

## 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。）	

## 運用報告書（全体版）

ファンド・マネジャー  
（国内債券）

第17期（決算日：2024年3月25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25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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9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

お客さま専用  
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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円
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
17期(2024年3月25日)	11,458	0		△2.3	366.10	△2.1	95.6	0.1	17,749

(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 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023年3月27日	11,730	—	373.84	—	100.6	0.2
3月末	11,754	0.2	374.74	0.2	99.1	0.2
4月末	11,786	0.5	375.61	0.5	99.6	0.1
5月末	11,772	0.4	375.27	0.4	99.6	0.1
6月末	11,799	0.6	376.29	0.7	98.7	0.1
7月末	11,613	△1.0	370.43	△0.9	99.4	0.1
8月末	11,528	△1.7	367.76	△1.6	99.5	0.1
9月末	11,443	△2.4	365.13	△2.3	99.6	0.2
10月末	11,258	△4.0	359.31	△3.9	105.6	0.2
11月末	11,494	△2.0	366.88	△1.9	102.4	0.1
12月末	11,538	△1.6	368.38	△1.5	99.6	0.2
2024年1月末	11,452	△2.4	365.75	△2.2	99.3	0.2
2月末	11,486	△2.1	366.90	△1.9	99.0	0.2
(期 末) 2024年3月25日	11,458	△2.3	366.10	△2.1	95.6	0.1

(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。

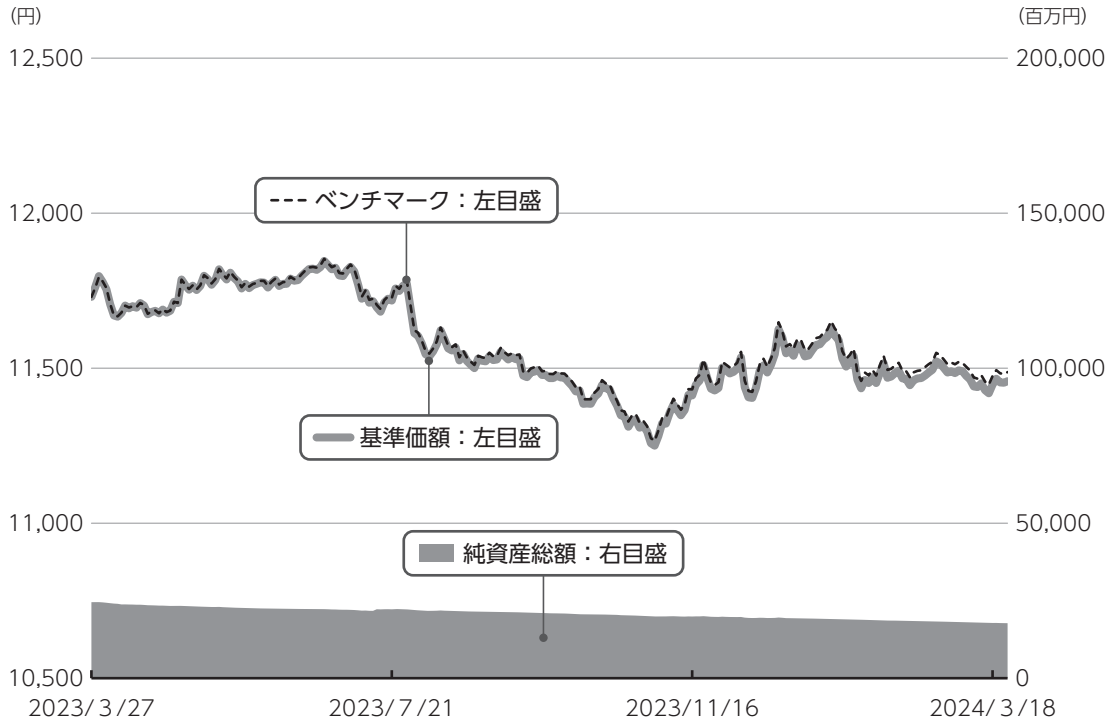
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第17期：2023年3月28日～2024年3月25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17期首	11,730円
第17期末	11,458円
既払分配金	0円
騰落率	-2.3%

※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2.3%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（-2.1%）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17期：2023年3月28日～2024年3月25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、期間の初めはもみ合いで推移し、その後は日銀による度重なる金融政策の柔軟化などから下落しました。期間末にかけては欧米中銀の利下げ観測

が高まったことなどを背景に国内債券市況は反発する場面もありましたが、期間を通して見ると下落しました。

## ▶ 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**

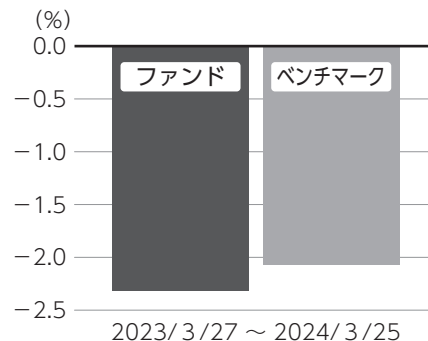
マザーファンド保有による影響は△0.0%程度でした。

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17期 2023年3月28日～2024年3月25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	4,688

（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。



2023年3月28日～2024年3月25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	29	0.252	(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）	(19)	(0.164)	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）	(6)	(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	29	0.255	

期中の平均基準価額は、11,573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。

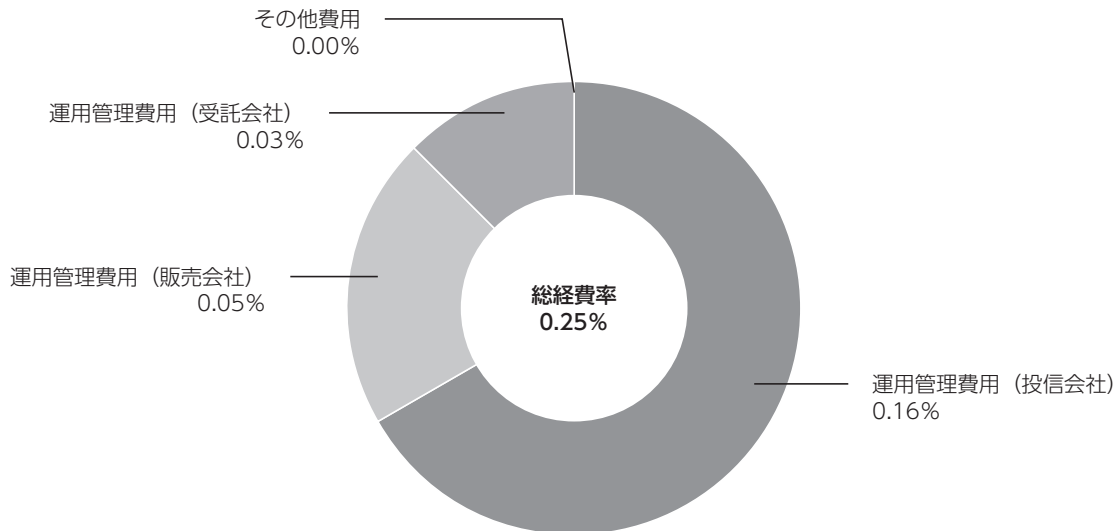
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2023年3月28日～2024年3月25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 797,817	千円 750,746	千口 7,562,327	千円 7,071,506

○利害関係人との取引状況等

(2023年3月28日～2024年3月25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		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 384,845	百万円 87,768	% 22.8	百万円 338,786	百万円 57,207	% 16.9

平均保有割合 10.2%

※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 200	百万円 801	百万円 504

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 2,800

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、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

(2023年3月28日～2024年3月25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

(2024年3月25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 25,926,390	千口 19,161,881	千円 17,747,734

○投資信託財産の構成

(2024年3月25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 17,747,734	% 99.6
コール・ローン等、その他	68,945	0.4
投資信託財産総額	17,816,679	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年3月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,816,679,193
コール・ローン等	24,664,395
国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	17,747,734,658
未収入金	44,280,093
未収利息	47
(B) 負債	67,549,262
未払解約金	43,281,656
未払信託報酬	23,996,404
その他未払費用	271,202
(C) 純資産総額(A-B)	17,749,129,931
元本	15,491,118,852
次期繰越損益金	2,258,011,079
(D) 受益権総口数	15,491,118,852口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,458円

<注記事項>

- ①期首元本額 20,906,437,514円  
 期中追加設定元本額 816,382,390円  
 期中一部解約元本額 6,231,701,052円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1458円です。

○損益の状況（2023年3月28日～2024年3月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,925
受取利息	310
支払利息	△ 5,235
(B) 有価証券売買損益	△ 362,743,941
売買益	91,112,095
売買損	△ 453,856,036
(C) 信託報酬等	△ 53,055,157
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 415,804,023
(E) 前期繰越損益金	81,345,718
(F) 追加信託差損益金	2,592,469,384
(配当等相当額)	( 7,099,130,630)
(売買損益相当額)	(△4,506,661,246)
(G) 計(D+E+F)	2,258,011,079
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	2,258,011,079
追加信託差損益金	2,592,469,384
(配当等相当額)	( 7,099,740,034)
(売買損益相当額)	(△4,507,270,650)
分配準備積立金	163,915,794
繰越損益金	△ 498,374,099

- (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。

②分配金の計算過程

項 目	2023年3月28日～ 2024年3月25日
費用控除後の配当等収益額	82,570,076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	7,099,740,034円
分配準備積立金額	81,345,718円
当ファンドの分配対象収益額	7,263,655,828円
1万口当たり収益分配対象額	4,688円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

\*三菱UFJアセットマネジメント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]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)

## 国内債券インデックスマザーファンド

## 《第4期》決算日2023年5月12日

[計算期間：2022年5月13日～2023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4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4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	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日) 2020年3月2日	円	%		%	%	%	百万円
	10,000	—	394.51	—	—	—	999
1期(2020年5月12日)	9,835	△1.7	388.75	△1.5	99.5	—	71,305
2期(2021年5月12日)	9,791	△0.4	386.93	△0.5	100.6	0.1	145,774
3期(2022年5月12日)	9,596	△2.0	379.29	△2.0	99.5	0.1	234,196
4期(2023年5月12日)	9,507	△0.9	375.76	△0.9	100.6	0.1	288,926

(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) 「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 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2022年 5月12日	9,596	—	379.29	—	99.5	0.1
5月末	9,603	0.1	379.54	0.1	99.7	0.1
6月末	9,514	△0.9	376.08	△0.8	99.7	0.1
7月末	9,577	△0.2	378.55	△0.2	99.5	0.1
8月末	9,555	△0.4	377.67	△0.4	99.5	0.1
9月末	9,454	△1.5	373.60	△1.5	99.7	0.1
10月末	9,443	△1.6	373.25	△1.6	99.6	0.1
11月末	9,397	△2.1	371.33	△2.1	99.7	0.1
12月末	9,272	△3.4	366.60	△3.3	99.3	0.2
2023年 1月末	9,244	△3.7	365.59	△3.6	99.5	0.2
2月末	9,347	△2.6	369.57	△2.6	93.1	0.2
3月末	9,478	△1.2	374.74	△1.2	99.1	0.2
4月末	9,505	△0.9	375.61	△1.0	99.6	0.1
(期 末) 2023年 5月12日	9,507	△0.9	375.76	△0.9	100.6	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

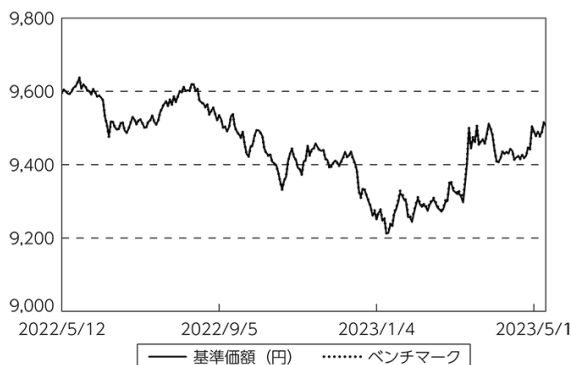
## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.9%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(−0.9%)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（YCC）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、期間の終わり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**

- ・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0.9%の下落になったため、乖離は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)

- ・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。

**○ 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

(2022年5月13日～2023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、9,446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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	397,042,330	342,067,590
	地方債証券	15,019,639	12,881,226 ( 25,000)
内	特殊債券	13,094,477	9,928,534 ( 206,271)
	社債券	14,040,859	10,568,484 ( 100,000)

(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	債券先物取引	百万円 1,183	百万円 1,190	百万円 -	百万円 -

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年5月13日～2023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	百万円 439,197	百万円 157,603	35.9	百万円 375,445	百万円 108,821	29.0

(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 315	百万円 99	百万円 1,107

## 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 2,300

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱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。

## ○組入資産の明細

(2023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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	241,065,000	245,070,320	84.8	—	58.0	18.4	8.4
地方債証券	15,719,000	16,131,391	5.6	—	1.9	2.6	1.1
	( 15,719,000)	( 16,131,391)	( 5.6)	(—)	( 1.9)	( 2.6)	( 1.1)
特殊債券 (除く金融債)	11,460,426	11,641,347	4.0	—	2.2	1.3	0.5
	( 11,460,426)	( 11,641,347)	( 4.0)	(—)	( 2.2)	( 1.3)	( 0.5)
金融債券	900,000	898,634	0.3	—	—	0.2	0.1
	( 900,000)	( 898,634)	( 0.3)	(—)	( —)	( 0.2)	( 0.1)
普通社債券	16,810,000	16,784,470	5.8	—	1.4	3.5	0.9
	( 16,810,000)	( 16,784,470)	( 5.8)	(—)	( 1.4)	( 3.5)	( 0.9)
合 計	285,954,426	290,526,163	100.6	—	63.5	26.0	11.0
	( 44,889,426)	( 45,455,843)	( 15.7)	(—)	( 5.5)	( 7.6)	( 2.6)

(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
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第438回利付国債 (2年)	0.005	400,000	400,584	2024/7/1
第439回利付国債 (2年)	0.005	5,340,000	5,348,063	2024/8/1
第440回利付国債 (2年)	0.005	800,000	801,248	2024/9/1
第441回利付国債 (2年)	0.005	720,000	721,144	2024/10/1
第442回利付国債 (2年)	0.005	4,230,000	4,236,810	2024/11/1
第443回利付国債 (2年)	0.005	370,000	370,629	2024/12/1
第445回利付国債 (2年)	0.005	2,370,000	2,373,649	2025/2/1
第446回利付国債 (2年)	0.005	2,920,000	2,924,175	2025/3/1
第447回利付国債 (2年)	0.005	1,450,000	1,452,044	2025/4/1
第140回利付国債 (5年)	0.1	1,200,000	1,202,964	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	460,000	461,334	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	503,000	504,569	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	1,800,000	1,805,814	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	5,170,000	5,187,888	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,130,000	1,134,384	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	4,120,000	4,137,139	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	4,280,000	4,287,318	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	3,200,000	3,204,960	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	3,760,000	3,765,038	2026/9/20
第150回利付国債 (5年)	0.005	3,140,000	3,142,826	2026/12/20
第151回利付国債 (5年)	0.005	510,000	510,193	2027/3/20
第152回利付国債 (5年)	0.1	3,030,000	3,042,210	2027/3/20
第153回利付国債 (5年)	0.005	3,110,000	3,108,724	2027/6/20
第154回利付国債 (5年)	0.1	4,470,000	4,481,622	2027/9/20
第155回利付国債 (5年)	0.3	70,000	70,753	2027/12/20
第156回利付国債 (5年)	0.2	3,250,000	3,269,370	2027/12/20
第157回利付国債 (5年)	0.2	1,080,000	1,085,205	2028/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	620,000	785,707	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	370,000	451,451	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	600,000	731,484	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	350,000	426,611	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	410,000	482,869	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	271,000	314,067	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	580,000	643,834	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	680,000	701,630	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,060,000	809,649	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	960,000	857,644	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	900,000	775,341	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	781,000	602,439	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	1,130,000	863,885	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	1,120,000	913,606	2061/3/20
第15回利付国債 (40年)	1.0	1,300,000	1,161,836	2062/3/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	370,000	373,074	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	600,000	605,718	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	400,000	403,512	2025/3/20

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339回利付国債 (10年)	0.4	230,000	232,247	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	750,000	758,205	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	300,000	302,811	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	110,000	110,485	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	540,000	542,424	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	770,000	773,480	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,350,000	1,355,832	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	300,000	301,209	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	940,000	943,271	2027/6/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,200,000	1,201,920	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,950,000	1,950,468	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	2,170,000	2,169,435	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,400,000	2,398,704	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,633,000	2,630,051	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,850,000	2,845,839	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	2,560,000	2,554,572	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	1,720,000	1,715,115	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	3,070,000	3,058,948	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	1,380,000	1,373,914	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	2,840,000	2,823,073	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,580,000	2,559,437	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	3,330,000	3,297,632	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	2,960,000	2,925,812	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	2,450,000	2,417,929	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	2,930,000	2,886,958	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	2,950,000	2,902,947	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)	0.2	2,900,000	2,873,755	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)	0.2	1,330,000	1,315,888	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)	0.2	30,000	29,632	2032/9/20
第370回利付国債 (10年)	0.5	1,390,000	1,405,818	2033/3/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	50,000	57,705	2031/5/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	50,000	58,828	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	50,000	53,416	2033/3/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	470,000	549,138	2033/9/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	190,000	228,670	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	100,000	121,669	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	520,000	633,744	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	250,000	302,410	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	280,000	336,179	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	100,000	120,260	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	500,000	614,180	2035/9/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	650,000	801,599	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	650,000	802,906	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	200,000	247,428	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	770,000	934,002	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	860,000	1,056,544	2037/3/20

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27回利付国債 (30年)	2.5	450,000	560,007	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	570,000	710,852	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	270,000	333,390	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	940,000	1,147,984	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	770,000	929,228	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	590,000	721,381	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	600,000	705,930	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,000,000	1,208,250	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	990,000	1,165,180	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	920,000	1,083,934	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	650,000	754,630	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	410,000	467,801	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	590,000	684,010	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	531,000	605,902	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	640,000	718,361	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	600,000	673,608	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	610,000	684,987	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	700,000	785,519	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	650,000	703,976	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	800,000	866,280	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	740,000	815,191	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	796,000	844,898	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	760,000	806,375	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	860,000	807,729	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	740,000	618,425	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	810,000	707,867	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	810,000	722,609	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	700,000	652,316	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	760,000	706,473	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	700,000	649,068	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	700,000	647,430	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	640,000	590,432	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	730,000	655,795	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	480,000	450,691	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	688,000	613,420	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	680,000	573,641	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	760,000	621,254	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	640,000	521,318	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	690,000	561,156	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	290,000	234,554	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	750,000	638,392	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	910,000	772,125	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	790,000	687,434	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	930,000	807,658	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	810,000	702,739	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	770,000	667,374	2051/9/20

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73回利付国債 (30年)	0.7	810,000	701,362	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	870,000	815,242	2052/3/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	670,000	675,701	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)	1.4	700,000	723,317	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	910,000	985,193	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)	1.4	620,000	640,906	2053/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	50,000	51,388	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	100,000	102,996	2024/9/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	104,021	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	150,000	155,754	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	100,000	104,129	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	100,000	104,549	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	104,861	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	200,000	211,248	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	200,000	210,728	2025/12/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	140,000	149,399	2026/3/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	200,000	213,932	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	300,000	322,491	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	700,000	753,459	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	50,000	53,856	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	60,000	64,858	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	400,000	437,436	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	100,000	108,540	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	100,000	109,381	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	200,000	217,892	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	300,000	328,074	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	650,000	716,176	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	200,000	223,334	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	200,000	222,320	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	220,000	243,350	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	140,000	155,605	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	250,000	277,610	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	300,000	329,796	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	300,000	331,002	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	111,495	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	40,000	45,023	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	500,000	559,765	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	620,000	696,712	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	100,000	112,780	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	100,000	113,434	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	1,050,000	1,195,467	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,060,000	1,199,665	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	350,000	394,786	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	100,000	111,393	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	250,000	274,977	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	610,000	685,121	2030/9/20

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122回利付国債 (20年)	1.8	160,000	178,544	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	180,000	205,371	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	400,000	453,388	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	510,000	587,208	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	110,000	124,957	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	40,000	45,131	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	190,000	214,884	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	490,000	550,284	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	180,000	202,572	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	540,000	603,304	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	290,000	324,715	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	702,000	791,933	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	610,000	689,446	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	100,000	112,161	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	100,000	111,299	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	2,580,000	2,898,604	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	70,000	77,405	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	380,000	423,563	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,520,000	2,833,135	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	370,000	416,583	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	2,990,000	3,394,248	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,210,000	1,351,388	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	530,000	586,895	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,474,000	1,661,595	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	860,000	970,148	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,480,000	1,655,542	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,060,000	1,175,094	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,380,000	1,529,923	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,290,000	1,416,213	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,310,000	1,408,223	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,080,000	1,160,654	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,390,000	1,509,109	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	820,000	880,114	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,540,000	1,614,998	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	782,000	761,527	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	960,000	908,400	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,210,000	1,187,699	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	610,000	605,431	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	760,000	762,888	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	1,040,000	1,027,967	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,420,000	1,399,651	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	1,130,000	1,110,609	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,194,000	1,154,120	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,120,000	1,079,086	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,310,000	1,295,629	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	1,000,000	957,060	2038/12/20



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168回利付国債 (20年)	0.4	630,000	591,645	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	960,000	883,977	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	770,000	706,159	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	940,000	859,160	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,090,000	1,009,525	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	1,160,000	1,070,877	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	1,670,000	1,536,617	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	1,070,000	998,138	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	880,000	818,320	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	1,180,000	1,074,791	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	1,240,000	1,147,421	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	1,080,000	996,872	2041/12/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	1,160,000	1,127,670	2042/3/20
第181回利付国債 (20年)	0.9	1,000,000	987,920	2042/6/20
第182回利付国債 (20年)	1.1	1,460,000	1,489,696	2042/9/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	1,000,000	1,071,690	2042/12/20
第184回利付国債 (20年)	1.1	730,000	741,468	2043/3/20
小 計		241,065,000	245,070,320	
<b>地方債証券</b>				
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	103,600	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	104,928	2025/9/19
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	94,766	2038/9/17
第9回東京都公募公債 (20年)	2.44	100,000	107,240	2026/6/19
第13回東京都公募公債 (20年)	2.15	200,000	217,706	2027/12/20
第26回東京都公募公債 (20年)	1.74	100,000	109,932	2032/6/18
第31回東京都公募公債 (5年)	0.005	100,000	100,005	2024/6/20
第732回東京都公募公債	0.645	100,000	100,713	2024/6/20
第749回東京都公募公債	0.436	1,000,000	1,008,720	2025/9/19
第750回東京都公募公債	0.444	100,000	100,946	2025/12/19
第753回東京都公募公債	0.065	150,000	149,914	2026/3/19
第792回東京都公募公債	0.05	100,000	98,642	2029/3/19
第1回神奈川県公募公債 (30年)	2.54	100,000	120,341	2035/6/20
第7回神奈川県公募公債 (20年)	2.22	400,000	431,940	2027/3/19
第12回神奈川県公募公債 (20年)	2.19	100,000	111,651	2029/9/20
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	20,000	21,612	2034/6/20
第40回神奈川県公募公債 (20年)	0.2	100,000	88,834	2039/6/20
第209回神奈川県公募公債	0.549	200,000	201,434	2024/9/20
第211回神奈川県公募公債	0.438	200,000	201,292	2024/12/20
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	100,000	109,603	2033/9/27
第13回大阪府公募公債 (20年)	1.203	100,000	104,832	2035/9/28
第171回大阪府公募公債 (5年)	0.001	200,000	199,704	2025/5/28
第176回大阪府公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,805	2025/10/29
第182回大阪府公募公債 (5年)	0.001	340,000	339,054	2026/4/28
第187回大阪府公募公債 (5年)	0.001	200,000	199,190	2026/9/29
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	201,388	2024/9/27
第391回大阪府公募公債	0.513	300,000	302,247	2024/12/25

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449回大阪府公募公債		0.001	400,000	391,544	2029/10/30
第451回大阪府公募公債		0.063	152,000	149,175	2029/12/26
第466回大阪府公募公債		0.176	137,000	134,001	2031/3/20
平成28年度第5回京都府公募公債 (20年)		0.327	100,000	93,869	2036/8/15
令和元年度第11回京都府公募公債 (5年)		0.001	400,000	399,776	2024/12/18
第1回兵庫県公募公債 (15年)		1.66	500,000	524,725	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債 (30年)		2.36	100,000	120,612	2040/3/19
第3回兵庫県公募公債 (15年)		1.35	200,000	209,746	2027/7/16
第4回兵庫県公募公債 (12年)		0.73	200,000	203,994	2026/8/6
第5回兵庫県公募公債 (15年)		1.31	400,000	420,988	2028/5/26
第6回兵庫県公募公債 (15年)		1.35	100,000	105,515	2028/7/14
第15回兵庫県公募公債 (20年)		1.64	200,000	218,026	2032/7/23
第11回静岡県公募公債 (20年)		1.841	200,000	220,640	2030/10/18
平成27年度第10回静岡県公募公債		0.461	100,000	100,919	2025/9/19
令和2年度第7回静岡県公募公債 (5年)		0.02	200,000	199,768	2025/6/20
令和4年度第1回静岡県公募公債		0.269	300,000	293,259	2032/3/19
平成20年度第2回愛知県公募公債 (20年)		2.46	100,000	111,142	2028/6/20
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)		1.314	200,000	210,034	2027/12/13
平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)		1.542	100,000	108,773	2034/5/15
平成27年度第5回愛知県公募公債		0.544	100,000	100,979	2025/5/27
平成26年度第4回広島県公募公債		0.5	100,000	100,714	2024/11/25
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	99,831	2028/3/23
令和元年度第6回広島県公募公債 (5年)		0.001	500,000	499,570	2025/2/18
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	100,497	2025/1/28
平成29年度第8回埼玉県公募公債		0.245	200,000	200,232	2028/1/26
平成22年度第1回福岡県公募公債 (20年)		1.77	100,000	109,716	2030/8/19
平成23年度第1回福岡県公募公債 (15年)		1.491	200,000	209,640	2026/11/27
平成26年度第10回福岡県公募公債		0.453	100,000	100,714	2025/2/26
第13回千葉県公募公債 (20年)		1.701	200,000	219,632	2032/10/15
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	100,722	2024/11/25
第149回共同発行市場公募地方債		0.5	500,000	504,910	2025/8/25
第153回共同発行市場公募地方債		0.469	100,000	101,017	2025/12/25
第162回共同発行市場公募地方債		0.105	500,000	499,895	2026/9/25
第167回共同発行市場公募地方債		0.245	400,000	401,648	2027/2/25
第214回共同発行市場公募地方債		0.13	100,000	97,650	2031/1/24
第222回共同発行市場公募地方債		0.115	100,000	96,939	2031/9/25
第227回共同発行市場公募地方債		0.244	100,000	97,486	2032/2/25
平成27年度第1回長崎県公募公債		0.515	200,000	202,120	2025/9/30
平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)		0.506	100,000	95,973	2036/9/30
平成27年度第2回熊本県公募公債		0.476	200,000	202,000	2025/10/30
令和3年度第1回熊本県公募公債 (5年)		0.005	200,000	199,388	2026/7/30
令和3年度第1回熊本市公募公債		0.13	100,000	96,969	2031/11/26
平成27年度第1回新潟市公募公債		0.464	10,000	10,100	2025/12/24
令和3年度第1回静岡市公募公債		0.16	200,000	194,430	2031/11/25
平成26年度第5回大阪市公募公債		0.593	200,000	201,562	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債 (15年)		1.329	200,000	209,728	2027/8/10

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1回名古屋市政公募債(30年)		2.53	100,000	120,091	2035/3/20
第3回名古屋市政公募債(20年)		2.03	100,000	104,123	2025/6/20
第27回名古屋市政公募債(5年)		0.001	200,000	199,872	2024/12/20
第490回名古屋市政公募債		0.489	120,000	120,964	2025/3/19
平成20年度第24回神戸市公募債(20年)		2.08	100,000	109,906	2028/12/20
第22回横浜市公募債(20年)		1.895	200,000	221,314	2030/9/13
平成27年度第3回横浜市公募債		0.524	100,000	101,028	2025/8/18
平成23年度第3回札幌市公募債		1.944	100,000	111,606	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募債		0.961	100,000	103,994	2029/9/20
第6回川崎市公募債(20年)		2.21	100,000	111,318	2029/5/25
第9回川崎市公募債(20年)		2.15	100,000	112,275	2030/5/24
平成23年度第4回福岡市公募債(20年)		1.89	100,000	111,208	2031/8/19
2021年度第5回福岡市公募債		0.135	100,000	97,073	2031/10/28
平成30年度第3回千葉市公募債		0.259	10,000	9,996	2028/11/22
令和元年度第2回徳島県公募債		0.09	100,000	98,462	2029/11/28
第148回福岡北九州高速道路債券(20年)		0.731	100,000	97,549	2037/3/19
小 計			15,719,000	16,131,391	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
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	112,931	2042/5/30
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.466	100,000	108,699	2034/6/30
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	100,728	2024/8/30
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	100,000	100,746	2024/9/30
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	300,000	302,229	2024/11/29
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	300,000	301,497	2025/1/31
第259回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.119	100,000	104,623	2035/10/31
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	106,272	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	99,647	2028/6/30
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.625	100,000	96,580	2038/8/31
第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.095	200,000	198,470	2029/1/31
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.544	200,000	201,458	2024/9/13
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.509	200,000	201,888	2025/5/23
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.425	500,000	504,435	2025/9/12
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	13,000	13,108	2025/11/18
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.17	118,000	118,050	2027/10/15
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	122,000	121,945	2027/11/15
第17回政府保証民間都市開発債券		0.145	200,000	200,502	2026/2/26
第3回政府保証新関西国際空港債券		0.644	100,000	100,724	2024/6/26
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	378,000	381,462	2025/6/13
第37回政府保証日本政策投資銀行		0.085	260,000	259,950	2026/12/14
第21回政府保証中部国際空港債券		0.45	204,000	205,564	2025/3/17
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.59	100,000	120,162	2035/12/20
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	110,769	2028/9/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	110,000	114,346	2025/3/21
第50回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.5	100,000	92,197	2039/3/18
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	55,899	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	103,703	2035/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第156回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.257	100,000	105,216	2035/6/20
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	122,789	2034/3/24
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	111,385	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	110,269	2030/10/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	100,000	110,712	2031/8/28
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.32	400,000	434,228	2027/6/18
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	109,765	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	109,777	2032/9/28
第48回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.121	100,000	103,500	2035/12/28
F 89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	105,806	2027/8/20
F 149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	102,755	2025/12/19
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	37,511	37,304	2033/1/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	32,150	33,823	2044/6/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	18,640	19,487	2045/5/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	52,788	55,034	2046/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	55,893	58,058	2046/7/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	33,424	34,391	2047/11/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	106,770	110,878	2048/7/10
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	89,736	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	94,254	96,808	2048/11/10
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0	108,834	111,302	2049/3/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	115,323	118,008	2049/6/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	95,114	94,982	2050/2/10
第94回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.882	300,000	333,720	2032/2/13
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	58,441	59,007	2050/12/10
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	126,040	124,135	2051/4/10
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	338,560	328,819	2051/7/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	210,966	206,575	2051/12/10
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	71,381	69,734	2052/5/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	146,504	143,096	2052/10/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	150,302	146,445	2053/5/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	77,029	74,937	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,820	75,936	2053/9/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	80,769	77,921	2054/4/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	332,092	315,915	2054/9/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	341,308	328,843	2055/2/10
第156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	172,618	166,277	2055/5/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	89,924	86,488	2056/2/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	91,903	88,490	2056/6/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	93,030	88,889	2056/9/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	94,683	90,418	2057/1/10
第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.484	200,000	201,994	2025/12/19
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	94,681	91,678	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,355	92,091	2057/4/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	96,266	93,192	2057/6/10
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	99,341	100,899	2058/3/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券 (除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	199,712	200,406	2058/4/10
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	101,108	2058/5/10
第84回中日本高速道路	0.07	100,000	99,859	2025/7/10
第85回中日本高速道路	0.07	300,000	299,523	2025/10/21
第25回西日本高速道路	0.524	100,000	100,679	2024/12/20
第26回西日本高速道路	0.604	100,000	100,950	2025/5/21
第30回西日本高速道路	0.17	130,000	129,940	2026/5/22
第65回西日本高速道路	0.1	300,000	298,764	2026/12/18
小 計		11,460,426	11,641,347	
<b>金融債券</b>				
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,909	2024/9/27
い第853号商工債券	0.09	100,000	99,596	2026/6/26
い第854号商工債券	0.08	100,000	99,552	2026/7/27
い第862号商工債券	0.18	200,000	199,378	2027/3/26
い第863号商工債券	0.22	200,000	199,564	2027/4/27
第11号商工債券 (10年)	0.66	100,000	100,744	2024/9/20
第268号商工債券 (3年)	0.11	100,000	99,891	2025/5/27
小 計		900,000	898,634	
<b>普通社債券</b>				
第503回中部電力	0.584	10,000	10,061	2025/3/25
第496回関西電力	0.908	100,000	101,066	2025/2/25
第522回関西電力	0.47	300,000	298,440	2028/9/20
第554回関西電力	0.41	200,000	200,412	2025/10/24
第389回中国電力	0.3	300,000	299,736	2026/4/24
第420回中国電力	0.23	200,000	194,198	2029/10/25
第337回北陸電力	0.32	200,000	194,454	2030/6/25
第513回東北電力	0.31	100,000	97,533	2029/10/25
第525回東北電力	0.22	100,000	98,974	2027/10/25
第545回東北電力	0.4	200,000	199,918	2027/6/25
第552回東北電力	0.864	100,000	101,298	2028/12/25
第476回九州電力	0.43	100,000	98,664	2029/5/25
第484回九州電力	0.375	100,000	97,788	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	200,000	198,706	2026/5/25
第511回九州電力	0.51	300,000	301,392	2027/2/25
第325回北海道電力	1.264	100,000	103,189	2030/10/25
第345回北海道電力	0.27	200,000	200,146	2024/9/25
第357回北海道電力	0.475	100,000	99,011	2029/5/25
第358回北海道電力	0.32	200,000	195,068	2029/10/25
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	103,749	2029/9/20
第21回新関西国際空港	1.017	100,000	89,617	2048/9/18
第24回成田国際空港	0.25	100,000	99,637	2027/12/17
第27回成田国際空港	0.657	200,000	188,568	2038/3/12
第48回鹿島建設 (サステナビリティ)	0.554	400,000	402,704	2028/3/16
第3回住友林業	0.33	200,000	200,134	2026/6/17
第13回キリンホールディングス	0.23	100,000	98,008	2029/9/5
第9回サントリーホールディングス	0.3	100,000	99,846	2027/6/8

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2回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	0.2	200,000	199,314	2026/9/18
第5回サントリー食品インターナショナル	0.001	100,000	99,880	2024/7/8
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,951	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	100,000	99,348	2028/9/8
第11回ヒューリック	0.32	100,000	100,049	2026/4/13
第10回東急不動産ホールディングス	0.455	100,000	100,212	2027/2/26
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	99,837	2025/12/19
第9回クラレ	0.34	100,000	99,811	2027/4/30
第16回旭化成	0.001	100,000	99,772	2024/12/9
第13回イビデン	0.29	300,000	299,874	2025/9/12
第46回三井化学	0.37	200,000	199,274	2027/7/23
第56回三井化学	0.3	100,000	100,033	2026/2/27
第5回電通グループ	0.32	200,000	199,442	2027/7/8
第19回オリエンタルランド	0.001	100,000	99,858	2024/9/2
第13回ヤフー	0.46	100,000	96,408	2029/7/31
第19回Zホールディングス	0.35	100,000	98,969	2026/7/28
第20回Zホールディングス (グリーン)	0.46	100,000	97,368	2028/7/28
第22回Zホールディングス	0.76	100,000	99,674	2027/9/15
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	199,584	2027/4/21
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	99,967	2027/5/20
第9回新日本製鐵	0.385	100,000	99,297	2028/6/20
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス	0.26	200,000	199,830	2026/5/27
第14回LIXIL	0.475	100,000	99,904	2027/8/27
第30回ダイキン工業	0.459	100,000	99,149	2029/7/27
第7回ジェイテクト	0.345	100,000	98,727	2028/3/8
第17回パナソニック	0.47	200,000	200,708	2026/9/18
第18回パナソニック	0.23	200,000	199,398	2026/3/5
第36回三菱重工業 (グリーン)	0.14	300,000	299,319	2025/11/21
第18回アイシン精機	0.28	100,000	99,648	2027/9/6
第4回ヤマハ発動機	0.32	100,000	100,094	2026/4/24
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,988	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,878	2024/8/2
第114回丸紅	0.614	200,000	201,096	2028/2/24
第63回三井物産	2.37	100,000	107,926	2027/4/23
第61回住友商事	0.644	100,000	100,596	2028/3/1
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	100,019	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	98,040	2028/5/31
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	103,050	2025/11/12
第33回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	208,938	2026/6/9
第7回みずほリース	0.33	200,000	197,608	2028/1/20
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	300,000	299,628	2025/12/19
第38回東京センチュリー	0.55	200,000	200,474	2027/4/13
第70回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,772	2024/9/19
第72回ホンダファイナンス	0.03	100,000	99,730	2024/12/19
第78回トヨタファイナンス	0.265	300,000	299,751	2027/7/23
第79回アコム	0.29	100,000	99,833	2025/2/28

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80回アコム	0.28	100,000	99,058	2026/2/26
第61回日立キャピタル	0.31	200,000	199,306	2026/6/19
第34回三井住友ファイナンス&リース	0.43	100,000	100,167	2026/2/2
第1回三菱HCキャピタル	0.05	200,000	199,308	2024/11/29
第3回野村ホールディングス	0.28	100,000	98,725	2026/9/4
第118回三菱地所	0.27	100,000	99,899	2026/12/18
第137回三菱地所	0.05	100,000	99,794	2025/2/7
第107回住友不動産	0.23	200,000	199,534	2026/7/31
第111回住友不動産(グリーン)	0.52	100,000	99,920	2028/4/28
第78回東京急行電鉄	1.528	100,000	104,986	2028/6/12
第57回東日本旅客鉄道	2.376	100,000	110,343	2028/12/12
第147回東日本旅客鉄道	0.265	100,000	97,898	2030/4/22
第184回東日本旅客鉄道	0.21	100,000	99,939	2025/10/14
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	108,421	2030/10/25
第68回東海旅客鉄道	1.584	100,000	107,030	2034/4/24
第73回東海旅客鉄道	1.014	100,000	100,505	2035/1/26
第13回東京地下鉄	1.702	100,000	108,376	2032/5/25
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,396	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,198	2026/3/23
第9回九州旅客鉄道	0.001	100,000	99,649	2024/12/9
第31回KDDI(サステナビリティ)	0.43	100,000	99,923	2027/10/27
第7回ソフトバンク	0.58	100,000	96,513	2030/7/29
第9回ソフトバンク	0.48	200,000	197,076	2027/12/3
第13回ソフトバンク	0.52	100,000	94,778	2031/6/3
第15回ソフトバンク	0.41	100,000	97,336	2028/10/12
第84回電源開発	0.754	100,000	101,269	2028/2/18
第85回電源開発	0.872	100,000	101,025	2029/10/31
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	300,000	300,525	2027/8/31
第34回東京電力パワーグリッド	0.75	300,000	301,341	2025/4/23
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	100,000	99,255	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド	0.8	100,000	97,259	2031/4/22
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	198,668	2027/4/26
第50回東京電力パワーグリッド	0.94	100,000	97,562	2032/4/26
第55回東京電力パワーグリッド	0.72	300,000	300,804	2025/10/17
第16回JERA	0.64	100,000	100,621	2028/4/25
第17回JERA	0.9	100,000	101,114	2030/4/25
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	199,288	2024/9/9
第13回広島ガス	0.405	100,000	98,653	2028/9/13
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	100,847	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,654	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	98,551	2026/10/21
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.528	200,000	199,896	2024/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	97,815	2026/12/16
第4回フランス預金供託公庫	0.725	100,000	100,600	2024/7/30

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 99,302	2024/12/5
小 計		16,810,000	16,784,470	
合 計		285,954,426	290,526,163	

## 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 297	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 290,526,163	% 99.4
コール・ローン等、その他	1,831,073	0.6
投資信託財産総額	292,357,236	100.0



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	292,350,456,484
コール・ローン等	803,793,520
公社債(評価額)	290,526,163,528
未収入金	544,307,800
未収利息	315,897,980
前払費用	163,353,656
差入委託証拠金	△ 3,060,000
(B) 負債	3,423,567,695
未払金	3,337,665,922
未払解約金	85,900,822
未払利息	951
(C) 純資産総額(A-B)	288,926,888,789
元本	303,911,087,355
次期繰越損益金	△ 14,984,198,566
(D) 受益権総口数	303,911,087,355口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,507円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 244,057,504,595円  
 期中追加設定元本額 426,756,171,290円  
 期中一部解約元本額 366,902,588,530円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9507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)	141,001,300,138円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	41,991,646,995円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)	28,885,886,976円
ファンド・マネジャー(国内債券)	24,232,514,437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)	23,081,853,939円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	10,220,071,024円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	10,120,486,986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)	9,072,920,571円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	5,884,177,411円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,273,845,787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)	2,051,982,247円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	779,610,799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)	763,369,592円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	378,042,698円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	126,903,220円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	45,576,374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)	898,161円
合計	303,911,087,355円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は14,984,198,566円です。

## ○損益の状況 (2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,553,425,665
受取利息	1,554,919,780
支払利息	△ 1,494,115
(B) 有価証券売買損益	△ 6,012,501,427
売買益	2,585,280,109
売買損	△ 8,597,781,536
(C) 先物取引等取引損益	5,802,400
取引益	7,946,800
取引損	△ 2,144,400
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,453,273,362
(E) 前期繰越損益金	△ 9,861,075,132
(F) 追加信託差損益金	△ 25,062,232,773
(G) 解約差損益金	24,392,382,701
(H) 計(D+E+F+G)	△ 14,984,198,566
次期繰越損益金(H)	△ 14,984,198,566

(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。

## [お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。