691	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	377,000	400,683	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	390,000	411,910	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	148,000	156,508	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	40,000	42,024	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	504,000	529,280	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	230,000	239,901	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	635,000	662,305	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	310,000	320,924	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	250,000	260,705	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	450,000	462,118	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	700,000	729,820	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	340,000	354,477	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	350,000	358,967	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	690,000	707,284	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	990,000	1,014,156	2024/3/20

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334回利付国債 (10年)	0.6	840,000	859,899	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	730,000	739,694	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	280,000	283,281	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	580,000	575,916	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	200,000	200,094	2025/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	15,000	19,290	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	20,000	24,633	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	29,000	35,300	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	30,000	39,190	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	21,000	25,290	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	45,000	55,489	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	59,000	71,900	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	76,000	86,412	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	43,000	46,074	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	68,000	69,298	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	55,000	61,310	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	45,000	53,088	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	71,000	82,519	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	94,000	115,438	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	118,000	147,004	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	74,000	92,163	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	88,000	107,935	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	108,000	130,496	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	78,000	94,180	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	75,000	93,243	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	102,000	123,171	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	104,000	129,465	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	83,000	103,343	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	68,000	84,680	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	108,000	130,375	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	208,000	255,155	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	132,000	164,846	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	210,000	262,695	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	150,000	184,992	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	235,000	285,501	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	219,000	262,158	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	254,000	309,753	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	287,000	331,786	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	291,000	349,296	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	296,000	342,534	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	305,000	353,269	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	337,000	382,572	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	190,000	211,215	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	200,000	226,880	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	170,000	188,837	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	170,000	184,798	2043/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第42回利付国債 (30年)	1.7	190,000	206,425	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	200,000	217,168	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	210,000	227,896	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	220,000	227,964	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	80,000	82,824	2045/3/20
第33回利付国債 (20年)	3.8	50,000	52,766	2016/9/20
第35回利付国債 (20年)	3.3	33,000	35,114	2017/3/20
第37回利付国債 (20年)	3.1	40,000	43,007	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	98,000	105,686	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	209,000	225,126	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	258,000	283,634	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	71,000	79,826	2019/9/20
第45回利付国債 (20年)	2.4	96,000	106,748	2020/3/20
第46回利付国債 (20年)	2.2	38,000	42,068	2020/6/22
第47回利付国債 (20年)	2.2	48,000	53,383	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	49,000	55,578	2020/12/21
第50回利付国債 (20年)	1.9	134,000	147,961	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	52,000	57,981	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	47,000	52,890	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	97,000	110,224	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	110,000	123,945	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	118,000	133,204	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	106,000	119,084	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	180,000	199,989	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	60,000	63,513	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	133,000	149,476	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	147,000	166,630	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	127,000	144,385	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	50,000	56,419	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	275,000	320,331	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	190,000	225,379	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	116,000	134,851	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	195,000	225,236	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	116,000	135,285	2025/3/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	211,000	246,570	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	240,000	281,136	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	150,000	175,935	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	30,000	34,879	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	80,000	93,988	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	185,000	221,337	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	163,000	195,406	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	110,000	130,922	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	213,000	255,832	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	215,000	253,779	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	100,000	117,065	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	98,000	115,831	2027/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第95回利付国債 (20年)	2.3	201,000	242,653	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	50,000	59,176	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	134,000	160,359	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	110,000	130,350	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	226,000	268,115	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	323,000	387,257	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	239,000	292,935	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	80,000	95,043	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	80,000	95,072	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	238,000	285,807	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	43,000	51,110	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	170,000	197,759	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	150,000	174,562	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	212,000	252,322	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	208,000	250,282	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	80,000	95,220	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	335,000	398,710	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	100,000	118,997	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	237,000	285,385	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	179,000	215,514	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	220,000	261,718	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	201,000	236,444	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	40,000	44,765	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	275,000	319,497	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	60,000	68,827	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	310,000	369,101	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	120,000	141,090	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	314,000	378,643	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	40,000	46,961	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	10,000	11,606	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	251,000	291,049	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	328,000	374,907	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	392,000	441,094	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	30,000	34,246	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	91,000	103,740	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	56,217	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	130,000	144,134	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	310,000	348,006	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	40,000	43,642	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	375,000	420,600	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	390,000	436,675	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	300,000	330,429	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	110,000	119,375	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	380,000	423,597	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	400,000	445,036	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	400,000	437,492	2033/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第148回利付国債 (20年)	1.5	390,000	419,078	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	430,000	461,308	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	430,000	452,863	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	440,000	446,402	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	70,000	70,855	2035/3/20
小 計		60,767,000	65,191,906	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	30,000	32,973	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	20,000	24,416	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	20,000	23,301	2038/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	20,000	23,590	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	20,000	23,866	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	80,000	92,412	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	30,000	34,831	2031/6/20
第662回東京都公募公債	1.67	110,000	115,918	2018/9/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	53,105	2019/6/20
第672回東京都公募公債	1.51	20,000	21,141	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	20,000	21,143	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,984	2020/3/19
第691回東京都公募公債	1.24	100,000	105,971	2020/12/18
第705回東京都公募公債	1.06	30,000	31,749	2022/3/18
第719回東京都公募公債	0.86	50,000	52,200	2023/3/20
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	30,000	31,228	2017/6/29
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	30,000	31,572	2018/8/29
平成20年度第16回北海道公募公債	1.7	100,300	106,244	2019/3/25
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	51,700	2022/10/31
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	20,000	23,343	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	20,000	25,628	2036/6/20
第147回神奈川県公募公債	1.98	10,500	10,938	2017/6/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	30,000	31,843	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	53,850	56,662	2019/6/20
第209回神奈川県公募公債	0.549	100,000	101,311	2024/9/20
第74回大阪府公募公債 (5年)	0.46	100,000	100,429	2016/6/29
第300回大阪府公募公債	1.8	120,000	123,998	2017/3/29
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	31,270	2017/9/27
第312回大阪府公募公債	1.6	17,000	17,741	2018/3/28
第348回大阪府公募公債	1.32	20,000	21,295	2021/3/30
第359回大阪府公募公債	0.99	15,000	15,762	2022/3/29
第367回大阪府公募公債	0.73	10,000	10,309	2022/12/27
第390回大阪府公募公債	0.527	114,000	114,771	2024/11/27
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	84,100	88,682	2022/3/16
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	10,000	11,819	2040/3/19
第7回兵庫県公募公債 (15年)	1.12	100,000	104,789	2028/12/25
平成19年度第6回兵庫県公募公債	1.98	100,000	104,272	2017/7/20
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	30,000	31,782	2019/5/22
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	19,000	19,965	2018/5/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	13,000	13,752	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	13,140	13,822	2018/8/28
平成20年度第7回静岡県公募公債	1.71	20,300	21,465	2018/11/27
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	10,000	10,610	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	105,210	2020/7/22
平成24年度第8回静岡県公募公債 (5年)	0.236	28,980	29,079	2017/10/18
平成19年度第3回愛知県公募公債	1.89	33,400	34,823	2017/8/17
平成22年度第19回愛知県公募公債	1.398	100,000	107,131	2021/3/30
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	60,000	62,547	2023/7/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	30,630	32,463	2021/5/27
平成18年度第2回埼玉県公募公債	2.0	101,320	103,581	2016/5/30
平成18年度第3回埼玉県公募公債	2.1	12,200	12,525	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公募公債	1.9	36,000	37,086	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公募公債	1.85	15,000	15,502	2017/2/27
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	13,400	13,977	2018/1/30
平成22年度第5回埼玉県公募公債	1.08	50,000	52,383	2020/8/25
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	50,000	50,655	2024/9/26
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	30,000	37,111	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	20,000	23,481	2038/9/17
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	40,000	41,656	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	20,000	22,841	2030/10/11
平成23年度第1回千葉県公募公債	1.19	80,000	84,811	2021/5/25
平成24年度第8回千葉県公募公債	0.84	70,000	72,945	2023/1/25
平成22年度第2回新潟県公募公債	1.29	30,800	32,743	2021/2/25
第38回共同発行市場公募地方債	2.0	25,000	25,551	2016/5/25
第41回共同発行市場公募地方債	2.0	59,100	60,685	2016/8/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	10,000	10,417	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	109,300	113,764	2017/8/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,689	2018/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	13,900	14,737	2019/8/23
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,700	2019/12/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	100,000	104,553	2020/8/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	106,034	2021/1/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	105,118	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	60,000	63,245	2022/2/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	30,000	31,629	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	30,000	31,717	2022/4/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,201	2022/7/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	50,000	51,948	2022/11/25
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	100,000	104,454	2023/6/23
平成18年度第1回堺市公募公債	1.84	30,000	30,892	2016/12/26
平成18年度第2回熊本県公募公債	1.8	30,000	30,805	2016/10/27
平成19年度第10回大阪市公募公債	1.74	50,000	52,189	2017/12/19
平成20年度第2回大阪市公募公債	1.95	60,000	63,483	2018/6/20
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	20,000	21,273	2019/11/25
平成23年度第4回大阪市公募公債	1.178	60,000	63,537	2021/7/22

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23年度第8回大阪市公募公債	1.015	20,000	21,018	2021/11/17
第1回名古屋市長官公債(12年)	1.033	100,000	105,441	2025/6/20
第9回名古屋市長官公債(30年)	2.095	10,000	11,424	2042/9/19
第10回名古屋市長官公債(20年)	2.26	20,000	24,060	2029/8/17
第461回名古屋市長官公債	1.71	50,000	52,186	2017/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	59,992	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	50,000	60,707	2026/6/19
平成18年度第4回神戸市公募公債	2.04	12,000	12,388	2016/11/28
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	20,000	23,489	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	50,000	58,142	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	20,000	23,533	2028/12/20
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	20,000	23,619	2029/10/19
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	20,000	23,514	2040/9/20
平成17年度第3回福岡市公募公債	1.6	18,200	18,384	2015/11/30
平成23年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.47	28,300	28,432	2016/6/24
平成24年度第5回福岡市公募公債(5年)	0.19	50,000	50,109	2017/12/26
平成24年度第2回千葉市公募公債	0.81	50,000	51,964	2022/11/22
平成25年度第1回三重県公募公債	0.655	68,520	70,247	2023/11/29
小 計		4,836,240	5,129,455	
特殊債券(除く金融債)				
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	10,000	10,225	2016/6/22
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	75,000	77,468	2017/2/28
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	14,000	14,614	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	35,200	36,615	2017/9/28
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	57,000	59,264	2018/4/20
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	50,000	52,657	2018/10/31
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	56,000	59,025	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	56,000	58,549	2019/2/27
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	23,000	24,182	2019/9/30
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	20,000	20,983	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	15,000	15,820	2020/1/31
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	52,796	2020/3/19
第111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	116,945	2030/6/28
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	60,000	63,497	2020/12/28
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	67,000	70,737	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	100,000	105,692	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	21,000	22,071	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	36,000	37,882	2021/10/29
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	13,000	13,620	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	116,000	121,574	2022/3/18
第160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	113,330	2032/3/19
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	50,000	51,974	2022/10/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	70,000	72,900	2023/2/28
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	102,982	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	28,000	28,680	2023/5/31
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	33,000	34,612	2023/7/31

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207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	121,000	124,627	2023/12/28
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	26,000	26,591	2016/6/27
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	10,000	10,384	2017/12/21
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	13,000	13,502	2018/3/16
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,686	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	13,000	13,694	2019/7/12
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	42,000	44,134	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	15,000	15,841	2019/5/24
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	104,872	2020/7/17
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	60,000	63,594	2021/12/14
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	22,000	22,656	2023/3/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	50,000	52,143	2023/8/14
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	100,000	102,845	2023/11/17
第866回政府保証公営企業債券	2.0	100,000	102,660	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	50,000	51,404	2016/12/21
第875回政府保証公営企業債券	1.7	40,000	41,385	2017/5/22
第885回政府保証公営企業債券	1.7	90,000	94,509	2018/5/22
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	70,000	72,454	2022/12/16
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	16,000	16,498	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	78,000	80,992	2017/12/18
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	100,000	100,500	2018/11/9
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	100,000	102,980	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	80,000	82,425	2023/12/18
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	25,000	26,072	2017/11/28
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	52,275	2018/3/20
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.21	50,000	58,549	2025/12/19
第17回道路債券(財投機関債)	1.54	50,000	54,456	2022/12/20
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	12,537	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	30,000	37,021	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	40,000	48,094	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	100,000	104,139	2017/9/20
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.84	10,000	12,744	2048/3/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.37	30,000	36,170	2028/9/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	56,732	2032/3/19
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	103,264	2022/12/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	59,678	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	20,000	21,028	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	10,000	10,527	2023/3/22
第4回地方公営企業等金融機構債券(財投機関債)	1.593	100,000	105,745	2019/5/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,583	2024/9/24
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	20,000	23,647	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	20,000	22,629	2031/8/28
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,914	2020/12/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	50,000	54,977	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	30,000	33,107	2023/3/17
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	100,000	104,986	2022/4/28

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45回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	100,000	103,397	2023/2/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	111,097	2027/8/20
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	30,000	32,598	2031/7/30
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	115,808	2025/3/21
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	20,000	23,606	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	20,000	22,855	2030/10/29
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	27,755	30,159	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	35,131	38,145	2042/8/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	24,690	26,743	2037/5/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	30,000	31,175	2017/9/20
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	25,542	27,617	2037/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	41,749	43,829	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	42,568	44,824	2032/11/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	38,442	40,703	2040/7/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	35,885	38,342	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	34,194	36,453	2041/2/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	79,188	83,955	2045/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	77,091	81,874	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	80,536	85,490	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	35,130	38,131	2042/3/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	83,126	87,480	2046/11/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	85,627	89,944	2047/4/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	91,848	95,820	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	20,000	23,247	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	90,769	94,092	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	70,000	78,710	2026/6/19
第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	98,063	99,507	2049/9/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	20,000	22,828	2042/9/19
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	30,000	34,626	2031/6/13
第42回中日本高速道路	0.942	100,000	104,377	2022/3/18
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	1.67	20,000	21,166	2019/3/20
小 計		5,483,534	5,843,578	
金融債券				
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,277	2016/7/27
い第746号農林債券	0.35	100,000	100,356	2017/7/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,418	2018/1/26
い第761号農林債券	0.3	50,000	50,111	2018/10/26
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,192	2019/2/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,258	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,214	2017/5/26
第7号商工債券(10年)	1.78	100,000	105,469	2018/9/20
第175号商工債券(3年)	0.15	100,000	99,962	2017/8/25
小 計		750,000	757,258	
普通社債券				
第490回中部電力	1.444	30,000	31,409	2019/7/25
第498回中部電力	0.566	100,000	100,841	2017/9/25

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469回関西電力	1.7	100,000	104,366	2018/10/25
第376回中国電力	0.628	100,000	101,034	2018/6/25
第297回北陸電力	0.976	80,000	82,485	2020/10/23
第376回東北電力	3.7	10,000	10,227	2015/11/25
第459回東北電力	0.869	100,000	101,214	2017/2/24
第235回四国電力	2.72	100,000	108,200	2018/8/24
第388回九州電力	2.08	100,000	102,080	2016/5/25
第400回九州電力	1.777	30,000	31,939	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	105,232	2019/6/25
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,220	2020/12/25
第19回沖縄電力	1.452	20,000	21,186	2020/4/24
第346回東京交通債券	1.13	130,000	137,722	2023/6/20
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,692	2021/12/20
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,651	2018/8/3
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,126	2019/3/20
第8回リコー	2.075	100,000	107,172	2019/3/4
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,559	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.5	100,000	108,634	2019/6/3
第26回みずほコーポレート銀行	0.54	100,000	100,458	2016/7/20
第28回みずほコーポレート銀行	0.515	100,000	100,575	2017/1/25
第25回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.31	100,000	105,059	2020/11/12
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	103,501	2017/4/20
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.345	100,000	100,396	2017/6/7
第9回三菱UFJ信託銀行 (劣後特約付)	1.68	100,000	107,614	2021/4/28
第10回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.11	100,000	103,488	2017/2/16
第20回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	100,000	107,959	2019/7/24
第56回三井住友銀行	0.47	100,000	100,553	2017/1/20
第19回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.67	100,000	107,663	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,082	2019/6/20
第152回オリックス	0.92	100,000	100,994	2016/8/31
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	101,184	2021/1/29
第26回三菱UFJリース	0.441	100,000	100,711	2019/11/21
第10回野村ホールディングス	1.91	100,000	104,253	2017/11/27
第30回野村ホールディングス	1.053	100,000	101,599	2017/4/18
第116回三菱地所	0.643	100,000	101,282	2024/9/19
第13回東日本旅客鉄道	2.6	37,000	41,205	2020/2/25
第49回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	118,556	2027/4/16
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	105,216	2019/9/27
第19回西日本旅客鉄道	2.376	100,000	120,572	2028/12/11
第7回東海旅客鉄道	2.2	30,000	33,998	2022/5/10
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	106,059	2022/12/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,437	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,300	2020/6/19
第37回電源開発	1.035	100,000	103,503	2021/7/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	99,782	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	100,000	100,870	2016/6/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行		0.98	100,000	100,675	2016/1/21
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク		0.94	100,000	100,270	2015/7/28
小	計		4,467,000	4,650,807	
合	計		76,303,774	81,573,005	

○投資信託財産の構成

(2015年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 81,573,005	% 98.8
コール・ローン等、その他	1,024,363	1.2
投資信託財産総額	82,597,368	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月31日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	82,597,368,786
コール・ローン等	549,214,693
公社債(評価額)	81,573,005,940
未収入金	340,272,000
未収利息	131,584,457
前払費用	3,291,696
(B) 負債	774,881,549
未払金	623,375,400
未払解約金	81,384,357
未払信託報酬	69,000,593
その他未払費用	1,121,199
(C) 純資産総額(A-B)	81,822,487,237
元本	65,714,202,539
次期繰越損益金	16,108,284,698
(D) 受益権総口数	65,714,202,539口
1万円当たり基準価額(C/D)	12,451円

<注記事項>

①期首元本額	62,051,217,072円
期中追加設定元本額	12,265,903,724円
期中一部解約元本額	8,602,918,257円

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	842,150,532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	820,018,856円
収益調整金額	C	11,221,715,063円
分配準備積立金額	D	4,943,018,425円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,826,902,876円
当ファンドの期末残存口数	F	65,714,202,539口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,712円
1万円当たり分配金額	H	-円
収益分配金額	I=F*H/10,000	-円

○損益の状況 (2014年4月1日～2015年3月31日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	901,190,837
受取利息	901,163,965
その他収益金	26,872
(B) 有価証券売買損益	1,200,536,385
売買益	1,561,829,072
売買損	△ 361,292,687
(C) 先物取引等取引損益	1,295,732
取引益	1,409,893
取引損	△ 114,161
(D) 信託報酬等	△ 137,783,676
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,965,239,278
(F) 前期繰越損益金	4,639,948,535
(G) 追加信託差損益金	9,503,096,885
(配当等相当額)	(11,221,715,063)
(売買損益相当額)	(△ 1,718,618,178)
(H) 計(E+F+G)	16,108,284,698
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	16,108,284,698
追加信託差損益金	9,503,096,885
(配当等相当額)	(11,221,715,063)
(売買損益相当額)	(△ 1,718,618,178)
分配準備積立金	6,605,187,813

(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) (D)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) (G)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)