

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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div> |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC国内債券 インデックスファンド

第21期（決算日：2022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21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) | 税 達 分 配 | | 期 騰 落 率 | | NOMURA-BPI総合 期 騰 落 率 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------|---------------|---------|---|---------|--------|-------------------------|------|----------------|----------------|--------------|
| | | 円 | % | 円 | % | 円 | % | | | |
| 17期(2018年4月2日) | 13,027 | 円 | 0 | 0.8 | 381.89 | 0.9 | 99.7 | — | 105,123 | |
| 18期(2019年4月1日) | 13,233 | 円 | 0 | 1.6 | 388.52 | 1.7 | 99.6 | — | 112,836 | |
| 19期(2020年3月31日) | 13,208 | 円 | 0 | △0.2 | 388.45 | △0.0 | 99.6 | — | 119,048 | |
| 20期(2021年3月31日) | 13,093 | 円 | 0 | △0.9 | 385.72 | △0.7 | 99.7 | — | 121,325 | |
| 21期(2022年3月31日) | 12,913 | 円 | 0 | △1.4 | 381.04 | △1.2 | 99.8 | — | 119,354 | |

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(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 騰 落 率 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|--------------------|--------|-------|------|-----------------------|------|----------------|----------------|
| | | 円 | % | 円 | % | | |
| (期首) 2021年3月31日 | 13,093 | 円 | — | 385.72 | — | 99.7 | — |
| 4月末 | 13,115 | 円 | 0.2 | 386.44 | 0.2 | 99.7 | — |
| 5月末 | 13,119 | 円 | 0.2 | 386.62 | 0.2 | 99.6 | — |
| 6月末 | 13,125 | 円 | 0.2 | 386.90 | 0.3 | 99.7 | — |
| 7月末 | 13,189 | 円 | 0.7 | 388.81 | 0.8 | 99.7 | — |
| 8月末 | 13,176 | 円 | 0.6 | 388.46 | 0.7 | 99.6 | — |
| 9月末 | 13,129 | 円 | 0.3 | 387.12 | 0.4 | 99.8 | — |
| 10月末 | 13,113 | 円 | 0.2 | 386.72 | 0.3 | 99.7 | — |
| 11月末 | 13,143 | 円 | 0.4 | 387.65 | 0.5 | 99.6 | — |
| 12月末 | 13,112 | 円 | 0.1 | 386.84 | 0.3 | 99.7 | — |
| 2022年1月末 | 13,017 | 円 | △0.6 | 384.06 | △0.4 | 99.7 | — |
| 2月末 | 12,950 | 円 | △1.1 | 382.13 | △0.9 | 100.2 | — |
| (期末) 2022年3月31日 | 12,913 | 円 | △1.4 | 381.04 | △1.2 | 99.8 | — |

(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

第21期：2021年4月1日～2022年3月31日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|---------|
| 第21期首 | 13,093円 |
| 第21期末 | 12,913円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | -1.4% |

※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、ファンドの購入価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。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.4%の下落となりました。

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（-1.2%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第21期：2021年4月1日～2022年3月31日

投資環境について

国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

国内債券市況は期の前半から2021年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市

況は下落しました。期末にかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

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。ベンチマークの構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グ

ループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは1.2%の下落になったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

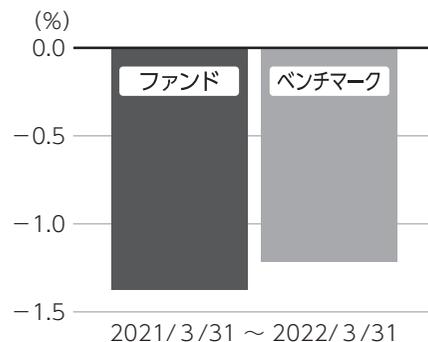
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因*によるものです。

*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

主なマイナス要因：信託報酬要因によるものです。

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



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21期 2021年4月1日～2022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 | 3,886 |

(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。）

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年4月1日～2022年3月31日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 23 | 0.176 | (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) | (0.055) | 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) | (0.077) | 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) | (0.044) | 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 | 23 | 0.179 | |

期中の平均基準価額は、13,100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。

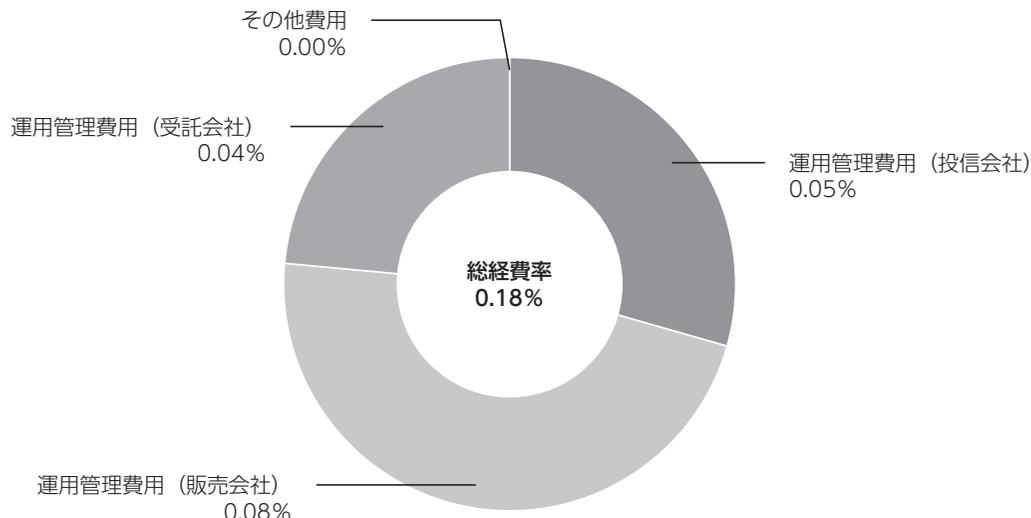
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.18%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年4月1日～2022年3月31日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|-------|------------|-------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 28,758,788 | 29,405,611 |
| | 地方債証券 | 3,214,845 | 1,799,569 (265,000) |
| 内 | 特殊債券 | 599,406 | 1,326,701 (149,385) |
| | 社債券 | 3,706,312 | 2,907,868 (40,000) |

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年4月1日～2022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 36,279 | 百万円 10,621 | % 29.3 | 百万円 35,439 | 百万円 9,042 | % 25.5 |

(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 |
|-----|-----|-----|--------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 公社債 | 100 | — | 310 |

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 |
|-----|-------|
| | 百万円 |
| 公社債 | 2,600 |

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

○組入資産の明細

(2022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 | 94,889,000 | 99,079,533 | 83.0 | — | 57.5 | 17.7 | 7.8 | |
| 地方債証券 | 7,320,000 | 7,631,951 | 6.4 | — | 2.4 | 2.6 | 1.4 | |
| | (7,320,000) | (7,631,951) | (6.4) | (—) | (2.4) | (2.6) | (1.4) | |
| 特殊債券 (除く金融債) | 5,246,097 | 5,441,520 | 4.6 | — | 2.4 | 1.5 | 0.7 | |
| | (5,246,097) | (5,441,520) | (4.6) | (—) | (2.4) | (1.5) | (0.7) | |
| 金融債券 | 300,000 | 302,846 | 0.3 | — | — | 0.2 | 0.1 | |
| | (300,000) | (302,846) | (0.3) | (—) | (—) | (0.2) | (0.1) | |
| 普通社債券 | 6,569,000 | 6,607,208 | 5.5 | — | 1.5 | 3.1 | 0.9 | |
| | (6,569,000) | (6,607,208) | (5.5) | (—) | (1.5) | (3.1) | (0.9) | |
| 合 計 | 114,324,097 | 119,063,059 | 99.8 | — | 63.9 | 25.0 | 10.9 | |
| | (19,435,097) | (19,983,526) | (16.7) | (—) | (6.4) | (7.3) | (3.1) | |

(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 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第424回利付国債 (2年) | 0.005 | 320,000 | 320,259 | 2023/5/1 |
| 第425回利付国債 (2年) | 0.005 | 300,000 | 300,261 | 2023/6/1 |
| 第426回利付国債 (2年) | 0.005 | 200,000 | 200,186 | 2023/7/1 |
| 第429回利付国債 (2年) | 0.005 | 30,000 | 30,029 | 2023/10/1 |
| 第430回利付国債 (2年) | 0.005 | 450,000 | 450,463 | 2023/11/1 |
| 第431回利付国債 (2年) | 0.005 | 500,000 | 500,500 | 2023/12/1 |
| 第432回利付国債 (2年) | 0.005 | 70,000 | 70,067 | 2024/1/1 |
| 第433回利付国債 (2年) | 0.005 | 680,000 | 680,618 | 2024/2/1 |
| 第136回利付国債 (5年) | 0.1 | 810,000 | 811,676 | 2023/6/20 |
| 第137回利付国債 (5年) | 0.1 | 940,000 | 942,209 | 2023/9/20 |
| 第138回利付国債 (5年) | 0.1 | 760,000 | 761,960 | 2023/12/20 |
| 第139回利付国債 (5年) | 0.1 | 220,000 | 220,605 | 2024/3/20 |
| 第140回利付国債 (5年) | 0.1 | 430,000 | 431,333 | 2024/6/20 |
| 第141回利付国債 (5年) | 0.1 | 740,000 | 742,464 | 2024/9/20 |
| 第142回利付国債 (5年) | 0.1 | 350,000 | 351,284 | 2024/12/20 |
| 第143回利付国債 (5年) | 0.1 | 960,000 | 963,840 | 2025/3/20 |
| 第144回利付国債 (5年) | 0.1 | 1,300,000 | 1,305,434 | 2025/6/20 |
| 第145回利付国債 (5年) | 0.1 | 700,000 | 702,912 | 2025/9/20 |
| 第146回利付国債 (5年) | 0.1 | 670,000 | 672,867 | 2025/12/20 |
| 第147回利付国債 (5年) | 0.005 | 130,000 | 130,050 | 2026/3/20 |
| 第148回利付国債 (5年) | 0.005 | 350,000 | 350,000 | 2026/6/20 |
| 第149回利付国債 (5年) | 0.005 | 1,320,000 | 1,319,406 | 2026/9/20 |
| 第150回利付国債 (5年) | 0.005 | 1,270,000 | 1,268,793 | 2026/12/20 |
| 第1回利付国債 (40年) | 2.4 | 77,000 | 104,840 | 2048/3/20 |
| 第2回利付国債 (40年) | 2.2 | 116,000 | 152,529 | 2049/3/20 |
| 第3回利付国債 (40年) | 2.2 | 153,000 | 202,414 | 2050/3/20 |
| 第4回利付国債 (40年) | 2.2 | 191,000 | 254,182 | 2051/3/20 |
| 第5回利付国債 (40年) | 2.0 | 215,000 | 276,361 | 2052/3/20 |
| 第6回利付国債 (40年) | 1.9 | 230,000 | 291,343 | 2053/3/20 |
| 第7回利付国債 (40年) | 1.7 | 240,000 | 292,380 | 2054/3/20 |
| 第8回利付国債 (40年) | 1.4 | 310,000 | 352,541 | 2055/3/20 |
| 第9回利付国債 (40年) | 0.4 | 400,000 | 339,576 | 2056/3/20 |
| 第10回利付国債 (40年) | 0.9 | 420,000 | 417,223 | 2057/3/20 |
| 第11回利付国債 (40年) | 0.8 | 450,000 | 433,062 | 2058/3/20 |
| 第12回利付国債 (40年) | 0.5 | 210,000 | 181,906 | 2059/3/20 |
| 第13回利付国債 (40年) | 0.5 | 440,000 | 379,456 | 2060/3/20 |
| 第14回利付国債 (40年) | 0.7 | 400,000 | 368,936 | 2061/3/20 |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8 | 760,000 | 768,063 | 2023/6/20 |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8 | 460,000 | 465,823 | 2023/9/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 250,000 | 252,427 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 880,000 | 889,847 | 2023/12/20 |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6 | 900,000 | 911,331 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6 | 940,000 | 953,357 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5 | 660,000 | 668,731 | 2024/9/20 |

| 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336回利付国債 (10年) | 0.5 | 270,000 | 273,931 | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3 | 630,000 | 635,745 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4 | 1,100,000 | 1,114,212 | 2025/3/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 510,000 | 517,063 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 1,160,000 | 1,176,912 | 2025/9/20 |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3 | 780,000 | 789,141 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1 | 710,000 | 712,953 | 2026/3/20 |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1 | 830,000 | 833,320 | 2026/6/20 |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,430,000 | 1,435,419 | 2026/9/20 |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1 | 790,000 | 792,788 | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1 | 470,000 | 471,630 | 2027/3/20 |
| 第347回利付国債 (10年) | 0.1 | 810,000 | 812,527 | 2027/6/20 |
| 第348回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,100,000 | 1,103,300 | 2027/9/20 |
| 第349回利付国債 (10年) | 0.1 | 910,000 | 912,329 | 2027/12/20 |
| 第350回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,310,000 | 1,312,724 | 2028/3/20 |
| 第351回利付国債 (10年) | 0.1 | 750,000 | 751,155 | 2028/6/20 |
| 第352回利付国債 (10年) | 0.1 | 700,000 | 700,672 | 2028/9/20 |
| 第353回利付国債 (10年) | 0.1 | 940,000 | 940,310 | 2028/12/20 |
| 第354回利付国債 (10年) | 0.1 | 960,000 | 960,000 | 2029/3/20 |
| 第355回利付国債 (10年) | 0.1 | 950,000 | 948,974 | 2029/6/20 |
| 第356回利付国債 (10年) | 0.1 | 980,000 | 978,177 | 2029/9/20 |
| 第357回利付国債 (10年) | 0.1 | 840,000 | 837,748 | 2029/12/20 |
| 第358回利付国債 (10年) | 0.1 | 810,000 | 807,124 | 2030/3/20 |
| 第359回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,200,000 | 1,194,636 | 2030/6/20 |
| 第360回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,220,000 | 1,213,363 | 2030/9/20 |
| 第361回利付国債 (10年) | 0.1 | 920,000 | 914,066 | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,070,000 | 1,061,975 | 2031/3/20 |
| 第363回利付国債 (10年) | 0.1 | 710,000 | 703,886 | 2031/6/20 |
| 第364回利付国債 (10年) | 0.1 | 900,000 | 891,216 | 2031/9/20 |
| 第365回利付国債 (10年) | 0.1 | 810,000 | 801,511 | 2031/12/20 |
| 第1回利付国債 (30年) | 2.8 | 15,000 | 17,983 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 20,000 | 23,545 | 2030/2/20 |
| 第3回利付国債 (30年) | 2.3 | 29,000 | 34,037 | 2030/5/20 |
| 第4回利付国債 (30年) | 2.9 | 30,000 | 37,019 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債 (30年) | 2.2 | 21,000 | 24,823 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債 (30年) | 2.4 | 45,000 | 54,412 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債 (30年) | 2.3 | 59,000 | 71,271 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債 (30年) | 1.8 | 76,000 | 88,396 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債 (30年) | 1.4 | 43,000 | 48,212 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債 (30年) | 1.1 | 68,000 | 74,169 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債 (30年) | 1.7 | 55,000 | 63,668 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債 (30年) | 2.1 | 45,000 | 54,222 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債 (30年) | 2.0 | 71,000 | 84,906 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債 (30年) | 2.4 | 114,000 | 141,983 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債 (30年) | 2.5 | 118,000 | 148,861 | 2034/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第16回利付国債 (30年) | 2.5 | 74,000 | 93,570 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債 (30年) | 2.4 | 88,000 | 110,507 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債 (30年) | 2.3 | 108,000 | 134,539 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債 (30年) | 2.3 | 78,000 | 97,340 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債 (30年) | 2.5 | 75,000 | 95,805 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債 (30年) | 2.3 | 102,000 | 127,871 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債 (30年) | 2.5 | 104,000 | 133,507 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債 (30年) | 2.5 | 83,000 | 106,737 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債 (30年) | 2.5 | 108,000 | 139,215 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債 (30年) | 2.3 | 108,000 | 136,431 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債 (30年) | 2.4 | 208,000 | 266,368 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債 (30年) | 2.5 | 132,000 | 171,511 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債 (30年) | 2.5 | 230,000 | 300,014 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債 (30年) | 2.4 | 200,000 | 258,614 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債 (30年) | 2.3 | 285,000 | 364,663 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債 (30年) | 2.2 | 259,000 | 327,899 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債 (30年) | 2.3 | 314,000 | 403,518 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債 (30年) | 2.0 | 397,000 | 490,235 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | 2.2 | 401,000 | 510,256 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債 (30年) | 2.0 | 406,000 | 503,338 | 2041/9/20 |
| 第36回利付国債 (30年) | 2.0 | 445,000 | 553,126 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債 (30年) | 1.9 | 407,000 | 499,364 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債 (30年) | 1.8 | 260,000 | 314,589 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債 (30年) | 1.9 | 310,000 | 381,544 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債 (30年) | 1.8 | 250,000 | 303,027 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債 (30年) | 1.7 | 190,000 | 226,675 | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債 (30年) | 1.7 | 210,000 | 250,698 | 2044/3/20 |
| 第43回利付国債 (30年) | 1.7 | 260,000 | 310,590 | 2044/6/20 |
| 第44回利付国債 (30年) | 1.7 | 320,000 | 382,505 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債 (30年) | 1.5 | 220,000 | 253,754 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債 (30年) | 1.5 | 320,000 | 369,190 | 2045/3/20 |
| 第47回利付国債 (30年) | 1.6 | 350,000 | 411,271 | 2045/6/20 |
| 第48回利付国債 (30年) | 1.4 | 350,000 | 396,193 | 2045/9/20 |
| 第49回利付国債 (30年) | 1.4 | 320,000 | 362,249 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | 0.8 | 300,000 | 300,300 | 2046/3/20 |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3 | 240,000 | 213,487 | 2046/6/20 |
| 第52回利付国債 (30年) | 0.5 | 300,000 | 279,579 | 2046/9/20 |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6 | 290,000 | 276,317 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | 0.8 | 270,000 | 268,879 | 2047/3/20 |
| 第55回利付国債 (30年) | 0.8 | 260,000 | 258,642 | 2047/6/20 |
| 第56回利付国債 (30年) | 0.8 | 380,000 | 377,203 | 2047/9/20 |
| 第57回利付国債 (30年) | 0.8 | 220,000 | 217,907 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債 (30年) | 0.8 | 520,000 | 514,467 | 2048/3/20 |
| 第59回利付国債 (30年) | 0.7 | 270,000 | 260,199 | 2048/6/20 |
| 第60回利付国債 (30年) | 0.9 | 280,000 | 282,413 | 2048/9/20 |

| 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61回利付国債 (30年) | 0.7 | 260,000 | 249,334 | 2048/12/20 |
| 第62回利付国債 (30年) | 0.5 | 230,000 | 208,902 | 2049/3/20 |
| 第63回利付国債 (30年) | 0.4 | 370,000 | 325,988 | 2049/6/20 |
| 第64回利付国債 (30年) | 0.4 | 260,000 | 228,597 | 2049/9/20 |
| 第65回利付国債 (30年) | 0.4 | 270,000 | 237,154 | 2049/12/20 |
| 第66回利付国債 (30年) | 0.4 | 250,000 | 219,615 | 2050/3/20 |
| 第67回利付国債 (30年) | 0.6 | 410,000 | 379,332 | 2050/6/20 |
| 第68回利付国債 (30年) | 0.6 | 280,000 | 258,907 | 2050/9/20 |
| 第69回利付国債 (30年) | 0.7 | 330,000 | 313,506 | 2050/12/20 |
| 第70回利付国債 (30年) | 0.7 | 370,000 | 350,978 | 2051/3/20 |
| 第71回利付国債 (30年) | 0.7 | 300,000 | 284,472 | 2051/6/20 |
| 第72回利付国債 (30年) | 0.7 | 340,000 | 321,908 | 2051/9/20 |
| 第73回利付国債 (30年) | 0.7 | 300,000 | 283,932 | 2051/12/20 |
| 第63回利付国債 (20年) | 1.8 | 133,000 | 136,033 | 2023/6/20 |
| 第64回利付国債 (20年) | 1.9 | 147,000 | 151,242 | 2023/9/20 |
| 第65回利付国債 (20年) | 1.9 | 127,000 | 131,263 | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債 (20年) | 1.8 | 50,000 | 51,592 | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債 (20年) | 2.2 | 275,000 | 287,124 | 2024/3/20 |
| 第70回利付国債 (20年) | 2.4 | 190,000 | 200,273 | 2024/6/20 |
| 第72回利付国債 (20年) | 2.1 | 116,000 | 122,124 | 2024/9/20 |
| 第73回利付国債 (20年) | 2.0 | 195,000 | 205,804 | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債 (20年) | 2.1 | 116,000 | 123,355 | 2025/3/20 |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1 | 211,000 | 225,480 | 2025/6/20 |
| 第82回利付国債 (20年) | 2.1 | 240,000 | 257,673 | 2025/9/20 |
| 第83回利付国債 (20年) | 2.1 | 150,000 | 161,809 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) | 2.0 | 30,000 | 32,250 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年) | 2.1 | 80,000 | 86,681 | 2026/3/20 |
| 第86回利付国債 (20年) | 2.3 | 185,000 | 201,920 | 2026/3/20 |
| 第87回利付国債 (20年) | 2.2 | 40,000 | 43,499 | 2026/3/20 |
| 第88回利付国債 (20年) | 2.3 | 163,000 | 178,778 | 2026/6/20 |
| 第90回利付国債 (20年) | 2.2 | 150,000 | 164,644 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 143,000 | 157,598 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債 (20年) | 2.1 | 215,000 | 236,033 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債 (20年) | 2.0 | 40,000 | 43,908 | 2027/3/20 |
| 第94回利付国債 (20年) | 2.1 | 78,000 | 86,007 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債 (20年) | 2.3 | 201,000 | 224,657 | 2027/6/20 |
| 第96回利付国債 (20年) | 2.1 | 100,000 | 110,729 | 2027/6/20 |
| 第97回利付国債 (20年) | 2.2 | 134,000 | 149,759 | 2027/9/20 |
| 第98回利付国債 (20年) | 2.1 | 110,000 | 122,336 | 2027/9/20 |
| 第99回利付国債 (20年) | 2.1 | 276,000 | 308,272 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2 | 213,000 | 240,102 | 2028/3/20 |
| 第101回利付国債 (20年) | 2.4 | 100,000 | 113,913 | 2028/3/20 |
| 第102回利付国債 (20年) | 2.4 | 189,000 | 216,267 | 2028/6/20 |
| 第103回利付国債 (20年) | 2.3 | 130,000 | 147,950 | 2028/6/20 |
| 第104回利付国債 (20年) | 2.1 | 90,000 | 101,313 | 2028/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第105回利付国債 (20年) | 2.1 | 80,000 | 90,403 | 2028/9/20 |
| 第106回利付国債 (20年) | 2.2 | 338,000 | 384,130 | 2028/9/20 |
| 第107回利付国債 (20年) | 2.1 | 43,000 | 48,773 | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9 | 200,000 | 224,182 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) | 1.9 | 170,000 | 191,236 | 2029/3/20 |
| 第110回利付国債 (20年) | 2.1 | 232,000 | 264,194 | 2029/3/20 |
| 第111回利付国債 (20年) | 2.2 | 208,000 | 239,135 | 2029/6/20 |
| 第112回利付国債 (20年) | 2.1 | 160,000 | 182,803 | 2029/6/20 |
| 第113回利付国債 (20年) | 2.1 | 405,000 | 464,551 | 2029/9/20 |
| 第115回利付国債 (20年) | 2.2 | 477,000 | 552,685 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) | 2.2 | 199,000 | 231,391 | 2030/3/20 |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1 | 260,000 | 300,268 | 2030/3/20 |
| 第118回利付国債 (20年) | 2.0 | 191,000 | 219,777 | 2030/6/20 |
| 第119回利付国債 (20年) | 1.8 | 120,000 | 136,130 | 2030/6/20 |
| 第120回利付国債 (20年) | 1.6 | 100,000 | 111,818 | 2030/6/20 |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9 | 325,000 | 372,417 | 2030/9/20 |
| 第122回利付国債 (20年) | 1.8 | 80,000 | 91,003 | 2030/9/20 |
| 第123回利付国債 (20年) | 2.1 | 100,000 | 116,634 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0 | 390,000 | 451,522 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2 | 604,000 | 712,291 | 2031/3/20 |
| 第126回利付国債 (20年) | 2.0 | 10,000 | 11,616 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9 | 20,000 | 23,056 | 2031/3/20 |
| 第128回利付国債 (20年) | 1.9 | 381,000 | 440,428 | 2031/6/20 |
| 第129回利付国債 (20年) | 1.8 | 110,000 | 126,160 | 2031/6/20 |
| 第130回利付国債 (20年) | 1.8 | 308,000 | 354,135 | 2031/9/20 |
| 第131回利付国債 (20年) | 1.7 | 120,000 | 136,857 | 2031/9/20 |
| 第132回利付国債 (20年) | 1.7 | 222,000 | 253,872 | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年) | 1.8 | 340,000 | 392,057 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年) | 1.8 | 531,000 | 613,724 | 2032/3/20 |
| 第137回利付国債 (20年) | 1.7 | 230,000 | 264,152 | 2032/6/20 |
| 第138回利付国債 (20年) | 1.5 | 20,000 | 22,569 | 2032/6/20 |
| 第139回利付国債 (20年) | 1.6 | 50,000 | 56,924 | 2032/6/20 |
| 第140回利付国債 (20年) | 1.7 | 495,000 | 569,690 | 2032/9/20 |
| 第141回利付国債 (20年) | 1.7 | 450,000 | 518,935 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) | 1.8 | 90,000 | 104,728 | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債 (20年) | 1.6 | 580,000 | 663,931 | 2033/3/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | 1.5 | 60,000 | 68,041 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | 1.7 | 550,000 | 636,680 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | 1.7 | 570,000 | 661,057 | 2033/9/20 |
| 第147回利付国債 (20年) | 1.6 | 620,000 | 712,869 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | 1.5 | 460,000 | 524,372 | 2034/3/20 |
| 第149回利付国債 (20年) | 1.5 | 410,000 | 467,990 | 2034/6/20 |
| 第150回利付国債 (20年) | 1.4 | 630,000 | 712,019 | 2034/9/20 |
| 第151回利付国債 (20年) | 1.2 | 620,000 | 685,850 | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | 1.2 | 450,000 | 497,754 | 2035/3/20 |

| 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153回利付国債 (20年) | 1.3 | 580,000 | 649,205 | 2035/6/20 |
| 第154回利付国債 (20年) | 1.2 | 520,000 | 575,380 | 2035/9/20 |
| 第155回利付国債 (20年) | 1.0 | 500,000 | 540,070 | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債 (20年) | 0.4 | 390,000 | 389,481 | 2036/3/20 |
| 第157回利付国債 (20年) | 0.2 | 550,000 | 533,049 | 2036/6/20 |
| 第158回利付国債 (20年) | 0.5 | 640,000 | 645,657 | 2036/9/20 |
| 第159回利付国債 (20年) | 0.6 | 450,000 | 459,634 | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債 (20年) | 0.7 | 380,000 | 393,319 | 2037/3/20 |
| 第161回利付国債 (20年) | 0.6 | 460,000 | 468,491 | 2037/6/20 |
| 第162回利付国債 (20年) | 0.6 | 420,000 | 426,951 | 2037/9/20 |
| 第163回利付国債 (20年) | 0.6 | 470,000 | 477,195 | 2037/12/20 |
| 第164回利付国債 (20年) | 0.5 | 580,000 | 578,712 | 2038/3/20 |
| 第165回利付国債 (20年) | 0.5 | 540,000 | 537,980 | 2038/6/20 |
| 第166回利付国債 (20年) | 0.7 | 330,000 | 338,497 | 2038/9/20 |
| 第167回利付国債 (20年) | 0.5 | 370,000 | 366,884 | 2038/12/20 |
| 第168回利付国債 (20年) | 0.4 | 500,000 | 486,470 | 2039/3/20 |
| 第169回利付国債 (20年) | 0.3 | 340,000 | 324,332 | 2039/6/20 |
| 第170回利付国債 (20年) | 0.3 | 460,000 | 437,483 | 2039/9/20 |
| 第171回利付国債 (20年) | 0.3 | 350,000 | 331,852 | 2039/12/20 |
| 第172回利付国債 (20年) | 0.4 | 380,000 | 365,598 | 2040/3/20 |
| 第173回利付国債 (20年) | 0.4 | 530,000 | 508,413 | 2040/6/20 |
| 第174回利付国債 (20年) | 0.4 | 440,000 | 420,816 | 2040/9/20 |
| 第175回利付国債 (20年) | 0.5 | 410,000 | 398,405 | 2040/12/20 |
| 第176回利付国債 (20年) | 0.5 | 410,000 | 397,597 | 2041/3/20 |
| 第177回利付国債 (20年) | 0.4 | 510,000 | 484,902 | 2041/6/20 |
| 第178回利付国債 (20年) | 0.5 | 390,000 | 376,954 | 2041/9/20 |
| 第179回利付国債 (20年) | 0.5 | 510,000 | 492,323 | 2041/12/20 |
| 小 計 | | 94,889,000 | 99,079,533 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 第1回東京都公募公債 (20年) | 1.54 | 30,000 | 30,560 | 2023/6/20 |
| 第7回東京都公募公債 (30年) | 2.51 | 20,000 | 25,952 | 2038/9/17 |
| 第8回東京都公募公債 (30年) | 2.23 | 20,000 | 25,071 | 2038/9/17 |
| 第20回東京都公募公債 (20年) | 2.09 | 120,000 | 136,532 | 2029/9/20 |
| 第21回東京都公募公債 (20年) | 2.19 | 120,000 | 137,892 | 2029/12/20 |
| 第22回東京都公募公債 (20年) | 1.92 | 80,000 | 90,831 | 2030/6/20 |
| 第721回東京都公募公債 | 0.84 | 300,000 | 303,042 | 2023/6/20 |
| 第725回東京都公募公債 | 0.66 | 300,000 | 302,823 | 2023/9/20 |
| 第736回東京都公募公債 | 0.505 | 100,000 | 101,136 | 2024/9/20 |
| 第778回東京都公募公債 | 0.165 | 100,000 | 100,029 | 2028/3/17 |
| 平成26年度第13回北海道公募公債 | 0.461 | 100,000 | 101,168 | 2024/12/26 |
| 平成26年度第15回北海道公募公債 | 0.434 | 100,000 | 101,172 | 2025/2/27 |
| 第31回1号宮城県公募公債 | 0.515 | 140,000 | 142,247 | 2025/9/29 |
| 第1回神奈川県公募公債 (30年) | 2.54 | 100,000 | 126,765 | 2035/6/20 |
| 第2回神奈川県公募公債 (20年) | 2.23 | 20,000 | 21,082 | 2024/9/20 |
| 第2回神奈川県公募公債 (30年) | 2.87 | 20,000 | 26,501 | 2036/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第3回神奈川県公募公債(30年) | 2.62 | 50,000 | 64,986 | 2037/3/19 |
| 第209回神奈川県公募公債 | 0.549 | 100,000 | 101,257 | 2024/9/20 |
| 第8回大阪府公募公債(20年) | 1.83 | 200,000 | 229,352 | 2031/12/22 |
| 第153回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 400,000 | 399,908 | 2023/8/30 |
| 第367回大阪府公募公債 | 0.73 | 10,000 | 10,053 | 2022/12/27 |
| 第380回大阪府公募公債 | 0.762 | 100,000 | 101,358 | 2024/1/30 |
| 第383回大阪府公募公債 | 0.695 | 200,000 | 202,750 | 2024/4/26 |
| 第406回大阪府公募公債 | 0.095 | 196,000 | 196,227 | 2026/3/30 |
| 第408回大阪府公募公債 | 0.072 | 204,000 | 204,014 | 2026/5/29 |
| 第467回大阪府公募公債 | 0.164 | 100,000 | 98,911 | 2031/4/28 |
| 第471回大阪府公募公債 | 0.083 | 100,000 | 98,059 | 2031/8/29 |
| 第475回大阪府公募公債 | 0.093 | 120,000 | 117,813 | 2031/12/26 |
| 平成25年度第4回京都府公募公債 | 0.88 | 100,000 | 101,061 | 2023/6/19 |
| 第2回兵庫県公募公債(30年) | 2.36 | 10,000 | 12,826 | 2040/3/19 |
| 第3回兵庫県公募公債(30年) | 0.69 | 100,000 | 95,572 | 2046/9/20 |
| 第7回兵庫県公募公債(15年) | 1.12 | 100,000 | 106,183 | 2028/12/25 |
| 第15回兵庫県公募公債(20年) | 1.64 | 100,000 | 113,481 | 2032/7/23 |
| 平成25年度第7回兵庫県公募公債 | 0.7 | 100,000 | 101,079 | 2023/10/30 |
| 第6回静岡県公募公債(15年) | 1.062 | 100,000 | 106,062 | 2029/6/25 |
| 平成27年度第8回静岡県公募公債 | 0.481 | 100,000 | 101,475 | 2025/9/19 |
| 平成25年度第9回愛知県公募公債 | 0.849 | 60,000 | 60,660 | 2023/7/25 |
| 平成28年度第4回広島県公募公債 | 0.06 | 100,000 | 99,837 | 2026/11/25 |
| 第14回埼玉県公募公債(20年) | 1.546 | 100,000 | 113,758 | 2034/5/8 |
| 平成26年度第6回埼玉県公募公債 | 0.554 | 50,000 | 50,633 | 2024/9/26 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債(30年) | 2.62 | 30,000 | 39,104 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債(30年) | 2.28 | 20,000 | 25,221 | 2038/9/17 |
| 第9回千葉県公募公債(20年) | 1.84 | 20,000 | 22,645 | 2030/10/11 |
| 平成24年度第8回千葉県公募公債 | 0.84 | 70,000 | 70,477 | 2023/1/25 |
| 平成30年度第3回千葉県公募公債 | 0.18 | 100,000 | 100,062 | 2028/7/25 |
| 平成30年度第4回千葉県公募公債 | 0.254 | 100,000 | 100,474 | 2028/9/25 |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 30,000 | 30,021 | 2022/4/25 |
| 第134回共同発行市場公募地方債 | 0.674 | 100,000 | 101,369 | 2024/5/24 |
| 第136回共同発行市場公募地方債 | 0.611 | 300,000 | 303,960 | 2024/7/25 |
| 第138回共同発行市場公募地方債 | 0.554 | 100,000 | 101,265 | 2024/9/25 |
| 第139回共同発行市場公募地方債 | 0.544 | 200,000 | 202,572 | 2024/10/25 |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 0.505 | 100,000 | 101,230 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債 | 0.345 | 100,000 | 100,851 | 2025/1/24 |
| 第146回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 100,000 | 101,611 | 2025/5/23 |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 0.51 | 100,000 | 101,583 | 2025/9/25 |
| 第1回名古屋市公募公債(30年) | 2.53 | 100,000 | 126,313 | 2035/3/20 |
| 第9回名古屋市公募公債(30年) | 2.095 | 10,000 | 12,508 | 2042/9/19 |
| 第19回名古屋市公募公債(20年) | 0.323 | 100,000 | 97,808 | 2036/4/28 |
| 第485回名古屋市公募公債 | 0.67 | 100,000 | 101,098 | 2023/12/8 |
| 第5回京都市公募公債(20年) | 2.36 | 50,000 | 55,317 | 2026/12/18 |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債(20年) | 2.54 | 70,000 | 77,254 | 2026/6/19 |

| 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5回横浜市公募公債(20年) | | 2.17 | 230,000 | 245,759 | 2025/6/20 |
| 第7回横浜市公募公債(20年) | | 2.06 | 50,000 | 53,719 | 2025/12/19 |
| 第18回横浜市公募公債(20年) | | 2.21 | 100,000 | 114,156 | 2029/5/25 |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年) | | 2.277 | 20,000 | 25,416 | 2040/9/20 |
| 平成26年度第2回福岡市公募公債(20年) | | 1.49 | 100,000 | 113,106 | 2034/6/20 |
| 平成28年度第2回広島市公募公債 | | 0.07 | 100,000 | 99,934 | 2026/8/25 |
| 平成24年度第2回千葉市公募公債 | | 0.81 | 50,000 | 50,258 | 2022/11/22 |
| 令和2年度第1回山梨県公募公債 | | 0.135 | 300,000 | 296,730 | 2030/10/30 |
| 小 | 計 | | 7,320,000 | 7,631,951 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 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 | 114,498 | 2030/6/28 |
| 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 | 115,021 | 2032/3/19 |
| 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 | 28,204 | 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 | 133,000 | 134,654 | 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 | 100,000 | 101,218 | 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 | 101,276 | 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 | 202,762 | 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 | 101,805 | 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 | 142,696 | 2026/6/30 |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 0.668 | 22,000 | 22,145 | 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 | 50,584 | 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 | 101,396 | 2024/6/14 |
| 第93回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 0.174 | 107,000 | 107,505 | 2027/2/15 |
| 第40回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.02 | 100,000 | 99,936 | 2026/3/13 |
| 第16回政府保証民間都市開発債券 | | 0.699 | 16,000 | 16,178 | 2023/10/20 |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.693 | 80,000 | 80,967 | 2023/12/18 |
| 第41回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.09 | 100,000 | 99,891 | 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 | 53,997 | 2025/12/19 |
| 第17回道路債券(財投機関債) | | 1.54 | 50,000 | 50,553 | 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 | 13,942 | 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 | 41,293 | 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 | 44,760 | 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 | 65,344 | 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 | 14,200 | 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 | 34,169 | 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 | 57,688 | 2032/3/19 |
| 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 | 202,280 | 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 | 57,225 | 2029/6/28 |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 2.33 | 50,000 | 52,842 | 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 | 23,360 | 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 | 22,839 | 2031/8/28 |
| 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 | 56,809 | 2032/7/28 |
| 第82回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 0.12 | 100,000 | 100,195 | 2026/3/27 |
| F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.602 | 100,000 | 107,846 | 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 | 33,407 | 2031/7/30 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| F 240回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | | 1.069 | 100,000 | 106,271 | 2030/2/28 |
| 第7回阪神高速道路債券 (財投機関債) | | 2.18 | 100,000 | 106,305 | 2025/3/21 |
| 第10回日本政策金融公庫 (財投機関債) | | 2.167 | 20,000 | 22,975 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫 (財投機関債) | | 1.911 | 20,000 | 22,751 | 2030/10/29 |
| 第4回中部国際空港 (財投機関債) | | 0.305 | 100,000 | 100,820 | 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 | 10,987 | 11,166 | 2037/11/10 |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 2.29 | 10,888 | 11,051 | 2042/8/10 |
| 第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | | 0.14 | 71,306 | 70,962 | 2034/2/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | | 2.19 | 10,434 | 10,524 | 2037/5/10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.69 | 11,138 | 11,267 | 2040/7/10 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.88 | 11,290 | 11,468 | 2040/12/10 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.84 | 10,881 | 11,018 | 2041/2/10 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.6 | 27,268 | 28,674 | 2045/12/10 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.76 | 20,816 | 21,814 | 2046/6/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.67 | 21,930 | 22,894 | 2046/7/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 22,919 | 23,961 | 2046/8/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 2.18 | 12,007 | 12,363 | 2042/3/10 |
| 第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.47 | 27,670 | 28,931 | 2046/11/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 33,452 | 34,999 | 2047/4/10 |
| 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.3 | 40,697 | 42,581 | 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 | 23,184 | 2031/6/13 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 34,598 | 35,977 | 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 | 74,932 | 2026/6/19 |
| 第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.93 | 44,519 | 45,782 | 2049/9/10 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.95 | 45,806 | 47,153 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.87 | 47,221 | 48,424 | 2049/11/10 |
| 第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.84 | 59,037 | 60,442 | 2050/9/10 |
| 第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 72,521 | 72,142 | 2051/6/10 |
| 第117回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債) | | 1.438 | 100,000 | 107,038 | 2027/9/17 |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.47 | 76,630 | 76,706 | 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 | 57,511 | 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 | 25,174 | 2042/9/19 |
| 第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.44 | 157,524 | 157,371 | 2052/7/10 |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.46 | 81,671 | 81,577 | 2053/2/10 |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 81,068 | 80,793 | 2053/3/10 |
| 第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.39 | 83,201 | 82,723 | 2053/8/10 |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.21 | 88,150 | 86,392 | 2054/8/10 |
| 第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.3 | 91,631 | 90,325 | 2055/3/10 |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.37 | 93,964 | 93,024 | 2055/9/10 |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 96,673 | 95,866 | 2056/5/10 |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 99,200 | 97,947 | 2056/12/10 |
| 第7回国際協力機構債券 (財投機関債) | | 1.991 | 30,000 | 34,574 | 2031/6/13 |
| 第83回東日本高速道路 | | 0.05 | 200,000 | 199,496 | 2026/6/19 |
| 第25回西日本高速道路 | | 0.524 | 100,000 | 101,249 | 2024/12/20 |

| 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61回西日本高速道路 | 0.04 | 200,000 | 199,412 | 2026/6/19 |
| 小 計 | | 5,246,097 | 5,441,520 | |
| 金融債券 | | | | |
| 第351回信金中金債 | 0.07 | 100,000 | 99,983 | 2024/2/27 |
| 第11号商工債券(10年) | 0.66 | 100,000 | 101,356 | 2024/9/20 |
| 第14号商工債券(10年) | 0.6 | 100,000 | 101,507 | 2025/6/20 |
| 小 計 | | 300,000 | 302,846 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第507回中部電力 | 0.605 | 200,000 | 202,982 | 2026/1/23 |
| 第508回関西電力 | 0.455 | 100,000 | 100,563 | 2027/4/23 |
| 第509回関西電力 | 0.47 | 200,000 | 201,228 | 2027/5/25 |
| 第518回関西電力 | 0.44 | 100,000 | 100,152 | 2028/6/20 |
| 第381回中国電力 | 0.953 | 271,000 | 275,398 | 2024/4/25 |
| 第471回東北電力 | 1.168 | 102,000 | 103,781 | 2023/12/25 |
| 第529回東北電力 | 0.07 | 100,000 | 99,273 | 2026/4/24 |
| 第292回四国電力 | 0.385 | 100,000 | 100,413 | 2027/5/25 |
| 第426回九州電力 | 1.064 | 136,000 | 138,282 | 2024/2/23 |
| 第437回九州電力 | 0.685 | 100,000 | 101,659 | 2026/1/23 |
| 第449回九州電力 | 0.43 | 200,000 | 200,928 | 2027/4/23 |
| 第468回九州電力 | 0.435 | 100,000 | 100,001 | 2028/8/25 |
| 第346回東京交通債券 | 1.13 | 130,000 | 131,673 | 2023/6/20 |
| 第21回大和ハウス工業 | 0.001 | 100,000 | 99,848 | 2023/9/15 |
| 第16回アサヒグループホールディングス | 0.08 | 100,000 | 99,447 | 2026/3/13 |
| 第5回サントリー食品インターナショナル | 0.001 | 100,000 | 99,613 | 2024/7/8 |
| 第6回ヒューリック | 0.494 | 100,000 | 99,888 | 2028/10/20 |
| 第4回トヨタ紡織 | 0.21 | 100,000 | 99,796 | 2024/12/20 |
| 第42回王子ホールディングス | 0.08 | 100,000 | 99,483 | 2026/3/24 |
| 第11回イビデン | 0.001 | 100,000 | 99,695 | 2024/9/9 |
| 第6回花王 | 0.13 | 100,000 | 99,766 | 2025/9/19 |
| 第19回オリエンタルランド | 0.001 | 100,000 | 99,721 | 2024/9/2 |
| 第5回荒川化学工業(サステナビリティ) | 0.18 | 100,000 | 99,433 | 2026/11/26 |
| 第19回日立製作所 | 0.16 | 100,000 | 99,267 | 2027/3/12 |
| 第18回デンソー | 0.315 | 100,000 | 99,738 | 2028/3/17 |
| 第18回J A三井リース | 0.16 | 100,000 | 99,411 | 2026/3/12 |
| 第26回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 0.05 | 100,000 | 99,641 | 2026/3/18 |
| 第1回明治安田生命2018基金 | 0.315 | 100,000 | 99,948 | 2023/9/25 |
| 第1回明治安田生命2019基金 | 0.29 | 100,000 | 99,822 | 2024/8/2 |
| 第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 1.95 | 200,000 | 210,490 | 2025/11/12 |
| 第28回芙蓉総合リース | 0.14 | 100,000 | 99,296 | 2026/4/21 |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 0.18 | 200,000 | 199,912 | 2025/12/19 |
| 第65回ホンダファイナンス | 0.16 | 100,000 | 99,869 | 2025/9/19 |
| 第70回ホンダファイナンス | 0.001 | 100,000 | 99,728 | 2024/9/19 |
| 第95回トヨタファイナンス | 0.001 | 100,000 | 99,787 | 2024/4/15 |
| 第96回トヨタファイナンス | 0.06 | 100,000 | 99,635 | 2026/4/15 |
| 第97回トヨタファイナンス | 0.001 | 100,000 | 99,735 | 2024/7/22 |

| 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41回リコーリース | 0.14 | 100,000 | 99,378 | 2026/4/17 |
| 第201回オリックス | 0.07 | 100,000 | 99,155 | 2026/4/21 |
| 第16回三井住友ファイナンス&リース | 0.25 | 100,000 | 100,143 | 2024/9/13 |
| 第21回三井住友ファイナンス&リース | 0.18 | 100,000 | 100,059 | 2023/11/27 |
| 第1回三菱HCキャピタル | 0.05 | 100,000 | 99,600 | 2024/11/29 |
| 第137回三菱地所 | 0.05 | 100,000 | 99,971 | 2025/2/7 |
| 第36回京王電鉄 | 0.325 | 100,000 | 99,997 | 2027/9/17 |
| 第38回京王電鉄 | 0.295 | 100,000 | 99,779 | 2027/11/29 |
| 第49回東日本旅客鉄道 | 2.26 | 100,000 | 110,164 | 2027/4/16 |
| 第163回東日本旅客鉄道 | 0.05 | 100,000 | 99,416 | 2026/4/15 |
| 第19回西日本旅客鉄道 | 2.376 | 100,000 | 113,739 | 2028/12/11 |
| 第73回西日本旅客鉄道 | 0.05 | 100,000 | 99,413 | 2026/4/22 |
| 第7回東海旅客鉄道 | 2.2 | 30,000 | 30,068 | 2022/5/10 |
| 第79回東海旅客鉄道 | 0.421 | 100,000 | 97,382 | 2036/4/14 |
| 第83回東海旅客鉄道 | 0.001 | 300,000 | 299,514 | 2023/9/19 |
| 第64回名古屋鉄道 | 0.09 | 100,000 | 99,307 | 2026/3/23 |
| 第22回KDDI | 0.31 | 100,000 | 99,708 | 2028/7/12 |
| 第39回東京電力パワーグリッド | 1.08 | 100,000 | 102,291 | 2030/7/16 |
| 第47回東京電力パワーグリッド | 0.68 | 100,000 | 98,725 | 2031/8/29 |
| 第17回ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.44 | 100,000 | 100,096 | 2024/1/23 |
| 小 計 | | 6,569,000 | 6,607,208 | |
| 合 計 | | 114,324,097 | 119,063,059 | |

○投資信託財産の構成

(2022年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 119,063,059 | % 99.0 |
| コール・ローン等、その他 | 1,201,265 | 1.0 |
| 投資信託財産総額 | 120,264,324 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 120,264,324,822 |
| コール・ローン等 | 729,281,962 |
| 公社債(評価額) | 119,063,059,111 |
| 未収入金 | 349,592,000 |
| 未収利息 | 119,149,979 |
| 前払費用 | 3,241,770 |
| (B) 負債 | 909,454,683 |
| 未払金 | 586,364,500 |
| 未払解約金 | 215,914,949 |
| 未払信託報酬 | 105,461,301 |
| 未払利息 | 246 |
| その他未払費用 | 1,713,687 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 119,354,870,139 |
| 元本 | 92,430,394,545 |
| 次期繰越損益金 | 26,924,475,594 |
| (D) 受益権総口数 | 92,430,394,545口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,913円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 92,666,271,278円
 期中追加設定元本額 12,058,481,082円
 期中一部解約元本額 12,294,357,815円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2913円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2021年4月1日～ 2022年3月31日 |
|---------------------------|--------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 632,883,687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 | 27,628,016,945円 |
| 分配準備積立金額 | 7,658,856,596円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 35,919,757,228円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 3,886円 |
| 1万口当たり分配金額 | -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 (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

○損益の状況 (2021年4月1日～2022年3月31日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 848,752,422 |
| 受取利息 | 848,817,847 |
| その他収益金 | 13,880 |
| 支払利息 | △ 79,305 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 2,300,939,496 |
| 売買益 | 98,960,514 |
| 売買損 | △ 2,399,900,010 |
| (C) 信託報酬等 | △ 215,868,735 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 1,668,055,809 |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,827,256,611 |
| (F) 追加信託差損益金 | 23,765,274,792 |
| (配当等相当額) | (27,628,016,945) |
| (売買損益相当額) | (△ 3,862,742,153) |
| (G) 計(D+E+F) | 26,924,475,594 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 26,924,475,594 |
| 追加信託差損益金 | 23,765,274,792 |
| (配当等相当額) | (27,628,016,945) |
| (売買損益相当額) | (△ 3,862,742,153) |
| 分配準備積立金 | 8,291,740,283 |
| 繰越損益金 | △ 5,132,539,481 |

- (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。