

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。

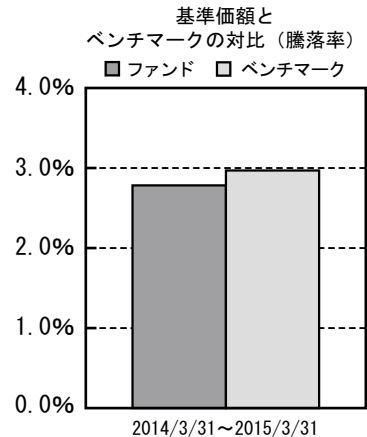
◎銘柄選択要因

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 | B/A | % | うち利害関係人との取引状況D | 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 | | | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
|-----------------|-------|---------|---------|------------|-----------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | |
| 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 | | | 償還年月日 |
|-------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第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)