

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（2007年10月31日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて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。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	国内債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	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）

ファンド・マネジャー
（国内債券）

第16期（決算日：2023年3月27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「ファンド・マネジャー（国内債券）」は、去る3月27日に第16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）

お客さまのお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 (分配落)	価額			NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額		
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落				中 率	
	円	円	円	騰	落	率	%	%	百万円		
12期(2019年3月25日)	12,325		0			1.5	388.94	1.7	98.9	0.1	140,816
13期(2020年3月25日)	12,275		0			△0.4	388.41	△0.1	96.7	0.1	195,494
14期(2021年3月25日)	12,187		0			△0.7	386.37	△0.5	99.1	0.3	40
15期(2022年3月25日)	11,951		0			△1.9	379.90	△1.7	99.5	0.1	37
16期(2023年3月27日)	11,730		0			△1.8	373.84	△1.6	100.6	0.2	24,523

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2022年3月25日	11,951	—	379.90	—	99.5	0.1
3月末	11,988	0.3	381.04	0.3	98.7	0.1
4月末	11,955	0.0	380.12	0.1	99.6	0.1
5月末	11,935	△0.1	379.54	△0.1	99.7	0.1
6月末	11,822	△1.1	376.08	△1.0	99.7	0.1
7月末	11,898	△0.4	378.55	△0.4	99.5	0.1
8月末	11,868	△0.7	377.67	△0.6	99.5	0.1
9月末	11,740	△1.8	373.60	△1.7	99.6	0.1
10月末	11,723	△1.9	373.25	△1.8	99.6	0.1
11月末	11,664	△2.4	371.33	△2.3	99.7	0.1
12月末	11,506	△3.7	366.60	△3.5	99.3	0.2
2023年1月末	11,469	△4.0	365.59	△3.8	99.5	0.2
2月末	11,594	△3.0	369.57	△2.7	93.1	0.2
(期 末) 2023年3月27日	11,730	△1.8	373.84	△1.6	100.6	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第16期：2022年3月26日～2023年3月27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16期首	11,951円
第16期末	11,730円
既払分配金	0円
騰落率	-1.8%

※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

基準価額は期間の初めに比べ1.8%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（-1.6%）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16期：2022年3月26日～2023年3月27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、期間の前半はインフレ率の高止まりを受けた欧米金利の上昇などから下落しました。2022年12月には日銀がイールドカーブコントロール（Y

CC）の修正を決定したことなどにより国内債券市況は下落しましたが、期間末にかけては米欧金融不安などを背景に反発しました。期間を通じてみると国内債券市況は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ファンド・マネジャー（国内債券）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 国内債券インデックスマザーファンド

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

▶ **ファンド・マネジャー（国内債券）**

ベンチマークとの乖離は△0.2%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

マザーファンド保有による要因

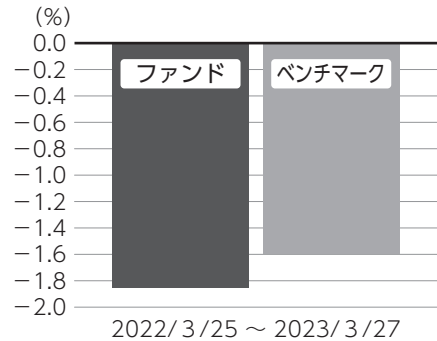
マザーファンド保有による影響は0.0%程度でした。

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：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）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16期 2022年3月26日～2023年3月27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	4,635

（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。）

- ▶ **ファンド・マネジャー（国内債券）**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。
- ▶ **国内債券インデックスマザーファンド**
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。

2022年3月26日～2023年3月27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	30	0.254	(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）	(20)	(0.166)	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）	(7)	(0.055)	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）	(4)	(0.033)	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 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
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(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	30	0.257	

期中の平均基準価額は、11,754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。

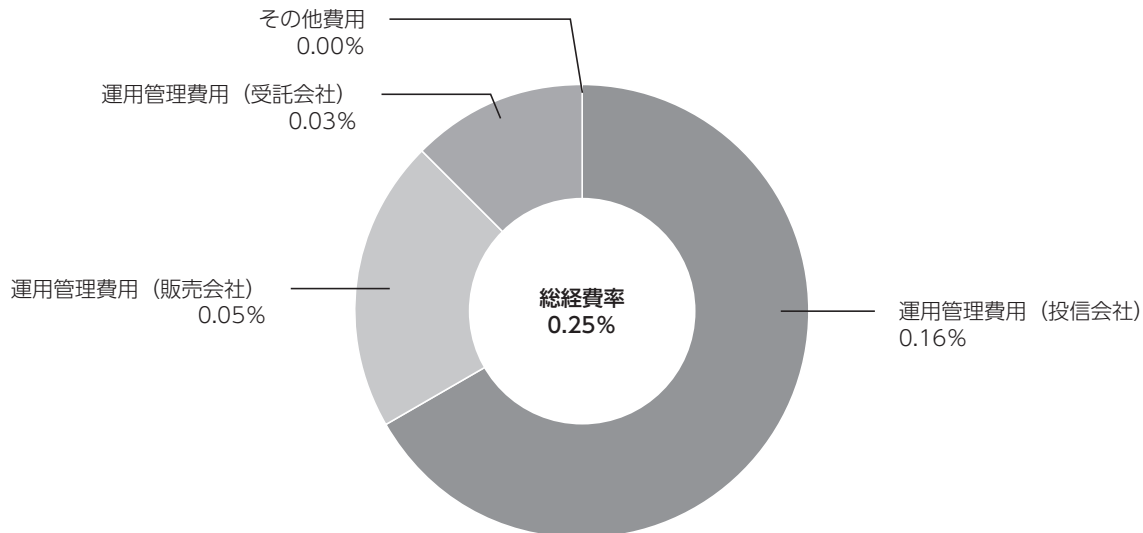
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.25%**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

(2022年3月26日～2023年3月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券インデックスマザーファンド	千口 35,873,249	千円 33,732,634	千口 9,986,079	千円 9,332,265

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月26日～2023年3月27日)

利害関係人との取引状況

<ファンド・マネジャー（国内債券）>

該当事項はございません。

<国内債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 6.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(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

<国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 315	百万円 99	百万円 1,109

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

<国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,100

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年3月26日～2023年3月27日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 15	百万円 —	百万円 —	百万円 15	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

(2023年3月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券インデックスマザーファンド	千口 39,220	千口 25,926,390	千円 24,521,180

○投資信託財産の構成

(2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
国内債券インデックスマザーファンド	千円 24,521,180	% 99.4
コール・ローン等、その他	143,707	0.6
投資信託財産総額	24,664,887	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年3月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	24,664,887,684
コール・ローン等	32,028,053
国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	24,521,180,205
未収入金	111,679,426
(B) 負債	141,780,418
未払解約金	110,294,664
未払信託報酬	31,133,859
未払利息	10
その他未払費用	351,885
(C) 純資産総額(A-B)	24,523,107,266
元本	20,906,437,514
次期繰越損益金	3,616,669,752
(D) 受益権総口数	20,906,437,514口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,730円

<注記事項>

- ①期首元本額 31,544,315円
 期中追加設定元本額 29,094,377,842円
 期中一部解約元本額 8,219,484,643円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1730円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年3月26日～ 2023年3月27日
費用控除後の配当等収益額	78,418,415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	36,109,838円
収益調整金額	9,575,780,852円
分配準備積立金額	298,066円
当ファンドの分配対象収益額	9,690,607,171円
1万口当たり収益分配対象額	4,635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、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（2022年3月26日～2023年3月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,025
受取利息	80
支払利息	△ 3,105
(B) 有価証券売買損益	146,828,083
売買益	214,272,092
売買損	△ 67,444,009
(C) 信託報酬等	△ 31,525,813
(D) 当期損益金(A+B+C)	115,299,245
(E) 前期繰越損益金	△ 472,926
(F) 追加信託差損益金	3,501,843,433
(配当等相当額)	(9,559,183,737)
(売買損益相当額)	(△6,057,340,304)
(G) 計(D+E+F)	3,616,669,752
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,616,669,752
追加信託差損益金	3,501,843,433
(配当等相当額)	(9,575,780,852)
(売買損益相当額)	(△6,073,937,419)
分配準備積立金	114,826,319

- (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。

国内債券インデックスマザーファンド

《第3期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「国内債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第3期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第3期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	わが国の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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	債先物比率	純資産総額
	期騰落	率	期騰落	率			
(設定日) 2020年3月2日	円	%		%	%	%	百万円 999
1期(2020年5月12日)	10,000	—	394.51	—	—	—	71,305
2期(2021年5月12日)	9,835	△1.7	388.75	△1.5	99.5	—	145,774
3期(2022年5月12日)	9,791	△0.4	386.93	△0.5	100.6	0.1	234,196
	9,596	△2.0	379.29	△2.0	99.5	0.1	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年5月12日	円 9,791	% —	386.93	% —	100.6	0.1
5月末	9,782	△0.1	386.62	△0.1	99.5	0.3
6月末	9,788	△0.0	386.90	△0.0	100.1	0.1
7月末	9,836	0.5	388.81	0.5	99.4	0.4
8月末	9,828	0.4	388.46	0.4	99.5	0.4
9月末	9,795	0.0	387.12	0.0	99.2	0.4
10月末	9,784	△0.1	386.72	△0.1	99.5	0.4
11月末	9,807	0.2	387.65	0.2	98.8	0.4
12月末	9,786	△0.1	386.84	△0.0	99.8	0.2
2022年1月末	9,716	△0.8	384.06	△0.7	100.9	0.2
2月末	9,668	△1.3	382.13	△1.2	99.4	0.2
3月末	9,641	△1.5	381.04	△1.5	98.7	0.1
4月末	9,617	△1.8	380.12	△1.8	99.6	0.1
(期 末) 2022年5月12日	9,596	△2.0	379.29	△2.0	99.5	0.1

(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

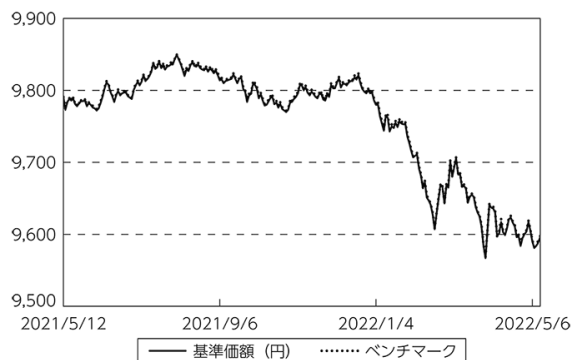
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%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(−2.0%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 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。

● 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。期の終わり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(NOMURA-BPI総合)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2.0%の下落になったため、乖離は $\Delta 0.0\%$ 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)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・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。

○1万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 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 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
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,754円です。			

(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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	197,186,688	119,703,488
	地方債証券	10,604,053	3,110,570
	特殊債券	4,058,851	2,187,460
	社債券	9,215,213	(197,485) 3,253,356 (200,000)

(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 3,033	百万円 2,880	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	221,064	77,332	35.0	128,254	38,452	30.0

(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 401	百万円 102	百万円 899

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 1,800

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UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2022年5月12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	189,525,000	195,543,833	83.5	—	56.9	17.3	9.4	
地方債証券	13,747,000	14,214,301	6.1	—	2.1	2.6	1.4	
	(13,747,000)	(14,214,301)	(6.1)	(—)	(2.1)	(2.6)	(1.4)	
特殊債券 (除く金融債)	8,723,835	8,978,652	3.8	—	2.1	1.1	0.7	
	(8,723,835)	(8,978,652)	(3.8)	(—)	(2.1)	(1.1)	(0.7)	
金融債券	810,000	810,725	0.3	—	—	0.2	0.1	
	(810,000)	(810,725)	(0.3)	(—)	(—)	(0.2)	(0.1)	
普通社債券	13,510,000	13,570,952	5.8	—	1.9	3.6	0.3	
	(13,510,000)	(13,570,952)	(5.8)	(—)	(1.9)	(3.6)	(0.3)	
合 計	226,315,835	233,118,465	99.5	—	62.9	24.8	11.8	
	(36,790,835)	(37,574,632)	(16.0)	(—)	(6.1)	(7.5)	(2.5)	

(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425回利付国債 (2年)	0.005	2,280,000	2,282,143	2023/6/1
第426回利付国債 (2年)	0.005	1,110,000	1,111,065	2023/7/1
第427回利付国債 (2年)	0.005	950,000	950,921	2023/8/1
第428回利付国債 (2年)	0.005	1,930,000	1,932,007	2023/9/1
第430回利付国債 (2年)	0.005	1,200,000	1,201,404	2023/11/1
第431回利付国債 (2年)	0.005	1,570,000	1,571,946	2023/12/1
第432回利付国債 (2年)	0.005	1,090,000	1,091,340	2024/1/1
第434回利付国債 (2年)	0.005	1,700,000	1,702,142	2024/3/1
第136回利付国債 (5年)	0.1	860,000	861,702	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,450,000	1,453,436	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	3,170,000	3,178,654	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	1,020,000	1,023,019	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	2,940,000	2,949,261	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	2,050,000	2,057,011	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	2,023,000	2,030,646	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	3,170,000	3,183,123	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	2,120,000	2,129,222	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	2,920,000	2,933,227	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	3,010,000	3,024,116	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	1,830,000	1,831,756	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	970,000	970,795	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	2,360,000	2,361,014	2026/9/20
第150回利付国債 (5年)	0.005	2,520,000	2,520,579	2026/12/20
第151回利付国債 (5年)	0.005	380,000	379,905	2027/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	530,000	709,373	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	590,000	764,126	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	270,000	351,294	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	630,000	823,239	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	410,000	514,906	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	351,000	433,141	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	570,000	674,532	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	530,000	584,590	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	870,000	712,738	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	810,000	777,008	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	750,000	695,722	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	641,000	533,844	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	650,000	538,577	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	1,060,000	938,195	2061/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	400,000	403,888	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	200,000	202,374	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	300,000	302,748	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	100,000	101,076	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,400,000	1,417,122	2024/3/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	370,000	374,754	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	600,000	608,526	2024/12/20

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338回利付国債 (10年)	0.4	400,000	405,080	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,230,000	1,246,814	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	750,000	760,957	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	300,000	303,573	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	110,000	110,508	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,840,000	1,848,684	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,110,000	2,119,642	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	2,200,000	2,210,120	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	1,750,000	1,757,630	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	1,950,000	1,957,936	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	2,360,000	2,368,189	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,780,000	1,784,966	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,370,000	2,374,834	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	2,070,000	2,072,504	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,340,000	2,340,725	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	1,443,000	1,442,047	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,150,000	2,146,345	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	1,400,000	1,396,052	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	1,780,000	1,772,221	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	1,840,000	1,829,640	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	2,290,000	2,274,931	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	2,400,000	2,380,848	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	1,640,000	1,625,174	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	2,550,000	2,524,143	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	2,110,000	2,087,106	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	2,080,000	2,054,956	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	2,060,000	2,033,590	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	2,080,000	2,052,648	2031/12/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	50,000	58,781	2031/5/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	50,000	60,106	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	50,000	54,175	2033/3/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	100,000	119,505	2033/9/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	190,000	234,591	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	100,000	124,966	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	100,000	125,316	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	250,000	310,932	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	100,000	123,451	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	100,000	123,734	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	100,000	126,545	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	100,000	124,275	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	280,000	356,003	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	400,000	509,764	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	100,000	127,730	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	410,000	513,246	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	300,000	380,382	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	100,000	128,705	2037/9/20

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第28回利付国債 (30年)	2.5	550,000	710,000
第29回利付国債 (30年)	2.4	370,000	473,426
第30回利付国債 (30年)	2.3	610,000	772,253
第31回利付国債 (30年)	2.2	100,000	125,249
第32回利付国債 (30年)	2.3	330,000	419,443
第33回利付国債 (30年)	2.0	960,000	1,173,494
第34回利付国債 (30年)	2.2	650,000	817,823
第35回利付国債 (30年)	2.0	600,000	736,098
第36回利付国債 (30年)	2.0	650,000	797,972
第37回利付国債 (30年)	1.9	620,000	750,553
第38回利付国債 (30年)	1.8	690,000	822,866
第39回利付国債 (30年)	1.9	460,000	557,400
第40回利付国債 (30年)	1.8	471,000	562,034
第41回利付国債 (30年)	1.7	470,000	551,986
第42回利付国債 (30年)	1.7	560,000	658,028
第43回利付国債 (30年)	1.7	470,000	552,560
第44回利付国債 (30年)	1.7	540,000	635,175
第45回利付国債 (30年)	1.5	500,000	567,545
第46回利付国債 (30年)	1.5	670,000	760,610
第47回利付国債 (30年)	1.6	650,000	751,393
第48回利付国債 (30年)	1.4	626,000	697,169
第49回利付国債 (30年)	1.4	590,000	657,024
第50回利付国債 (30年)	0.8	640,000	629,900
第51回利付国債 (30年)	0.3	680,000	594,476
第52回利付国債 (30年)	0.5	600,000	549,306
第53回利付国債 (30年)	0.6	750,000	701,842
第54回利付国債 (30年)	0.8	490,000	479,073
第55回利付国債 (30年)	0.8	470,000	458,964
第56回利付国債 (30年)	0.8	660,000	643,711
第57回利付国債 (30年)	0.8	380,000	369,781
第58回利付国債 (30年)	0.8	710,000	689,324
第59回利付国債 (30年)	0.7	470,000	444,488
第60回利付国債 (30年)	0.9	660,000	653,043
第61回利付国債 (30年)	0.7	338,000	318,027
第62回利付国債 (30年)	0.5	370,000	330,139
第63回利付国債 (30年)	0.4	350,000	302,956
第64回利付国債 (30年)	0.4	550,000	475,029
第65回利付国債 (30年)	0.4	760,000	656,374
第66回利付国債 (30年)	0.4	280,000	241,558
第67回利付国債 (30年)	0.6	970,000	881,012
第68回利付国債 (30年)	0.6	480,000	435,657
第69回利付国債 (30年)	0.7	400,000	372,480
第70回利付国債 (30年)	0.7	650,000	604,305
第71回利付国債 (30年)	0.7	460,000	426,962
第72回利付国債 (30年)	0.7	690,000	639,395
第73回利付国債 (30年)	0.7	650,000	601,334

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74回利付国債 (30年)	1.0	170,000	169,804	2052/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	100,000	102,077	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	100,000	102,681	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	270,000	278,548	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	430,000	442,921	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	200,000	208,380	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	50,000	52,580	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	100,000	105,059	2024/9/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	106,125	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	150,000	158,758	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	100,000	106,029	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	100,000	106,651	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	106,837	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	200,000	215,374	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	200,000	214,654	2025/12/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	140,000	152,520	2026/3/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	200,000	218,192	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	300,000	328,821	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	300,000	329,013	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	50,000	54,825	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	60,000	66,081	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	400,000	446,500	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	100,000	110,605	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	100,000	111,574	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	200,000	222,078	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	300,000	334,377	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	50,000	56,239	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	200,000	227,290	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	200,000	228,254	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	200,000	227,038	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	90,000	101,432	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	140,000	158,669	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	100,000	113,087	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	300,000	335,325	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	300,000	336,405	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	113,494	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	40,000	45,828	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	500,000	569,335	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	620,000	707,959	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	100,000	114,534	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	100,000	115,285	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	150,000	173,593	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	700,000	804,678	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	350,000	400,561	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	100,000	112,849	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	250,000	278,132	2030/6/20

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121回利付国債 (20年)	1.9	230,000	262,241	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	160,000	181,113	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	180,000	208,843	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	400,000	460,716	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	510,000	598,199	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	110,000	127,111	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	40,000	45,874	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	190,000	218,488	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	490,000	559,099	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	180,000	205,977	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	540,000	612,981	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	290,000	330,060	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	702,000	805,573	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	530,000	609,865	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	100,000	114,106	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	470,000	531,772	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	1,600,000	1,828,624	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	70,000	78,622	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	580,000	657,163	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	730,000	835,163	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	440,000	504,090	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	1,030,000	1,190,628	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	450,000	511,479	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	660,000	743,232	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,134,000	1,303,204	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,120,000	1,288,649	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,210,000	1,380,210	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	930,000	1,051,104	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,290,000	1,459,712	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,140,000	1,277,233	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	980,000	1,074,726	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,070,000	1,173,907	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,080,000	1,198,778	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,310,000	1,437,397	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,160,000	1,242,580	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	862,000	853,595	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	960,000	922,656	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,090,000	1,090,730	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	780,000	790,077	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	1,050,000	1,076,796	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	850,000	858,313	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,230,000	1,239,581	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	920,000	925,280	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	874,000	863,844	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	790,000	778,963	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,050,000	1,065,634	2038/9/20

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167回利付国債 (20年)	0.5	810,000	794,763	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	750,000	722,070	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	800,000	755,152	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	1,290,000	1,213,890	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	710,000	666,001	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,030,000	980,961	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	970,000	921,752	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	720,000	682,084	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	980,000	943,073	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	800,000	767,600	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	890,000	836,546	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	1,220,000	1,166,466	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	1,070,000	1,020,780	2041/12/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	300,000	302,067	2042/3/20
小 計		189,525,000	195,543,833	
地方債証券				
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	105,595	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	107,090	2025/9/19
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	99,172	2038/9/17
第14回東京都公募公債 (20年)	2.31	200,000	224,966	2028/3/17
第31回東京都公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,936	2024/6/20
第721回東京都公募公債	0.84	100,000	100,925	2023/6/20
第725回東京都公募公債	0.66	250,000	252,207	2023/9/20
第732回東京都公募公債	0.645	100,000	101,294	2024/6/20
第792回東京都公募公債	0.05	100,000	98,853	2029/3/19
平成30年度第19回北海道公募公債 (5年)	0.02	300,000	299,964	2024/3/25
第14回1号宮城県公募公債 (5年)	0.03	200,000	200,060	2023/7/27
第1回神奈川県公募公債 (30年)	2.54	100,000	125,628	2035/6/20
第12回神奈川県公募公債 (20年)	2.19	100,000	114,053	2029/9/20
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	20,000	22,396	2034/6/20
第86回神奈川県公募公債 (5年)	0.01	300,000	299,421	2026/3/19
第211回神奈川県公募公債	0.438	200,000	202,102	2024/12/20
第8回大阪府公募公債 (20年)	1.83	200,000	228,372	2031/12/22
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	100,000	113,945	2033/9/27
第153回大阪府公募公債 (5年)	0.001	500,000	499,970	2023/8/30
第171回大阪府公募公債 (5年)	0.001	200,000	199,764	2025/5/28
第176回大阪府公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,833	2025/10/29
第378回大阪府公募公債	0.7	200,000	202,152	2023/11/28
第383回大阪府公募公債	0.695	300,000	303,924	2024/4/26
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	202,374	2024/9/27
第391回大阪府公募公債	0.513	300,000	303,759	2024/12/25
第401回大阪府公募公債	0.477	200,000	202,960	2025/10/29
第451回大阪府公募公債	0.063	152,000	149,484	2029/12/26
第466回大阪府公募公債	0.176	137,000	135,186	2031/3/20
第467回大阪府公募公債	0.164	200,000	197,162	2031/4/28
第471回大阪府公募公債	0.083	200,000	195,456	2031/8/29

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成30年度第12回京都府公募公債 (5年)		0.02	100,000	99,998	2024/3/19
第2回兵庫県公募公債 (30年)		2.36	100,000	126,935	2040/3/19
第9回兵庫県公募公債 (20年)		2.25	200,000	229,438	2029/11/19
第11回静岡県公募公債 (20年)		1.841	200,000	225,330	2030/10/18
平成26年度第3回静岡県公募公債		0.679	500,000	506,615	2024/5/27
平成27年度第10回静岡県公募公債		0.461	100,000	101,380	2025/9/19
平成29年度第14回静岡県公募公債 (5年)		0.04	10,000	10,003	2023/3/20
令和2年度第7回静岡県公募公債 (5年)		0.02	200,000	199,850	2025/6/20
令和2年度第12回静岡県公募公債 (5年)		0.01	320,000	319,491	2025/12/19
平成20年度第2回愛知県公募公債 (20年)		2.46	100,000	113,837	2028/6/20
平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年)		2.28	200,000	228,656	2029/6/20
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	200,000	213,152	2026/11/13
平成26年度第10回愛知県公募公債		0.588	300,000	303,954	2024/9/30
平成27年度第5回愛知県公募公債		0.544	100,000	101,532	2025/5/27
平成26年度第4回広島県公募公債		0.5	100,000	101,180	2024/11/25
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	100,232	2028/3/23
第9回埼玉県公募公債 (20年)		2.15	200,000	229,398	2030/5/24
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	100,813	2025/1/28
平成30年度第8回埼玉県公募公債		0.145	300,000	298,707	2029/1/30
令和2年度第9回埼玉県公募公債		0.14	100,000	98,504	2031/2/18
平成26年度第10回福岡県公募公債		0.453	100,000	101,165	2025/2/26
平成30年度第3回茨城県公募公債 (5年)		0.03	600,000	600,192	2023/8/25
第126回共同発行市場公募地方債		0.81	320,000	323,513	2023/9/25
第136回共同発行市場公募地方債		0.611	300,000	303,801	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債		0.566	200,000	202,420	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債		0.554	300,000	303,654	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	101,180	2024/11/25
平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)		0.506	100,000	99,272	2036/9/30
令和3年度第1回熊本市公募公債		0.13	100,000	98,150	2031/11/26
平成27年度第1回新潟市公募公債		0.464	10,000	10,149	2025/12/24
平成26年度第5回大阪市公募公債		0.593	200,000	202,626	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債 (30年)		2.53	100,000	125,194	2035/3/20
第3回名古屋市公募公債 (20年)		2.03	100,000	106,178	2025/6/20
第490回名古屋市公募公債		0.489	120,000	121,548	2025/3/19
第7回京都市公募公債 (20年)		2.38	200,000	227,594	2028/9/21
平成20年度第24回神戸市公募公債 (20年)		2.08	100,000	112,258	2028/12/20
平成26年度第4回神戸市公募公債		0.606	300,000	303,735	2024/7/18
平成27年度第3回横浜市公募公債		0.524	100,000	101,566	2025/8/18
平成27年度第4回横浜市公募公債		0.486	300,000	304,503	2025/10/20
平成23年度第3回札幌市公募公債		1.944	100,000	114,634	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募公債		0.961	100,000	105,173	2029/9/20
第9回川崎市公募公債 (20年)		2.15	100,000	114,699	2030/5/24
第50回川崎市公募公債 (5年)		0.01	15,000	15,000	2022/6/20
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)		1.371	100,000	110,781	2034/9/20
2021年度第5回福岡市公募公債		0.135	100,000	98,211	2031/10/28
平成30年度第3回千葉市公募公債		0.259	10,000	10,038	2028/11/22

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
令和3年度第1回和歌山県公募公債		0.13	100,000	98,149	2031/11/28
平成25年度第1回徳島県公募公債		0.65	103,000	104,030	2023/11/29
令和2年度第1回山梨県公募公債		0.135	300,000	295,647	2030/10/30
平成25年度第1回岡山県公募公債		0.75	100,000	101,265	2024/1/31
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	100,965	2024/3/19
小	計		13,747,000	14,214,301	
特殊債券(除く金融債)					
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	113,179	2028/11/28
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	113,969	2031/10/31
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	100,000	118,394	2042/5/30
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	110,852	2033/4/28
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	209,000	210,385	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	344,300	347,839	2023/6/30
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	126,000	127,412	2023/8/31
第225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.556	100,000	101,268	2024/8/30
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	100,000	101,237	2024/11/29
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.174	106,000	106,602	2027/2/26
第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	100,000	2028/6/30
第22回政府保証日本政策投資銀行債券		2.2	100,000	102,456	2023/6/19
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.66	100,000	101,349	2024/5/21
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.601	100,000	101,298	2024/7/16
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	13,000	13,165	2025/11/18
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.155	100,000	100,339	2027/8/13
第17回政府保証民間都市開発債券		0.145	200,000	200,910	2026/2/26
第3回政府保証新関西国際空港債券		0.644	100,000	101,367	2024/6/26
第16回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券		0.001	300,000	300,120	2023/11/27
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.45	100,000	109,205	2026/3/19
第27回道路債券(財投機関債)		2.42	150,000	156,627	2024/3/20
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	100,000	113,550	2028/9/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	110,000	116,824	2025/3/21
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.14	50,000	57,145	2030/5/10
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.133	100,000	107,386	2035/3/20
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.043	100,000	113,781	2030/6/28
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.851	100,000	112,648	2030/10/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.29	100,000	112,392	2028/4/25
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.702	100,000	113,313	2032/9/28
F54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.588	100,000	102,872	2024/3/19
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	100,000	107,765	2027/8/20
F101回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.22	100,000	102,149	2024/3/6
F122回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.412	200,000	213,204	2027/6/18
F149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	103,925	2025/12/19
第11回福祉医療機構債券(財投機関債)		2.57	100,000	109,673	2026/3/20
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	47,521	47,360	2033/1/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.28	35,956	38,115	2044/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	20,210	20,318	2040/6/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	20,992	22,085	2045/5/10

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48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	59,493	62,490	2046/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	38,159	39,537	2047/11/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	92,213	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	104,565	108,090	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	142,232	147,006	2048/12/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	164,520	169,908	2049/4/10
第84回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.536	100,000	106,357	2026/9/18
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	103,302	104,253	2050/2/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	100,000	106,551	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	62,732	64,202	2050/12/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	225,138	224,118	2051/12/10
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	76,351	75,969	2052/5/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	156,262	155,529	2052/10/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	160,766	159,687	2053/5/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	81,800	81,204	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	82,992	82,644	2053/9/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	85,907	84,670	2054/4/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	270,471	266,752	2055/1/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.34	180,330	177,911	2055/2/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	94,657	93,427	2056/2/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	96,517	95,567	2056/6/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	97,462	95,954	2056/9/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.32	98,897	97,449	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	99,155	98,371	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	99,349	99,357	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	99,799	99,584	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	100,000	100,102	2057/5/10
第256回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.03	100,000	99,988	2024/3/19
第34回国際協力機構債券(財投機関債)		0.245	100,000	100,713	2026/2/12
第83回東日本高速道路		0.05	200,000	199,632	2026/6/19
第84回中日本高速道路		0.07	100,000	100,018	2025/7/10
第25回西日本高速道路		0.524	100,000	101,209	2024/12/20
第26回西日本高速道路		0.604	100,000	101,643	2025/5/21
第30回西日本高速道路		0.17	130,000	130,416	2026/5/22
第61回西日本高速道路		0.04	400,000	399,100	2026/6/19
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.905	100,000	104,539	2029/11/27
小	計		8,723,835	8,978,652	
金融債券					
い第817号商工債券		0.17	110,000	110,135	2023/6/27
い第832号商工債券		0.06	100,000	99,905	2024/9/27
い第852号商工債券		0.09	200,000	199,518	2026/5/27
い第825号農林債券		0.07	100,000	100,034	2024/2/27
第374回信金中金債		0.05	100,000	99,798	2026/1/27
第11号商工債券(10年)		0.66	100,000	101,329	2024/9/20
第248号商工債券(3年)		0.07	100,000	100,006	2023/9/27
小	計		810,000	810,725	

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
	%	千円	千円
普通社債券			
第503回中部電力	0.584	10,000	10,119
第500回関西電力	0.455	100,000	100,609
第506回関西電力	0.33	200,000	200,038
第508回関西電力	0.455	200,000	200,892
第510回関西電力	0.49	100,000	100,586
第515回関西電力	0.435	200,000	200,116
第530回関西電力	0.405	200,000	198,494
第322回北陸電力	0.38	100,000	100,176
第525回東北電力	0.22	100,000	99,119
第307回四国電力	0.23	200,000	196,514
第437回九州電力	0.685	100,000	101,672
第449回九州電力	0.43	300,000	301,341
第476回九州電力	0.43	100,000	99,583
第484回九州電力	0.375	100,000	98,915
第493回九州電力	0.1	400,000	397,760
第325回北海道電力	1.264	100,000	105,674
第357回北海道電力	0.475	100,000	99,855
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	105,596
第21回新関西国際空港	1.017	100,000	97,907
第20回成田国際空港	0.105	100,000	100,018
第24回成田国際空港	0.25	100,000	100,388
第29回成田国際空港	0.319	100,000	100,565
第1回国際石油開発帝石	0.08	400,000	399,104
第2回国際石油開発帝石	0.3	100,000	99,063
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,549
第5回サントリー食品インターナショナル	0.001	100,000	99,664
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,856
第13回日本たばこ産業	0.355	100,000	99,692
第9回ヒューリック	0.4	100,000	98,798
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	100,003
第9回クラレ	0.34	100,000	100,256
第16回旭化成	0.001	100,000	99,746
第42回王子ホールディングス	0.08	100,000	99,603
第4回電通グループ	0.22	300,000	299,997
第19回オリエントランド	0.001	100,000	99,767
第19回Zホールディングス	0.35	200,000	198,656
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,061
第7回ジェイテクト	0.345	100,000	99,085
第36回三菱重工業(グリーン)	0.14	300,000	299,274
第18回J A三井リース	0.16	100,000	99,494
第19回J A三井リース	0.13	300,000	297,603
第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)	0.05	400,000	398,924
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,958
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,863
第63回三井物産	2.37	100,000	110,262
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	100,843

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	99,582
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	300,000	300,117
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	700,000	699,727
第34回東京センチュリー	0.22	100,000	98,487
第65回ホンダファイナンス	0.16	100,000	99,951
第70回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,775
第72回ホンダファイナンス	0.03	100,000	99,776
第41回リコーリース	0.14	100,000	99,462
第79回アコム	0.29	100,000	100,039
第80回アコム	0.28	100,000	99,837
第61回日立キャピタル	0.31	200,000	200,340
第87回日立キャピタル	0.06	100,000	99,892
第201回オリックス	0.07	100,000	99,246
第16回三井住友ファイナンス&リース	0.25	200,000	200,364
第30回三井住友ファイナンス&リース	0.01	200,000	199,748
第1回三菱HCキャピタル	0.05	200,000	199,306
第137回三菱地所	0.05	100,000	100,024
第78回東京急行電鉄	1.528	200,000	214,010
第57回東日本旅客鉄道	2.376	100,000	113,368
第147回東日本旅客鉄道	0.265	100,000	99,101
第163回東日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,024
第174回東日本旅客鉄道	0.001	300,000	299,115
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	113,439
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,367
第73回東海旅客鉄道	1.014	100,000	104,827
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,591
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,432
第9回九州旅客鉄道	0.001	100,000	99,806
第9回関西高速鉄道	0.619	200,000	201,868
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	100,000	100,532
第14回東京電力パワーグリッド	0.43	100,000	100,196
第18回東京電力パワーグリッド	0.83	300,000	301,911
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	101,043
第34回東京電力パワーグリッド	0.75	100,000	100,973
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	201,002
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	100,000	99,678
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	100,000	100,132
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	0.18	200,000	199,298
第13回広島ガス	0.405	100,000	99,561
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	101,844
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,586
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	98,818
第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	100,000	99,956
第4回フランス預金供託公庫	0.725	100,000	101,046

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第1回サンタンデール銀行 (2019)	% 0.463	千円 100,000	千円 99,697	2024/12/5
小 計		13,510,000	13,570,952	
合 計		226,315,835	233,118,465	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 債券先物取引 10年国債標準物	百万円 298	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 233,118,465	% 99.5
コール・ローン等、その他	1,081,705	0.5
投資信託財産総額	234,200,170	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	234,200,170,879
コール・ローン等	714,898,041
公社債(評価額)	233,118,465,360
未収利息	344,188,849
前払費用	18,638,629
差入委託証拠金	3,980,000
(B) 負債	3,741,416
未払金	2,482,200
未払解約金	1,259,117
未払利息	99
(C) 純資産総額(A-B)	234,196,429,463
元本	244,057,504,595
次期繰越損益金	△ 9,861,075,132
(D) 受益権総口数	244,057,504,595口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,596円

<注記事項>

- ①期首元本額 148,891,221,462円
期中追加設定元本額 209,394,768,783円
期中一部解約元本額 114,228,485,650円
また、1口当たり純資産額は、期末0.9596円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	81,579,190,333円
MUKAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	50,339,642,787円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	29,775,443,152円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	27,796,970,741円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	11,846,441,022円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	11,445,787,520円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	10,558,769,918円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	8,970,595,158円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	6,920,584,638円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	2,116,322,288円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,696,668,191円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	970,942,158円
ファンド・マネジャー(国内債券)	40,146,689円
合計	244,057,504,595円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は9,861,075,132円です。

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,320,811,836
受取利息	1,321,291,556
支払利息	△ 479,720
(B) 有価証券売買損益	△5,988,098,115
売買益	112,077,540
売買損	△6,100,175,655
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,762,900
取引益	1,821,300
取引損	△ 7,584,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	△4,673,049,179
(E) 前期繰越損益金	△3,116,526,227
(F) 追加信託差損益金	△4,520,963,585
(G) 解約差損益金	2,449,463,859
(H) 計(D+E+F+G)	△9,861,075,132
次期繰越損益金(H)	△9,861,075,132

(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) (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。

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。