

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。  分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

※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17期（決算日：2018年4月2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4月2日に第17期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		NOMURA-BPI 総合インデックス		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		米金騰落	中期騰落率	中期騰落率	中期騰落率			
13期(2014年3月31日)	円 12,114	0	0.5	352.80	0.7	99.7	—	百万円 75,169
14期(2015年3月31日)	12,451	0	2.8	363.28	3.0	99.7	—	81,822
15期(2016年3月31日)	13,103	0	5.2	382.91	5.4	99.7	—	93,407
16期(2017年3月31日)	12,930	0	△1.3	378.49	△1.2	99.6	—	97,994
17期(2018年4月2日)	13,027	0	0.8	381.89	0.9	99.7	—	105,123

(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
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2017年3月31日	円 12,930	—	—	378.49	—	99.6	—
4月末	12,993	0.5	0.5	380.33	0.5	99.5	—
5月末	12,965	0.3	0.3	379.55	0.3	99.3	—
6月末	12,926	△0.0	0.0	378.57	0.0	99.5	—
7月末	12,927	△0.0	0.0	378.55	0.0	99.5	—
8月末	12,994	0.5	0.6	380.58	0.6	99.4	—
9月末	12,946	0.1	0.2	379.27	0.2	99.6	—
10月末	12,944	0.1	0.2	379.27	0.2	99.5	—
11月末	12,977	0.4	0.5	380.26	0.5	99.4	—
12月末	12,983	0.4	0.5	380.51	0.5	99.6	—
2018年1月末	12,960	0.2	0.4	379.85	0.4	99.6	—
2月末	13,008	0.6	0.7	381.29	0.7	99.6	—
3月末	13,027	0.8	0.9	381.91	0.9	99.8	—
(期末) 2018年4月2日	13,027	0.8	0.9	381.89	0.9	99.7	—

(注) 騰落率は期首比。

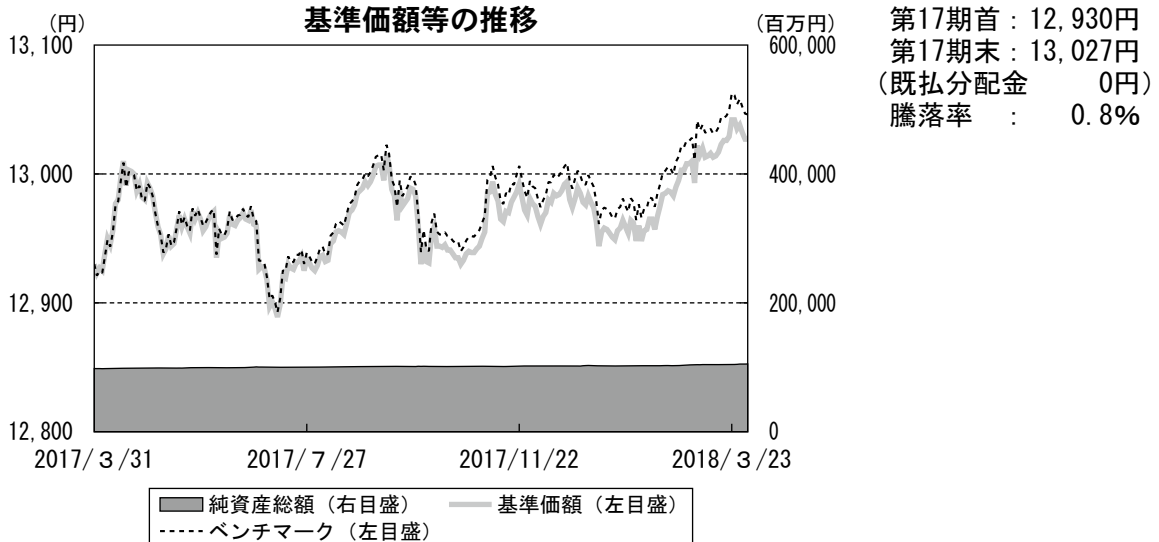
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

(第17期：2017/4/1～2018/4/2)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.9%)を0.1%下回りました。



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



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

## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続や、期末にかけての世界的な株安、円高などを背景に、国内債券市況が上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	信託報酬等のコストが基準価額の下落要因となりました。

## 投資環境について

(第17期：2017/4/1～2018/4/2)

## ◎国内債券市況

- ・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続や、期末にかけての世界的な株安、円高などを背景に、国内債券市況は上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

**i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

- ・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。
- ・尚、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等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました<sup>※</sup>。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

## (ご参考)

## 利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2017年3月31日）

期末（2018年4月2日）

最終利回り	0.1%	➔	最終利回り	0.1%
直接利回り	1.0%		直接利回り	0.9%
デュレーション	8.8年		デュレーション	9.0年

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

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連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	$\Delta 0.0\%$ 程度	$0.0\%$ 程度	$0.0\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 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。

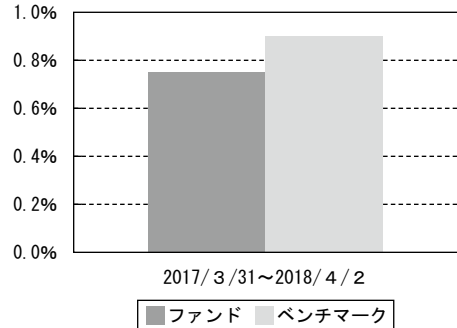
◎管理コスト等による要因  
 ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

◎組入比率要因  
 組入比率による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。  
 ・ 公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。  
 ・ ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因  
 銘柄選択による影響は $0.0\%$ 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。

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



## 分配金について

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

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 （単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第17期
	2017年4月1日～2018年4月2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	3,546

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

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

## 今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

- ・ベンチマーク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

(2017年4月1日～2018年4月2日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 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 )	(10)	(0.075)	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 )	( 6 )	(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) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) 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、12,970円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2017年4月1日～2018年4月2日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 22,216,651	千円 16,233,859
	地方債証券	775,036	362,579
	特殊債券	1,996,217	1,294,468 ( 145,795)
	社債券	1,122,043	805,820

(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。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年4月1日～2018年4月2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	
		百万円	$\frac{B}{A}$ %		百万円	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 26,109	百万円 6,200	23.7	百万円 18,696	百万円 4,051	21.7

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

## 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 710

## 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 400

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



## ○組入資産の明細

(2018年4月2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	79,820,000	86,938,322	82.7	—	53.6	19.6	9.5	
地方債証券	5,629,500	5,958,962	5.7	—	3.6	1.7	0.4	
	( 5,629,500)	( 5,958,962)	( 5.7)	(—)	( 3.6)	( 1.7)	( 0.4)	
特殊債券 (除く金融債)	6,353,309	6,751,875	6.4	—	4.3	1.7	0.4	
	( 6,353,309)	( 6,751,875)	( 6.4)	(—)	( 4.3)	( 1.7)	( 0.4)	
金融債券	670,000	670,055	0.6	—	—	0.4	0.3	
	( 670,000)	( 670,055)	( 0.6)	(—)	( —)	( 0.4)	( 0.3)	
普通社債券	4,409,000	4,537,822	4.3	—	1.3	2.0	0.9	
	( 4,409,000)	( 4,537,822)	( 4.3)	(—)	( 1.3)	( 2.0)	( 0.9)	
合 計	96,881,809	104,857,037	99.7	—	62.8	25.4	11.6	
	(17,061,809)	( 17,918,714)	(17.0)	(—)	( 9.2)	( 5.8)	( 2.1)	

(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
	%	千円	千円
国債証券			
第376回利付国債 (2年)	0.1	300,000	300,801
第377回利付国債 (2年)	0.1	300,000	300,861
第379回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,656
第380回利付国債 (2年)	0.1	100,000	100,348
第381回利付国債 (2年)	0.1	390,000	391,435
第383回利付国債 (2年)	0.1	180,000	180,734
第384回利付国債 (2年)	0.1	240,000	241,029
第385回利付国債 (2年)	0.1	1,060,000	1,064,759
第386回利付国債 (2年)	0.1	100,000	100,468
第118回利付国債 (5年)	0.2	360,000	361,440
第119回利付国債 (5年)	0.1	390,000	391,084
第120回利付国債 (5年)	0.2	830,000	834,008
第121回利付国債 (5年)	0.1	560,000	561,887
第122回利付国債 (5年)	0.1	850,000	853,349
第123回利付国債 (5年)	0.1	930,000	934,101
第124回利付国債 (5年)	0.1	1,090,000	1,095,428
第125回利付国債 (5年)	0.1	960,000	965,212
第126回利付国債 (5年)	0.1	900,000	905,382
第127回利付国債 (5年)	0.1	780,000	785,093
第128回利付国債 (5年)	0.1	810,000	815,742
第129回利付国債 (5年)	0.1	800,000	806,120
第130回利付国債 (5年)	0.1	880,000	887,048
第131回利付国債 (5年)	0.1	680,000	685,950
第132回利付国債 (5年)	0.1	670,000	676,090
第133回利付国債 (5年)	0.1	1,040,000	1,050,025
第134回利付国債 (5年)	0.1	1,120,000	1,131,670
第135回利付国債 (5年)	0.1	230,000	232,408
第1回利付国債 (40年)	2.4	77,000	111,207
第2回利付国債 (40年)	2.2	116,000	162,129
第3回利付国債 (40年)	2.2	153,000	214,900
第4回利付国債 (40年)	2.2	191,000	269,166
第5回利付国債 (40年)	2.0	175,000	237,093
第6回利付国債 (40年)	1.9	200,000	265,540
第7回利付国債 (40年)	1.7	200,000	253,808
第8回利付国債 (40年)	1.4	270,000	317,112
第9回利付国債 (40年)	0.4	350,000	297,538
第10回利付国債 (40年)	0.9	400,000	402,904
第301回利付国債 (10年)	1.5	284,000	289,631
第302回利付国債 (10年)	1.4	250,000	254,652
第303回利付国債 (10年)	1.4	750,000	766,875
第304回利付国債 (10年)	1.3	50,000	51,051
第305回利付国債 (10年)	1.3	809,000	828,852
第306回利付国債 (10年)	1.4	578,000	595,363
第307回利付国債 (10年)	1.3	210,000	215,896

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第308回利付国債 (10年)	1.3	190,000	196,023	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	610,000	626,634	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	566,000	581,729	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	360,000	368,226	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	513,000	531,421	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	706,000	735,764	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	330,000	341,952	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	222,000	231,481	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	140,000	145,528	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	183,000	190,762	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	460,000	477,912	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	347,000	362,715	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	560,000	583,273	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	328,000	342,543	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	100,000	104,036	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	504,000	525,641	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	550,000	571,290	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	835,000	869,268	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	260,000	269,973	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	560,000	584,136	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	750,000	776,355	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	860,000	900,540	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	350,000	367,199	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	250,000	259,540	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	980,000	1,018,817	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	800,000	832,816	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	990,000	1,032,015	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	610,000	632,777	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	480,000	498,451	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	490,000	502,225	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,040,000	1,073,800	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	580,000	599,105	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	910,000	940,321	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	810,000	831,303	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	800,000	808,616	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	720,000	727,401	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	970,000	979,447	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,040,000	1,049,516	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	740,000	746,290	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	740,000	745,779	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	760,000	765,738	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	900,000	906,093	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	300,000	301,785	2028/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	15,000	19,600	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	20,000	25,356	2030/2/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第3回利付国債 (30年)	2.3	29,000	36,534	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	30,000	40,300	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	21,000	26,507	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	45,000	58,290	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	59,000	75,968	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	76,000	92,894	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	43,000	50,088	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	68,000	76,279	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	55,000	66,637	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	45,000	57,265	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	71,000	89,446	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	114,000	150,918	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	118,000	158,376	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	74,000	99,461	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	88,000	117,129	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	108,000	142,169	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	78,000	102,857	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	75,000	101,536	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	102,000	134,835	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	104,000	141,184	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	83,000	112,873	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	108,000	147,119	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	108,000	143,473	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	208,000	280,319	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	132,000	180,748	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	230,000	316,059	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	200,000	271,802	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	285,000	383,045	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	259,000	344,008	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	314,000	424,571	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	357,000	461,875	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	321,000	430,281	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	366,000	476,283	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	415,000	541,811	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	377,000	485,168	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	270,000	342,189	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	270,000	348,772	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	170,000	215,774	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	210,000	261,748	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	210,000	261,882	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	260,000	324,407	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	220,000	274,637	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	270,000	324,078	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	280,000	336,137	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	260,000	318,580	2045/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第48回利付国債 (30年)	1.4	300,000	352,842	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	280,000	329,310	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	290,000	297,128	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	270,000	241,709	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	230,000	217,276	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	300,000	290,742	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	260,000	264,984	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	290,000	295,240	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	290,000	294,921	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	390,000	396,181	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	80,000	81,176	2048/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	71,000	74,153	2019/9/20
第45回利付国債 (20年)	2.4	96,000	100,769	2020/3/20
第46回利付国債 (20年)	2.2	38,000	39,968	2020/6/22
第47回利付国債 (20年)	2.2	48,000	50,760	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	49,000	52,503	2020/12/21
第50回利付国債 (20年)	1.9	134,000	142,052	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	52,000	55,556	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	47,000	50,622	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	97,000	105,332	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	110,000	119,234	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	118,000	128,505	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	106,000	115,529	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	180,000	195,386	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	60,000	63,288	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	133,000	146,236	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	147,000	163,059	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	127,000	141,470	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	50,000	55,410	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	275,000	312,540	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	190,000	219,343	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	116,000	132,342	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	195,000	222,145	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	116,000	133,462	2025/3/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	211,000	243,829	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	240,000	278,443	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	150,000	174,765	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	30,000	34,721	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	80,000	93,594	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	185,000	219,387	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	40,000	47,116	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	163,000	194,100	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	150,000	178,078	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	143,000	170,979	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	215,000	254,334	2026/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第93回利付国債 (20年)	2.0	40,000	47,124	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	78,000	92,591	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	201,000	243,246	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	100,000	119,178	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	134,000	161,590	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	110,000	131,609	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	276,000	331,326	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	213,000	258,635	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	100,000	123,409	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	189,000	234,119	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	130,000	159,714	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	90,000	108,743	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	80,000	96,968	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	268,000	327,632	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	43,000	52,281	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	200,000	238,914	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	170,000	203,610	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	232,000	282,910	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	208,000	256,709	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	160,000	195,692	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	405,000	496,797	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	160,000	196,817	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	277,000	343,942	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	199,000	247,798	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	260,000	320,691	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	201,000	246,178	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	120,000	144,087	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	100,000	117,669	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	325,000	395,063	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	80,000	96,266	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	230,000	286,124	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	250,000	307,885	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	334,000	420,769	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	90,000	111,094	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	10,000	12,216	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	231,000	282,633	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	110,000	133,166	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	328,000	397,844	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	120,000	143,974	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	222,000	266,797	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	260,000	315,941	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	181,000	220,177	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	20,000	24,057	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	120,000	142,716	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	140,000	168,667	2032/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第138回利付国債 (20年)	1.5	130,000	153,034	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	110,000	131,007	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	385,000	464,541	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	420,000	507,498	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	80,000	97,804	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	470,000	561,894	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	110,000	129,826	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	480,000	581,136	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	470,000	569,757	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	440,000	527,410	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	430,000	508,969	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	380,000	449,794	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	540,000	630,709	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	500,000	567,995	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	480,000	545,313	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	480,000	553,123	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	470,000	533,548	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	460,000	506,069	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	450,000	447,745	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	460,000	440,643	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	410,000	413,493	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	430,000	440,371	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	350,000	364,010	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	400,000	408,080	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	390,000	396,914	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	470,000	477,576	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	60,000	59,728	2038/3/20
小 計		79,820,000	86,938,322	
<b>地方債証券</b>				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	30,000	32,359	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	20,000	26,814	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	20,000	25,753	2038/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	20,000	24,129	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	20,000	24,417	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	80,000	95,610	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	30,000	36,360	2031/6/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	50,972	2019/6/20
第672回東京都公募公債	1.51	20,000	20,360	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	20,000	20,463	2019/12/20
第691回東京都公募公債	1.24	100,000	103,279	2020/12/18
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	103,577	2020/12/18
第705回東京都公募公債	1.06	30,000	31,221	2022/3/18
第719回東京都公募公債	0.86	50,000	52,057	2023/3/20
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	51,725	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	102,517	2024/12/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成26年度第15回北海道公募公債	0.434	100,000	102,361	2025/2/27
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	20,000	22,789	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	20,000	27,797	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(30年)	2.62	50,000	67,830	2037/3/19
第162回神奈川県公募公債	1.62	30,000	30,579	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	53,850	54,747	2019/6/20
第169回神奈川県公募公債	1.43	100,000	102,403	2019/12/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	22,720	23,322	2020/3/20
第209回神奈川県公募公債	0.549	100,000	103,084	2024/9/20
第348回大阪府公募公債	1.32	20,000	20,771	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	20,000	20,729	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	15,000	15,570	2022/3/29
第367回大阪府公募公債	0.73	10,000	10,328	2022/12/27
第380回大阪府公募公債	0.762	100,000	104,078	2024/1/30
第398回大阪府公募公債	0.56	150,000	154,905	2025/7/30
第408回大阪府公募公債	0.072	204,000	202,963	2026/5/29
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	84,100	87,353	2022/3/16
平成25年度第4回京都府公募公債	0.88	100,000	104,397	2023/6/19
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	10,000	13,185	2040/3/19
第3回兵庫県公募公債(30年)	0.69	100,000	94,597	2046/9/20
第7回兵庫県公募公債(15年)	1.12	100,000	108,978	2028/12/25
第15回兵庫県公募公債(20年)	1.64	100,000	116,780	2032/7/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	30,000	30,541	2019/5/22
平成25年度第7回兵庫県公募公債	0.7	100,000	103,585	2023/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	10,000	10,211	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	102,643	2020/7/22
平成27年度第5回静岡県公募公債	0.578	100,000	103,535	2025/6/20
平成22年度第19回愛知県公募公債	1.398	100,000	104,089	2021/3/30
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	60,000	62,589	2023/7/25
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	200,000	201,812	2027/2/12
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	30,630	31,747	2021/5/27
平成28年度第4回広島県公募公債	0.06	100,000	99,268	2026/11/25
平成22年度第5回埼玉県公募公債	1.08	50,000	51,257	2020/8/25
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	50,000	51,562	2024/9/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	30,000	40,738	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	20,000	25,933	2038/9/17
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	140,000	143,274	2020/10/28
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	20,000	23,732	2030/10/11
平成23年度第1回千葉県公募公債	1.19	80,000	82,914	2021/5/25
平成24年度第8回千葉県公募公債	0.84	70,000	72,725	2023/1/25
平成22年度第2回新潟県公募公債	1.29	30,800	31,924	2021/2/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	13,900	14,192	2019/8/23
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	51,116	2019/12/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	100,000	102,419	2020/8/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	103,404	2021/1/25



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	103,452	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	60,000	62,290	2022/2/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	30,000	31,167	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	30,000	31,241	2022/4/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	50,000	51,786	2022/11/25
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	100,000	103,123	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,844	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	100,000	101,795	2025/1/24
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	100,000	103,321	2025/5/23
第151回共同発行市場公募地方債	0.466	100,000	102,669	2025/10/24
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	20,000	20,507	2019/11/25
平成23年度第4回大阪市公募公債	1.178	60,000	62,272	2021/7/22
平成23年度第8回大阪市公募公債	1.015	20,000	20,713	2021/11/17
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	106,799	2025/6/20
第9回名古屋市公募公債(30年)	2.095	10,000	12,846	2042/9/19
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	20,000	24,459	2029/8/17
第485回名古屋市公募公債	0.67	100,000	103,514	2023/12/8
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	59,522	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	70,000	83,809	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	20,000	24,417	2031/1/24
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	114,995	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	50,000	57,480	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	20,000	23,874	2028/12/20
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	20,000	24,139	2029/10/19
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	20,000	26,148	2040/9/20
平成26年度第2回福岡市公募公債(20年)	1.49	100,000	115,630	2034/6/20
平成24年度第2回千葉市公募公債	0.81	50,000	51,806	2022/11/22
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	17,500	17,977	2020/11/30
平成28年度第4回福井県公募公債	0.2	160,000	160,542	2027/4/27
平成21年度第1回徳島県公募公債	1.55	17,000	17,428	2019/11/29
小 計		5,629,500	5,958,962	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
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	109,918	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	23,457	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	20,427	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	15,365	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	51,305	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	120,853	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	62,023	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	69,394	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	103,760	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	21,738	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	37,326	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	13,473	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	120,274	2022/3/18

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	119,774	2032/3/19
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	72,889	2023/2/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	41,000	42,167	2023/4/28
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	28,904	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	34,628	2023/7/31
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	103,832	2024/3/29
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	200,000	208,004	2024/4/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.557	100,000	103,777	2025/7/31
第279回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	143,000	142,296	2026/6/30
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	101,835	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	13,237	2019/7/12
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	15,000	15,261	2019/5/24
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	104,000	107,036	2020/6/12
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	102,589	2020/7/17
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	207,000	214,563	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	60,000	62,509	2021/12/14
第33回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	102,000	105,677	2022/2/15
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	22,000	22,756	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	52,281	2023/8/14
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	103,928	2024/6/14
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	100,000	99,720	2026/3/13
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	16,000	16,629	2023/10/20
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	80,000	83,189	2023/12/18
第41回政府保証日本政策投資銀行	0.09	100,000	99,812	2027/9/15
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	57,877	2025/12/19
第17回道路債券(財投機関債)	1.54	50,000	53,467	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	14,637	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	43,293	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	48,018	2027/7/20
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	68,275	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	14,860	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	36,506	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	59,994	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	103,403	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	207,780	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	60,849	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	20,364	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	10,000	10,480	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	101,812	2019/5/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	57,159	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	24,608	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	23,785	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	51,709	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	58,589	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	32,394	2023/3/17

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	103,552	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	113,017	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	34,480	2031/7/30
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)		2.18	100,000	114,272	2025/3/21
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	20,000	24,299	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	20,000	23,817	2030/10/29
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	100,000	100,695	2027/2/22
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.27	17,793	18,957	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	18,469	19,573	2042/8/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	15,982	16,911	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	16,826	17,817	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	23,444	24,230	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	23,809	24,662	2032/11/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	18,690	19,419	2040/7/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	18,189	19,016	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	17,573	18,340	2041/2/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	50,263	53,257	2045/12/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	39,389	41,841	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	39,793	42,128	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	43,259	45,824	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	19,246	20,468	2042/3/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.47	51,007	53,815	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	102,485	2020/9/18
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	53,511	56,430	2047/4/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.3	61,873	65,156	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	24,314	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	53,418	55,889	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	79,027	2026/6/19
第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.93	65,995	68,277	2049/9/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	68,593	71,062	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	69,295	71,475	2049/11/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	82,869	85,452	2050/9/10
第108回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.434	100,000	111,212	2027/6/18
第117回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.438	100,000	111,442	2027/9/17
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	96,283	97,118	2052/3/10
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	59,753	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	26,160	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	194,912	196,009	2052/7/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	99,828	100,424	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	100,000	100,278	2053/3/10
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	30,000	36,187	2031/6/13
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	103,462	2022/3/18
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	100,919	2021/12/20
第25回西日本高速道路		0.524	100,000	102,453	2024/12/20
小	計		6,353,309	6,751,875	

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
い第778号農林債券	0.25	100,000	100,417	2020/3/27
第295回信金中金債	0.25	170,000	170,440	2019/6/27
第318回信金中金債	0.04	200,000	199,620	2021/5/27
第329回信金中金債	0.06	100,000	99,757	2022/4/27
第209号商工債券(3年)	0.04	100,000	99,821	2020/6/26
小 計		670,000	670,055	
<b>普通社債券</b>				
第490回中部電力	1.444	30,000	30,554	2019/7/25
第507回中部電力	0.605	200,000	204,606	2026/1/23
第381回中国電力	0.953	110,000	114,651	2024/4/25
第297回北陸電力	0.976	80,000	81,851	2020/10/23
第471回東北電力	1.168	102,000	107,260	2023/12/25
第281回四国電力	1.111	100,000	104,909	2023/9/25
第400回九州電力	1.777	30,000	31,063	2020/4/24
第437回九州電力	0.685	100,000	102,639	2026/1/23
第310回北海道電力	1.286	50,000	51,573	2020/12/25
第312回北海道電力	1.155	100,000	104,224	2022/10/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	102,378	2020/6/25
第19回沖縄電力	1.452	20,000	20,579	2020/4/24
第346回東京交通債券	1.13	130,000	136,877	2023/6/20
第38回関西国際空港	1.112	50,000	51,949	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	40,000	41,420	2021/9/17
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,731	2021/6/18
第4回トヨタ紡織	0.21	100,000	99,896	2024/12/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	100,000	101,168	2022/6/20
第1回リクルートホールディングス	0.09	100,000	99,906	2022/3/9
第5回日本電産	0.001	100,000	99,863	2019/11/25
第12回デンソー	0.01	100,000	99,620	2021/9/17
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	100,263	2018/8/3
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,284	2019/8/5
第78回三菱商事	1.155	100,000	103,813	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	102,781	2019/6/3
第25回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.31	100,000	102,979	2020/11/12
第6回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.9	100,000	103,393	2020/3/2
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	104,457	2021/4/28
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	102,734	2019/7/24
第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	105,609	2022/2/24
第69回日立キャピタル	0.08	100,000	99,948	2020/12/18
第38回三菱UFJリース	0.16	100,000	99,973	2021/4/21
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,829	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	100,000	99,625	2021/7/23
第50回野村ホールディングス	0.22	100,000	99,981	2022/8/10
第116回三菱地所	0.643	100,000	102,562	2024/9/19
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,039	2027/9/17
第38回京王電鉄	0.295	100,000	99,899	2027/11/29

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第13回東日本旅客鉄道	2.6	37,000	38,810	2020/2/25
第49回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	118,218	2027/4/16
第19回西日本旅客鉄道	2.376	100,000	122,078	2028/12/11
第7回東海旅客鉄道	2.2	30,000	32,608	2022/5/10
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	105,002	2022/12/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,559	2023/3/20
第37回電源開発	1.035	100,000	102,993	2021/7/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,237	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,173	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	100,254	2019/5/2
小 計		4,409,000	4,537,822	
合 計		96,881,809	104,857,037	

## ○投資信託財産の構成

(2018年4月2日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 104,857,037	% 99.0
コール・ローン等、その他	1,071,388	1.0
投資信託財産総額	105,928,425	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年4月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	105,928,425,037
コール・ローン等	932,420,313
公社債(評価額)	104,857,037,606
未収利息	135,672,256
前払費用	3,294,862
(B) 負債	804,868,571
未払金	664,936,700
未払解約金	49,292,794
未払信託報酬	89,187,855
未払利息	1,975
その他未払費用	1,449,247
(C) 純資産総額(A-B)	105,123,556,466
元本	80,693,618,311
次期繰越損益金	24,429,938,155
(D) 受益権総口数	80,693,618,311口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,027円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 75,787,113,438円  
 期中追加設定元本額 13,632,369,693円  
 期中一部解約元本額 8,725,864,820円  
 また、1口当たり純資産額は、期末13,027円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2017年4月1日～ 2018年4月2日
費用控除後の配当等収益額	720,275,126円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	19,122,229,586円
分配準備積立金額	8,774,095,939円
当ファンドの分配対象収益額	28,616,600,651円
1万口当たり収益分配対象額	3,546円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

## ○損益の状況 (2017年4月1日～2018年4月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	898,794,390
受取利息	899,062,922
その他収益金	33,985
支払利息	△ 302,517
(B) 有価証券売買損益	△ 6,325,578
売買益	509,369,191
売買損	△ 515,694,769
(C) 信託報酬等	△ 178,519,264
(D) 当期損益金(A+B+C)	713,949,548
(E) 前期繰越損益金	6,907,819,323
(F) 追加信託差損益金	16,808,169,284
(配当等相当額)	( 19,122,229,586)
(売買損益相当額)	(△ 2,314,060,302)
(G) 計(D+E+F)	24,429,938,155
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	24,429,938,155
追加信託差損益金	16,808,169,284
(配当等相当額)	( 19,122,229,586)
(売買損益相当額)	(△ 2,314,060,302)
分配準備積立金	9,494,371,065
繰越損益金	△ 1,872,602,194

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

【お 知 ら せ】

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