

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15期（決算日：2016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15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**
(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

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	1
◇運用経過	2
◇今後の運用方針	5
◇1万口当たりの費用明細	6
◇売買及び取引の状況	7
◇利害関係人との取引状況等	7
◇組入資産の明細	8
◇投資信託財産の構成	20
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	21
◇損益の状況	21
◇お知らせ	21

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 総合インデックス		債組入比率	債券先物比率	純資産額		
		税金	み	期	中	騰				落	
	円	分	金	騰	落	率			百万円		
11期(2012年4月2日)	11,640		円	0		2.6	337.69	2.8	99.6	—	62,738
12期(2013年4月1日)	12,051		円	0		3.5	350.38	3.8	99.6	—	69,880
13期(2014年3月31日)	12,114		円	0		0.5	352.80	0.7	99.7	—	75,169
14期(2015年3月31日)	12,451		円	0		2.8	363.28	3.0	99.7	—	81,822
15期(2016年3月31日)	13,103		円	0		5.2	382.91	5.4	99.7	—	93,407

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		NOMURA-BPI 総合インデックス		債組入比率	債券先物比率
		騰	落	騰	落		
	円		率		率		
(期首) 2015年3月31日	12,451		—	363.28	—	99.7	—
4月末	12,490		0.3	364.50	0.3	99.7	—
5月末	12,431		△0.2	362.77	△0.1	99.4	0.2
6月末	12,422		△0.2	362.54	△0.2	99.6	—
7月末	12,456		0.0	363.58	0.1	99.5	—
8月末	12,476		0.2	364.20	0.3	99.4	—
9月末	12,510		0.5	365.24	0.5	99.8	—
10月末	12,556		0.8	366.65	0.9	99.3	—
11月末	12,552		0.8	366.58	0.9	99.6	—
12月末	12,628		1.4	368.88	1.5	99.5	—
2016年1月末	12,782		2.7	373.52	2.8	99.7	—
2月末	13,000		4.4	379.83	4.6	99.7	—
(期末) 2016年3月31日	13,103		5.2	382.91	5.4	99.7	—

(注) 騰落率は期首比。

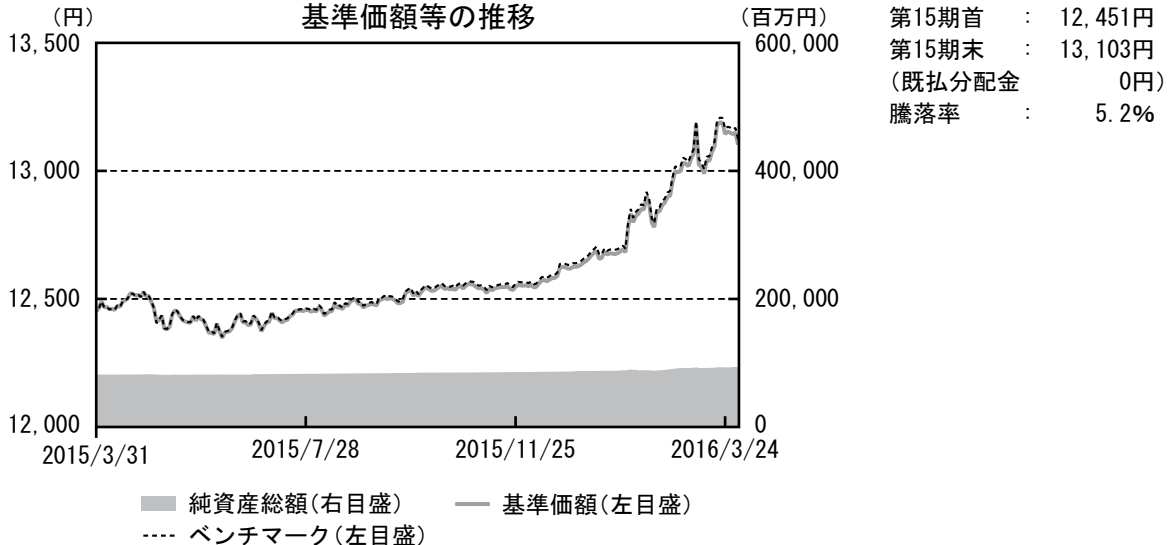
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第15期：2015/4/1～2016/3/31)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ5.2%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(5.4%)を0.2%下回りました。



基準価額の変動要因

上昇要因	原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などを背景に債券市況(NOMURA-BPI総合インデックス)は上昇(金利は低下)基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことによる債券市況の一段の上昇を受けて、基準価額は上昇しました。
------	---

投資環境について

(第15期：2015/4/1～2016/3/31)

◎国内債券市況

- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことから、債券市況は一段と上昇しました。

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。
- ・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（NOMURA-BPI総合インデックス）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

(ご参考)

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（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。

期末（2016年3月31日）

最終利回り	0.0%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.8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	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。

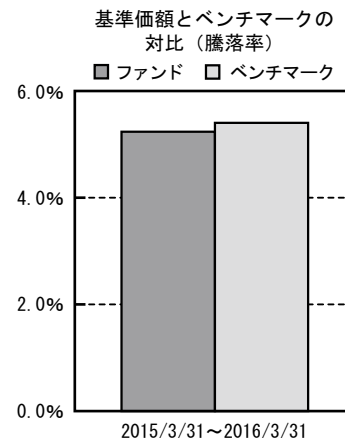
◎銘柄選択要因

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、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15期
	2015年4月1日～2016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	3,342

(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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	22	0.173	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(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)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	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	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	22	0.176	
期中の平均基準価額は、12,562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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 20,803,863	千円 13,695,622
	地方債証券	1,252,441	709,780
	特殊債券	1,944,082	721,081 (123,587)
	社債券	850,955	1,521,292 (210,000)

(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 906	百万円 906	百万円 —	百万円 —

○利害関係人との取引状況等

(2015年4月1日～2016年3月31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		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 24,851	百万円 5,895	% 23.7	百万円 16,647	百万円 7,265	% 43.6

(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 106	百万円 101	百万円 520

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 300

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

○組入資産の明細

(2016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	67,579,000	75,839,958	81.2	—	50.4	20.9	9.9
地方債証券	5,341,580	5,737,768	6.1	—	3.8	1.8	0.5
	(5,341,580)	(5,737,768)	(6.1)	(—)	(3.8)	(1.8)	(0.5)
特殊債券 (除く金融債)	6,261,729	6,766,249	7.2	—	5.6	1.2	0.4
	(6,261,729)	(6,766,249)	(7.2)	(—)	(5.6)	(1.2)	(0.4)
金融債券	1,020,000	1,028,633	1.1	—	—	0.6	0.5
	(1,020,000)	(1,028,633)	(1.1)	(—)	(—)	(0.6)	(0.5)
普通社債券	3,597,000	3,779,092	4.0	—	1.5	2.4	0.2
	(3,597,000)	(3,779,092)	(4.0)	(—)	(1.5)	(2.4)	(0.2)
合 計	83,799,309	93,151,702	99.7	—	61.3	26.9	11.5
	(16,220,309)	(17,311,744)	(18.5)	(—)	(10.9)	(6.0)	(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355回利付国債 (2年)	0.1	1,500,000	1,506,045	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	370,000	371,613	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	290,000	291,313	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	610,000	612,964	2017/11/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	560,000	562,648	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	1,135,000	1,141,571	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	590,000	594,053	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	420,000	422,163	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	620,000	623,837	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	340,000	343,444	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	250,000	253,022	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	230,000	233,192	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	860,000	870,027	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	140,000	141,820	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	630,000	636,627	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	800,000	809,384	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	1,120,000	1,134,347	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	360,000	364,946	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	490,000	495,149	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	340,000	344,919	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	560,000	566,154	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	850,000	859,851	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,060,000	1,072,900	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	1,260,000	1,276,052	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	860,000	871,420	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	890,000	902,264	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	260,000	263,772	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	67,000	102,786	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	116,000	172,531	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	143,000	214,192	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	171,000	257,888	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	175,000	254,231	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	170,000	242,727	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	190,000	259,838	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	270,000	342,532	2055/3/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	574,000	588,556	2017/6/20
第288回利付国債 (10年)	1.7	288,000	296,006	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	767,000	789,465	2017/12/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	674,000	699,248	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	154,000	160,909	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	180,000	187,677	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	280,000	290,698	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	432,000	450,567	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	74,000	77,281	2018/12/20

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298回利付国債 (10年)	1.3	540,000	562,469	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	170,000	177,721	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	206,000	216,584	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	184,000	194,234	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	250,000	263,095	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	750,000	792,120	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	50,000	52,633	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	709,000	749,051	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	578,000	615,026	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	210,000	222,612	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	190,000	202,103	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	510,000	538,152	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	466,000	490,958	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	210,000	219,357	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	513,000	546,904	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	406,000	436,173	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	230,000	244,791	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	422,000	452,987	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	240,000	256,360	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	183,000	196,084	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	460,000	490,350	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	247,000	265,475	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	520,000	555,895	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	158,000	169,382	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	40,000	42,640	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	324,000	346,304	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	420,000	446,271	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	805,000	857,139	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	260,000	275,639	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	280,000	298,743	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	340,000	358,686	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	470,000	503,280	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	230,000	246,769	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	350,000	370,230	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	540,000	571,822	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	910,000	964,581	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,110,000	1,177,732	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	650,000	684,742	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	240,000	252,988	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	520,000	538,990	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	790,000	826,079	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	920,000	961,869	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	910,000	951,641	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	960,000	994,243	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	160,000	162,401	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1回利付国債(30年)	2.8	15,000	20,407	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	20,000	26,262	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	29,000	37,781	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	30,000	41,870	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	21,000	27,306	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	45,000	60,141	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	59,000	78,294	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	76,000	94,965	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	43,000	50,932	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	68,000	77,214	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	55,000	67,879	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	45,000	58,635	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	71,000	91,376	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	94,000	127,637	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	118,000	162,545	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	74,000	102,122	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	88,000	119,997	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	108,000	145,572	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	78,000	105,283	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	75,000	104,097	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	102,000	137,914	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	104,000	144,768	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	83,000	115,700	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	108,000	150,898	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	108,000	146,968	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	208,000	287,609	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	102,000	143,770	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	230,000	325,525	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	150,000	210,315	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	255,000	353,901	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	219,000	300,651	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	294,000	412,073	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	327,000	438,209	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	301,000	418,724	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	306,000	413,409	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	335,000	454,635	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	327,000	437,568	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	220,000	290,010	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	200,000	269,322	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	170,000	224,995	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	220,000	285,995	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	210,000	273,153	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	220,000	286,686	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	210,000	274,155	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	210,000	263,386	2044/12/20

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46回利付国債 (30年)	1.5	270,000	339,155	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	260,000	333,746	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	300,000	369,333	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	300,000	369,846	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	60,000	64,188	2046/3/20
第37回利付国債 (20年)	3.1	40,000	41,936	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	98,000	103,598	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	209,000	221,960	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	258,000	279,543	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	71,000	78,675	2019/9/20
第45回利付国債 (20年)	2.4	96,000	105,917	2020/3/20
第46回利付国債 (20年)	2.2	38,000	41,833	2020/6/22
第47回利付国債 (20年)	2.2	48,000	53,154	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	49,000	55,244	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	52,929	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	97,000	110,355	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	110,000	124,488	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	118,000	134,156	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	106,000	120,377	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	180,000	202,991	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	60,000	64,966	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	133,000	152,072	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	147,000	169,871	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	127,000	147,313	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	50,000	57,607	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	275,000	326,790	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	190,000	229,894	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	116,000	138,016	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	195,000	231,192	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	116,000	139,006	2025/3/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	211,000	253,799	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	240,000	289,610	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	150,000	181,651	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	30,000	36,037	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	80,000	97,166	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	185,000	228,397	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	40,000	48,983	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	163,000	202,002	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	150,000	185,011	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	183,000	227,633	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	215,000	263,789	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	100,000	122,051	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	98,000	120,685	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	252,827	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	50,000	61,771	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	134,000	167,600	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	110,000	136,323	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	296,000	367,939	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	323,000	406,521	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	239,000	307,538	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	10,000	12,503	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	80,000	100,312	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	238,000	301,377	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	43,000	54,066	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	220,000	271,240	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	150,000	185,251	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	242,000	305,089	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	208,000	265,645	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	130,000	164,329	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	325,000	411,892	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	160,000	203,284	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	237,000	304,322	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	179,000	230,430	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	250,000	318,395	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	201,000	253,621	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	40,000	49,354	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	40,000	48,238	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	345,000	431,381	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	80,000	98,895	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	240,000	307,586	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	170,000	215,271	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	334,000	433,855	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	40,000	50,789	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	10,000	12,551	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	261,000	328,191	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	120,000	149,113	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	328,000	408,245	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	302,000	371,571	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	80,000	99,650	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	91,000	113,517	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	61,598	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	120,000	145,868	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	300,000	369,786	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	40,000	48,014	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	60,000	72,960	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	365,000	450,107	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	390,000	481,100	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	10,000	12,496	2032/12/20

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143回利付国債 (20年)	1.6	360,000	438,354	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	110,000	132,154	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	390,000	481,720	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	390,000	481,798	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	430,000	524,453	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	470,000	565,146	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	430,000	516,868	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	430,000	509,180	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	430,000	493,321	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	410,000	470,286	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	500,000	582,355	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	430,000	492,560	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	470,000	520,572	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	110,000	109,192	2036/3/20
小 計		67,579,000	75,839,958	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	30,000	33,133	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	20,000	27,420	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	20,000	26,262	2038/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	20,000	24,957	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	20,000	25,280	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	80,000	98,617	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	30,000	37,470	2031/6/20
第662回東京都公募公債	1.67	110,000	114,471	2018/9/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	52,548	2019/6/20
第672回東京都公募公債	1.51	20,000	20,942	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	20,000	20,996	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,304	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	104,335	2020/6/19
第691回東京都公募公債	1.24	100,000	105,576	2020/12/18
第697回東京都公募公債	1.11	50,000	52,759	2021/6/18
第705回東京都公募公債	1.06	30,000	31,795	2022/3/18
第719回東京都公募公債	0.86	50,000	52,722	2023/3/20
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	30,000	30,692	2017/6/29
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	30,000	31,192	2018/8/29
平成20年度第16回北海道公募公債	1.7	100,300	105,118	2019/3/25
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	52,185	2022/10/31
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	20,000	23,602	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	20,000	28,310	2036/6/20
第147回神奈川県公募公債	1.98	10,500	10,746	2017/6/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	30,000	31,514	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	53,850	56,187	2019/6/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	22,720	23,912	2020/3/20
第209回神奈川県公募公債	0.549	100,000	103,893	2024/9/20
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,757	2017/9/27

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312回大阪府公募公債	1.6	17,000	17,503	2018/3/28
第348回大阪府公募公債	1.32	20,000	21,212	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	20,000	21,022	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	15,000	15,794	2022/3/29
第367回大阪府公募公債	0.73	10,000	10,403	2022/12/27
第390回大阪府公募公債	0.527	114,000	118,115	2024/11/27
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	84,100	88,893	2022/3/16
平成25年度第1回京都府公募公債	0.58	100,000	103,513	2023/4/28
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	10,000	13,432	2040/3/19
第7回兵庫県公募公債(15年)	1.12	100,000	110,976	2028/12/25
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	30,000	31,437	2019/5/22
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	19,000	19,688	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	13,000	13,542	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	13,140	13,654	2018/8/28
平成20年度第7回静岡県公募公債	1.71	20,300	21,200	2018/11/27
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	10,000	10,513	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,819	2020/7/22
平成24年度第8回静岡県公募公債(5年)	0.236	28,980	29,065	2017/10/18
平成27年度第5回静岡県公募公債	0.578	100,000	104,452	2025/6/20
平成19年度第3回愛知県公募公債	1.89	33,400	34,248	2017/8/17
平成22年度第19回愛知県公募公債	1.398	100,000	106,717	2021/3/30
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	60,000	63,354	2023/7/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	30,630	32,412	2021/5/27
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	13,400	13,784	2018/1/30
平成22年度第5回埼玉県公募公債	1.08	50,000	52,242	2020/8/25
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	50,000	51,971	2024/9/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	30,000	41,395	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	20,000	26,459	2038/9/17
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	140,000	145,611	2020/10/28
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	20,000	24,404	2030/10/11
平成23年度第1回千葉県公募公債	1.19	80,000	84,628	2021/5/25
平成24年度第8回千葉県公募公債	0.84	70,000	73,671	2023/1/25
平成22年度第2回新潟県公募公債	1.29	30,800	32,676	2021/2/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	109,300	111,988	2017/8/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	104,110	2018/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	13,900	14,602	2019/8/23
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,377	2019/12/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	100,000	104,331	2020/8/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,697	2021/1/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	105,223	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	60,000	63,351	2022/2/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	30,000	31,695	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	30,000	31,790	2022/4/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,957	2022/7/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	50,000	52,431	2022/11/25

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123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	105,711	2023/6/23
第138回共同発行市場公募地方債		0.554	100,000	103,942	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	103,642	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	100,000	102,327	2025/1/24
第146回共同発行市場公募地方債		0.553	100,000	104,191	2025/5/23
平成19年度第10回大阪市公募公債		1.74	50,000	51,425	2017/12/19
平成20年度第2回大阪市公募公債		1.95	60,000	62,515	2018/6/20
平成21年度第6回大阪市公募公債		1.57	20,000	21,097	2019/11/25
平成23年度第4回大阪市公募公債		1.178	60,000	63,565	2021/7/22
平成23年度第8回大阪市公募公債		1.015	20,000	21,077	2021/11/17
第1回名古屋市公募公債(12年)		1.033	100,000	108,621	2025/6/20
第9回名古屋市公募公債(30年)		2.095	10,000	13,230	2042/9/19
第10回名古屋市公募公債(20年)		2.26	20,000	25,318	2029/8/17
第461回名古屋市公募公債		1.71	50,000	51,406	2017/12/20
第485回名古屋市公募公債		0.67	100,000	104,508	2023/12/8
第5回京都市公募公債(20年)		2.36	50,000	61,755	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	70,000	86,969	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)		2.09	20,000	25,064	2031/1/24
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	119,203	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	50,000	59,592	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)		2.07	20,000	24,669	2028/12/20
第20回横浜市公募公債(20年)		2.1	20,000	24,929	2029/10/19
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)		2.277	20,000	26,866	2040/9/20
平成24年度第5回福岡市公募公債(5年)		0.19	50,000	50,120	2017/12/26
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	50,000	52,461	2022/11/22
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	17,500	18,311	2020/11/30
平成25年度第1回三重県公募公債		0.655	123,760	129,228	2023/11/29
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	17,000	17,942	2019/11/29
小	計		5,341,580	5,737,768	
特殊債券(除く金融債)					
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	52,034	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	58,346	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	58,053	2019/2/27
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	108,000	112,985	2019/5/31
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	23,000	24,008	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	20,862	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	15,721	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	52,484	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	124,499	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	63,235	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	70,605	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	105,580	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	22,077	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	37,901	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	13,651	2022/2/28

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	121,858	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	122,622	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	250,000	261,970	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	73,619	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	104,179	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	29,076	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	35,036	2023/7/31
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	126,855	2023/12/28
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	100,000	104,604	2024/3/29
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	13,000	13,347	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	104,672	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	13,578	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	43,734	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	15,688	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	104,493	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	63,583	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	22,919	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	52,823	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	104,586	2023/11/17
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	70,000	73,148	2022/12/16
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	116,000	121,527	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	78,000	79,960	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	100,000	100,175	2019/2/13
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	209,000	217,727	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	80,000	83,858	2023/12/18
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	25,000	25,691	2017/11/28
第13回政府保証西日本高速道路債券	1.4	100,000	102,713	2018/3/27
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	51,629	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	59,738	2025/12/19
第17回道路債券(財投機関債)	1.54	50,000	54,899	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	10,000	14,870	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	43,959	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	49,574	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	102,599	2017/9/20
第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	50,000	69,007	2037/9/18
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	15,129	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	37,621	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	61,093	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	104,735	2022/12/20
第113回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.795	200,000	210,304	2023/9/20
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	62,557	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	20,900	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	10,000	10,655	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	104,881	2019/5/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	59,214	2024/9/24

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第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	25,238	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	24,264	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	52,859	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	59,486	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	33,316	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	105,788	2022/4/28
第45回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	100,000	104,860	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	115,273	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	35,058	2031/7/30
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	117,994	2025/3/21
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	20,000	24,935	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	20,000	24,327	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	23,975	25,964	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	28,742	31,031	2042/8/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	21,522	23,174	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	30,749	2017/9/20
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	22,242	23,930	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	34,882	36,419	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	35,839	37,521	2032/11/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	30,220	31,900	2040/7/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	28,644	30,460	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	27,222	28,876	2041/2/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	72,678	77,947	2045/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	66,355	71,121	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	71,226	76,438	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	28,923	31,298	2042/3/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	76,213	81,345	2046/11/10
第58回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.04	100,000	104,343	2020/9/18
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	78,683	83,928	2047/4/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	85,942	91,346	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	24,861	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	82,306	86,884	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	80,818	2026/6/19
第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	92,847	96,612	2049/9/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	93,619	97,569	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	93,649	97,107	2049/11/10
第118回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.814	50,000	60,440	2032/10/15
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	26,457	2042/9/19
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	30,000	37,101	2031/6/13
第42回中日本高速道路	0.942	100,000	105,300	2022/3/18
第59回中日本高速道路	0.309	100,000	101,470	2021/12/20
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	20,963	2019/3/20
小 計		6,261,729	6,766,249	
金融債券				
い第746号農林債券	0.35	100,000	100,370	2017/7/27

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	
い第752号農林債券		0.3	150,000	150,681	2018/1/26
い第761号農林債券		0.3	50,000	50,333	2018/10/26
い第765号農林債券		0.3	100,000	100,713	2019/2/27
い第778号農林債券		0.25	100,000	100,670	2020/3/27
第270回信金中金債		0.35	50,000	50,168	2017/5/26
第295回信金中金債		0.25	170,000	171,064	2019/6/27
第7号商工債券(10年)		1.78	100,000	104,337	2018/9/20
第175号商工債券(3年)		0.15	100,000	100,133	2017/8/25
第178号商工債券(3年)		0.15	100,000	100,164	2017/11/27
小	計		1,020,000	1,028,633	
普通社債券					
第490回中部電力		1.444	30,000	31,304	2019/7/25
第469回関西電力		1.7	100,000	103,926	2018/10/25
第297回北陸電力		0.976	80,000	82,861	2020/10/23
第235回四国電力		2.72	100,000	106,387	2018/8/24
第400回九州電力		1.777	30,000	31,834	2020/4/24
第408回九州電力		1.672	100,000	104,746	2019/6/25
第310回北海道電力		1.286	50,000	52,375	2020/12/25
第19回沖縄電力		1.452	20,000	21,135	2020/4/24
第346回東京交通債券		1.13	130,000	139,194	2023/6/20
第38回関西国際空港		1.112	50,000	53,029	2021/12/20
第10回成田国際空港		1.094	40,000	42,274	2021/9/17
第11回セブン&アイ・ホールディングス		0.514	100,000	102,285	2022/6/20
第1回日本生命2012基金		0.87	100,000	101,599	2018/8/3
第1回日本生命2015基金		0.406	100,000	100,728	2019/8/5
第78回三菱商事		1.155	100,000	105,970	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	107,271	2019/6/3
第33回みずほコーポレート銀行		0.41	100,000	100,735	2018/4/20
第25回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)		1.31	100,000	105,079	2020/11/12
第1回三菱UFJ信託銀行(特定社債間限定同順位)		0.345	100,000	100,344	2017/6/7
第6回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)		1.9	100,000	106,654	2020/3/2
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)		1.68	100,000	107,428	2021/4/28
第20回三井住友銀行(劣後特約付)		2.21	100,000	106,825	2019/7/24
第19回みずほ銀行(劣後特約付)		1.67	100,000	107,972	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス		0.253	100,000	100,422	2019/6/20
第9回三井住友ファイナンス&リース		0.518	100,000	101,688	2021/1/29
第26回三菱UFJリース		0.441	100,000	101,224	2019/11/21
第10回野村ホールディングス		1.91	100,000	102,990	2017/11/27
第116回三菱地所		0.643	100,000	102,938	2024/9/19
第13回東日本旅客鉄道		2.6	37,000	40,623	2020/2/25
第49回東日本旅客鉄道		2.26	100,000	121,523	2027/4/16
第62回東日本旅客鉄道		1.424	100,000	104,680	2019/9/27
第19回西日本旅客鉄道		2.376	100,000	125,389	2028/12/11
第7回東海旅客鉄道		2.2	30,000	33,867	2022/5/10
第11回東海旅客鉄道		1.15	100,000	106,971	2022/12/20

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1回ヤマトホールディングス	0.05	100,000	100,030	2019/3/14
第63回日本電信電話	0.69	100,000	103,974	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,407	2020/6/19
第37回電源開発	1.035	100,000	104,612	2021/7/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,769	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,328	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,697	2019/5/2
小 計		3,597,000	3,779,092	
合 計		83,799,309	93,151,702	

○投資信託財産の構成

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	93,151,702	98.9
コール・ローン等、その他	1,036,402	1.1
投資信託財産総額	94,188,104	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	94,188,104,447
コール・ローン等	496,937,048
公社債(評価額)	93,151,702,371
未収入金	401,916,000
未収利息	130,473,147
前払費用	7,075,881
(B) 負債	781,010,841
未払金	625,296,400
未払解約金	78,635,037
未払信託報酬	75,846,959
その他未払費用	1,232,445
(C) 純資産総額(A-B)	93,407,093,606
元本	71,288,501,135
次期繰越損益金	22,118,592,471
(D) 受益権総口数	71,288,501,135口
1万円当たり基準価額(C/D)	13,103円

<注記事項>

- ①期首元本額 65,714,202,539円
 期中追加設定元本額 14,269,425,406円
 期中一部解約元本額 8,695,126,810円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3103円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年4月1日～ 2016年3月31日
費用控除後の配当等収益額	869,528,317円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	3,519,607,721円
収益調整金額	13,624,554,882円
分配準備積立金額	5,813,193,174円
当ファンドの分配対象収益額	23,826,884,094円
1万円当たり収益分配対象額	3,342円
1万円当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

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

○損益の状況 (2015年4月1日～2016年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	899,181,544
受取利息	899,137,350
その他収益金	44,194
(B) 有価証券売買損益	3,639,515,835
売買益	3,886,696,317
売買損	△ 247,180,482
(C) 先物取引等取引損益	126,834
取引益	387,634
取引損	△ 260,800
(D) 信託報酬等	△ 149,688,175
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	4,389,136,038
(F) 前期繰越損益金	5,813,193,174
(G) 追加信託差損益金	11,916,263,259
(配当等相当額)	(13,624,554,882)
(売買損益相当額)	(△ 1,708,291,623)
(H) 計(E+F+G)	22,118,592,471
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	22,118,592,471
追加信託差損益金	11,916,263,259
(配当等相当額)	(13,624,554,882)
(売買損益相当額)	(△ 1,708,291,623)
分配準備積立金	10,202,329,212

(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。

【お知らせ】

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