

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	<p>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。</p> <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>

## 運用報告書（全体版）

# ファンド・マネジャー (国内債券)



第18期（決算日：2025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18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 (分配落)	基準価額				NOMURA-BPI総合 期騰落率	債券組入比率	債券先物比率	純資産額 百万円
	税分	込配	み金	期騰落率				
14期(2021年3月25日)	円 12,187		円 0	% △0.7	386.37	% △0.5	% 99.1	% 0.3
15期(2022年3月25日)	11,951		0	△1.9	379.90	△1.7	99.5	0.1
16期(2023年3月27日)	11,730		0	△1.8	373.84	△1.6	100.6	0.2
17期(2024年3月25日)	11,458		0	△2.3	366.10	△2.1	95.6	0.1
18期(2025年3月25日)	10,820		0	△5.6	346.99	△5.2	95.5	1.0
								13,927

(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	騰 落 率	N O M U R A - B P I 総合		債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	債 券 物 比 率
				騰 落 率			
(期 首) 2024年3月25日	円 11,458	% —	366.10	% —	95.6	0.1	
3月末	11,470	0.1	366.50	0.1	99.6	0.1	
4月末	11,336	△1.1	362.35	△1.0	91.1	0.1	
5月末	11,152	△2.7	356.53	△2.6	99.5	0.1	
6月末	11,179	△2.4	357.51	△2.3	97.4	0.1	
7月末	11,166	△2.5	357.15	△2.4	100.4	0.1	
8月末	11,295	△1.4	361.33	△1.3	99.5	0.1	
9月末	11,324	△1.2	362.34	△1.0	99.7	0.1	
10月末	11,265	△1.7	360.51	△1.5	99.5	0.1	
11月末	11,184	△2.4	357.99	△2.2	100.9	0.1	
12月末	11,170	△2.5	357.61	△2.3	98.8	0.1	
2025年1月末	11,086	△3.2	354.97	△3.0	99.4	0.2	
2月末	11,008	△3.9	352.61	△3.7	100.9	0.3	
(期 末) 2025年3月25日	10,820	△5.6	346.99	△5.2	95.5	1.0	

(注) 謄落率は期首比。

(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18期：2024年3月26日～2025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18期首	11,458円
第18期末	10,820円
既払分配金	0円
騰落率	-5.6%

※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5.6%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（-5.2%）を0.4%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18期：2024年3月26日～2025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、期間の初めは日銀の利上げ観測の高まりなどから下落しました。

その後、米景気後退懸念などを背景に国内債券市況は反発しましたが、期間の後

半には日銀の更なる金融引き締めに対する警戒感や、政策金利の引き上げなどを受けて下落し、期間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

### ▶ 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）

ベンチマークとのカイ離は△0.4%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△0.3%程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

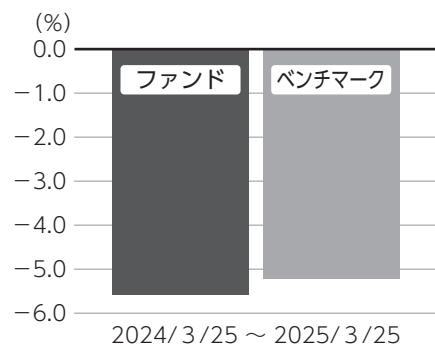
マザーファンド保有による影響は△0.1%程度でした。

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した。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18期 2024年3月26日～2025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	4,767

(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。

2024年3月26日～2025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	28	0.253	(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)	(18)	(0.165)	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	28	0.256	

期中の平均基準価額は、11,203円です。

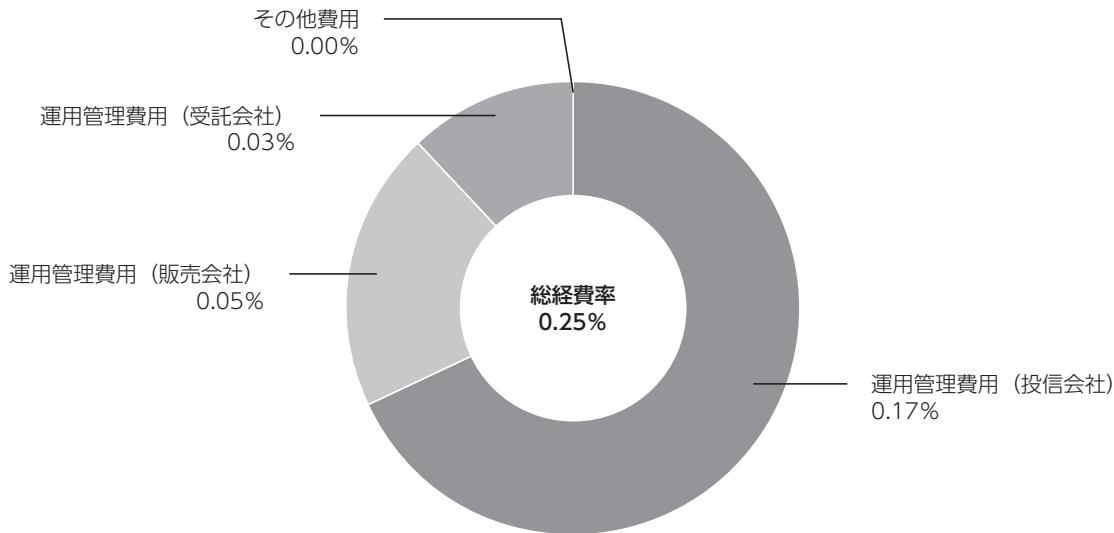
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
 (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

(2024年3月26日～2025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 2,768,529	千円 2,511,685	千口 6,049,346	千円 5,488,219

## ○利害関係人との取引状況等

(2024年3月26日～2025年3月25日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;ファンド・マネジャー（国内債券）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内債券インデックスマザーファンド&gt;

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 372,934	百万円 63,110	% 16.9	百万円 531,270	百万円 107,663	% 20.3

平均保有割合 7.6%

※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ペーパ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みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;国内債券インデックスマザーファンド&gt;

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 —	百万円 —	百万円 399

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 4,101

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、ジャックス、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

### ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年3月26日～2025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

(2025年3月25日現在)

#### 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
国内債券インデックスマザーファンド	千口 19,161,881	千口 15,881,064	千円 13,926,105

### ○投資信託財産の構成

(2025年3月25日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
国内債券インデックスマザーファンド	千円 13,926,105	% 99.6
コール・ローン等、その他	58,527	0.4
投資信託財産総額	13,984,632	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2025年3月25日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	13,984,632,505
コール・ローン等	19,288,746
国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	13,926,105,854
未収入金	39,237,661
未収利息	244
(B) 負債	57,432,115
未払解約金	38,454,442
未払信託報酬	18,765,595
その他未払費用	212,078
(C) 純資産総額(A-B)	13,927,200,390
元本	12,871,694,957
次期繰越損益金	1,055,505,433
(D) 受益権総口数	12,871,694,957口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,820円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 15,491,118,852円  
 期中追加設定元本額 2,368,078,522円  
 期中一部解約元本額 4,987,502,417円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1,0820円です。

## ②分配金の計算過程

項目	目	2024年3月26日～ 2025年3月25日
費用控除後の配当等収益額		98,660,631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		5,922,130,845円
分配準備積立金額		115,655,257円
当ファンドの分配対象収益額		6,136,446,733円
1万口当たり収益分配対象額		4,767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。

## ○損益の状況（2024年3月26日～2025年3月25日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	27,391
受取利息	27,391
(B) 有価証券売買損益	△ 728,413,553
売買益	95,175,375
売買損	△ 823,588,928
(C) 信託報酬等	△ 41,408,578
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 769,794,740
(E) 前期繰越損益金	△ 235,986,174
(F) 追加信託差損益金	2,061,286,347
(配当等相当額)	( 5,919,758,022)
(売買損益相当額)	(△3,858,471,675)
(G) 計(D+E+F)	1,055,505,433
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,055,505,433
追加信託差損益金	2,061,286,347
(配当等相当額)	( 5,922,130,845)
(売買損益相当額)	(△3,860,844,498)
分配準備積立金	214,315,888
繰越損益金	△1,220,096,802

(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5期》決算日2024年5月13日**

**[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]**

「国内債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第5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5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		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落	中率			
(設定日) 2020年3月2日	円 10,000	% —	NOMURA-BPI総合 394.51	% —	% —	% — 百万円 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
5期(2024年5月13日)	9,114	△4.1	360.26	△4.1	99.1	0.1 219,824

(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	騰 落 率	N O M U R A - B P I 総合		債 組 入 比	債 券 先 物 比	券 率
				騰 落 率			
(期 首) 2023年5月12日	円 9,507	% —	375.76	% —	% 100.6	% 0.1	
5月末	9,496	△0.1	375.27	△0.1	99.6	0.1	
6月末	9,520	0.1	376.29	0.1	98.7	0.1	
7月末	9,372	△1.4	370.43	△1.4	99.4	0.1	
8月末	9,305	△2.1	367.76	△2.1	99.5	0.1	
9月末	9,239	△2.8	365.13	△2.8	99.6	0.2	
10月末	9,091	△4.4	359.31	△4.4	105.6	0.2	
11月末	9,284	△2.3	366.88	△2.4	102.4	0.1	
12月末	9,321	△2.0	368.38	△2.0	99.6	0.2	
2024年1月末	9,254	△2.7	365.75	△2.7	99.4	0.2	
2月末	9,283	△2.4	366.90	△2.4	99.0	0.2	
3月末	9,272	△2.5	366.50	△2.5	99.6	0.1	
4月末	9,166	△3.6	362.35	△3.6	91.1	0.1	
(期 末) 2024年5月13日	9,114	△4.1	360.26	△4.1	99.1	0.1	

(注) 謄落率は期首比。

(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4.1%の下落となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-4.1%）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。期間の後半では欧米中銀の利下げ観測が高まつ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

- ・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4.1%の下落になったため、カイ離は△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)

- ・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)

- ・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

(2023年5月13日～2024年5月13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、9,310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

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 公社債

国内	種類	買付額		売付額	
		千円	千円	千円	千円
	国債証券	264,037,196		315,085,864	
	地方債証券	4,919,416		9,789,112	
	特殊債券	1,539,252		4,229,820	( 243,609)
	社債券	6,300,440		9,994,069	( 400,000)

(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 1,170	百万円 1,176	百万円 —	百万円 —

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13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 276,796	百万円 50,606	% 18.3	百万円 339,098	百万円 49,769	% 14.7

(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 200	百万円 801	百万円 503

## 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 3,000

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MUFG証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年5月13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	
国債証券	千円 192,472,000 ( 100,000)	千円 185,003,769 ( 99,995)	% 84.2 ( 0.0)	% — (—)	% 54.9 ( —)	19.7 ( 0.0)	9.5 ( —)
地方債証券	10,959,000 ( 10,959,000)	11,038,521 ( 11,038,521)	5.0 ( 5.0)	— (—)	2.1 ( 2.1)	2.2 ( 2.2)	0.7 ( 0.7)
特殊債券 (除く金融債)	8,970,507 ( 8,970,507)	8,945,401 ( 8,945,401)	4.1 ( 4.1)	— (—)	2.3 ( 2.3)	1.2 ( 1.2)	0.6 ( 0.6)
金融債券	400,000 ( 400,000)	395,149 ( 395,149)	0.2 ( 0.2)	— (—)	— (—)	0.2 ( 0.2)	— ( —)
普通社債券	12,710,000 ( 12,710,000)	12,553,350 ( 12,553,350)	5.7 ( 5.7)	— (—)	1.5 ( 1.5)	3.4 ( 3.4)	0.8 ( 0.8)
合計	225,511,507 ( 33,139,507)	217,936,191 ( 33,032,417)	99.1 (15.0)	— (—)	60.8 ( 5.9)	26.7 ( 7.1)	11.6 ( 2.1)

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第449回利付国債（2年）	0.005		180,000	179,744	2025/6/1
第450回利付国債（2年）	0.005		850,000	848,648	2025/7/1
第451回利付国債（2年）	0.005		3,400,000	3,393,370	2025/8/1
第452回利付国債（2年）	0.005		370,000	369,108	2025/9/1
第453回利付国債（2年）	0.005		1,470,000	1,465,737	2025/10/1
第454回利付国債（2年）	0.1		2,150,000	2,145,743	2025/11/1
第455回利付国債（2年）	0.005		2,730,000	2,719,434	2025/12/1
第457回利付国債（2年）	0.1		500,000	498,370	2026/2/1
第458回利付国債（2年）	0.2		1,700,000	1,696,957	2026/3/1
第144回利付国債（5年）	0.1		200,000	199,890	2025/6/20
第145回利付国債（5年）	0.1		400,000	399,484	2025/9/20
第146回利付国債（5年）	0.1		1,420,000	1,416,478	2025/12/20
第147回利付国債（5年）	0.005		3,400,000	3,381,538	2026/3/20
第148回利付国債（5年）	0.005		3,120,000	3,098,503	2026/6/20
第149回利付国債（5年）	0.005		2,940,000	2,916,979	2026/9/20
第150回利付国債（5年）	0.005		1,160,000	1,149,676	2026/12/20
第151回利付国債（5年）	0.005		650,000	643,396	2027/3/20
第152回利付国債（5年）	0.1		1,610,000	1,597,957	2027/3/20
第153回利付国債（5年）	0.005		1,820,000	1,799,070	2027/6/20
第154回利付国債（5年）	0.1		3,260,000	3,228,149	2027/9/20
第155回利付国債（5年）	0.3		70,000	69,713	2027/12/20
第156回利付国債（5年）	0.2		2,760,000	2,738,913	2027/12/20
第157回利付国債（5年）	0.2		580,000	574,838	2028/3/20
第158回利付国債（5年）	0.1		890,000	878,705	2028/3/20
第159回利付国債（5年）	0.1		390,000	384,423	2028/6/20
第160回利付国債（5年）	0.2		90,000	89,075	2028/6/20
第161回利付国債（5年）	0.3		1,850,000	1,838,437	2028/6/20
第162回利付国債（5年）	0.3		170,000	168,658	2028/9/20
第163回利付国債（5年）	0.4		3,300,000	3,288,021	2028/9/20
第164回利付国債（5年）	0.2		110,000	108,441	2028/12/20
第165回利付国債（5年）	0.3		1,460,000	1,445,881	2028/12/20
第166回利付国債（5年）	0.4		1,800,000	1,791,090	2028/12/20
第167回利付国債（5年）	0.4		1,030,000	1,023,181	2029/3/20
第1回利付国債（40年）	2.4		540,000	597,051	2048/3/20
第2回利付国債（40年）	2.2		370,000	393,720	2049/3/20
第3回利付国債（40年）	2.2		300,000	318,360	2050/3/20
第4回利付国債（40年）	2.2		500,000	528,545	2051/3/20
第5回利付国債（40年）	2.0		340,000	343,685	2052/3/20
第6回利付国債（40年）	1.9		371,000	364,878	2053/3/20
第7回利付国債（40年）	1.7		450,000	421,222	2054/3/20
第8回利付国債（40年）	1.4		460,000	397,113	2055/3/20
第9回利付国債（40年）	0.4		860,000	535,969	2056/3/20
第10回利付国債（40年）	0.9		840,000	614,770	2057/3/20
第11回利付国債（40年）	0.8		660,000	461,907	2058/3/20
第12回利付国債（40年）	0.5		701,000	432,243	2059/3/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第13回利付国債(40年)	0.5	890,000	540,203	540,203	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	810,000	524,321	524,321	2061/3/20
第15回利付国債(40年)	1.0	880,000	627,563	627,563	2062/3/20
第16回利付国債(40年)	1.3	1,010,000	788,224	788,224	2063/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	230,000	230,630	230,630	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	750,000	752,070	752,070	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	300,000	300,213	300,213	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	110,000	109,595	109,595	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	540,000	537,348	537,348	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	770,000	765,680	765,680	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	150,000	149,032	149,032	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	300,000	297,756	297,756	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	940,000	931,925	931,925	2027/6/20
第349回利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,186,572	1,186,572	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	1,400,000	1,382,234	1,382,234	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	280,000	275,996	275,996	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	1,600,000	1,573,728	1,573,728	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	413,000	405,293	405,293	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	1,800,000	1,763,406	1,763,406	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	1,640,000	1,604,166	1,604,166	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	1,480,000	1,445,353	1,445,353	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	1,160,000	1,131,011	1,131,011	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	950,000	924,454	924,454	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	1,620,000	1,573,246	1,573,246	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	1,530,000	1,481,820	1,481,820	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	2,140,000	2,066,790	2,066,790	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	2,390,000	2,301,522	2,301,522	2031/3/20
第363回利付国債(10年)	0.1	1,990,000	1,910,499	1,910,499	2031/6/20
第364回利付国債(10年)	0.1	2,310,000	2,210,739	2,210,739	2031/9/20
第365回利付国債(10年)	0.1	1,490,000	1,421,355	1,421,355	2031/12/20
第366回利付国債(10年)	0.2	1,760,000	1,686,977	1,686,977	2032/3/20
第367回利付国債(10年)	0.2	1,000,000	955,440	955,440	2032/6/20
第368回利付国債(10年)	0.2	2,110,000	2,009,289	2,009,289	2032/9/20
第369回利付国債(10年)	0.5	1,950,000	1,899,846	1,899,846	2032/12/20
第370回利付国債(10年)	0.5	1,630,000	1,583,691	1,583,691	2033/3/20
第371回利付国債(10年)	0.4	1,390,000	1,334,900	1,334,900	2033/6/20
第372回利付国債(10年)	0.8	2,390,000	2,372,433	2,372,433	2033/9/20
第373回利付国債(10年)	0.6	2,560,000	2,487,705	2,487,705	2033/12/20
第374回利付国債(10年)	0.8	700,000	691,474	691,474	2034/3/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	55,219	55,219	2031/5/20
第7回利付国債(30年)	2.3	50,000	55,966	55,966	2032/5/20
第10回利付国債(30年)	1.1	50,000	51,133	51,133	2033/3/20
第12回利付国債(30年)	2.1	470,000	521,126	521,126	2033/9/20
第14回利付国債(30年)	2.4	190,000	216,174	216,174	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	100,000	114,815	114,815	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	520,000	597,381	597,381	2034/9/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第17回利付国債(30年)	2.4	250,000	284,917	284,917	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	280,000	316,243	316,243	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	230,000	260,005	260,005	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	300,000	345,705	345,705	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	250,000	282,757	282,757	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	80,000	92,272	92,272	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	650,000	749,586	749,586	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	380,000	438,333	438,333	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	510,000	576,779	576,779	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	540,000	616,599	616,599	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	450,000	518,818	518,818	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	380,000	437,623	437,623	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	270,000	307,038	307,038	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	640,000	718,316	718,316	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	530,000	586,169	586,169	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	350,000	391,111	391,111	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	810,000	868,311	868,311	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	700,000	767,970	767,970	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	780,000	830,263	830,263	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	920,000	975,834	975,834	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	650,000	677,183	677,183	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	410,000	419,143	419,143	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	340,000	352,600	352,600	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	451,000	459,235	459,235	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	410,000	409,696	409,696	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	470,000	468,261	468,261	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	490,000	487,442	487,442	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	550,000	546,282	546,282	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	570,000	545,940	545,940	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	480,000	458,860	458,860	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	700,000	680,148	680,148	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	706,000	659,891	659,891	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	400,000	373,080	373,080	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	610,000	501,749	501,749	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	750,000	546,622	546,622	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	500,000	380,905	380,905	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	610,000	473,744	473,744	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	590,000	478,212	478,212	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	510,000	411,993	411,993	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	560,000	450,872	450,872	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	620,000	497,116	497,116	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	400,000	319,396	319,396	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	450,000	349,465	349,465	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	500,000	406,265	406,265	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	458,000	352,838	352,838	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	400,000	291,216	291,216	2049/3/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第63回利付国債(30年)	0.4	460,000	324,263	324,263	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	580,000	406,771	406,771	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	660,000	460,897	460,897	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	420,000	291,816	291,816	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	650,000	475,592	475,592	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	360,000	262,378	262,378	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	850,000	634,440	634,440	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	440,000	327,214	327,214	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	650,000	481,598	481,598	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	620,000	457,665	457,665	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	540,000	397,137	397,137	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	540,000	430,326	430,326	2052/3/20
第75回利付国債(30年)	1.3	760,000	652,551	652,551	2052/6/20
第76回利付国債(30年)	1.4	480,000	421,406	421,406	2052/9/20
第77回利付国債(30年)	1.6	570,000	524,223	524,223	2052/12/20
第78回利付国債(30年)	1.4	710,000	620,710	620,710	2053/3/20
第79回利付国債(30年)	1.2	520,000	431,568	431,568	2053/6/20
第80回利付国債(30年)	1.8	540,000	518,583	518,583	2053/9/20
第81回利付国債(30年)	1.6	570,000	521,304	521,304	2053/12/20
第82回利付国債(30年)	1.8	230,000	220,372	220,372	2054/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	100,000	101,924	101,924	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	100,000	102,144	102,144	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	100,000	102,436	102,436	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	200,000	205,890	205,890	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	200,000	205,570	205,570	2025/12/20
第86回利付国債(20年)	2.3	140,000	145,161	145,161	2026/3/20
第89回利付国債(20年)	2.2	200,000	207,804	207,804	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	300,000	313,062	313,062	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	700,000	731,689	731,689	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	50,000	52,320	52,320	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	60,000	62,953	62,953	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	400,000	423,668	423,668	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	100,000	105,304	105,304	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	100,000	106,008	106,008	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	200,000	211,354	211,354	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	300,000	318,054	318,054	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	650,000	693,823	693,823	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	200,000	215,792	215,792	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	200,000	214,986	214,986	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	220,000	235,296	235,296	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	140,000	150,332	150,332	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	250,000	267,995	267,995	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	300,000	318,894	318,894	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	300,000	319,506	319,506	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	100,000	107,448	107,448	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	40,000	43,350	43,350	2029/6/20

銘柄	利	当 期 末			
		率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		
第112回利付国債(20年)	2.1	500,000	539,390	2029/6/20	
第113回利付国債(20年)	2.1	620,000	670,846	2029/9/20	
第114回利付国債(20年)	2.1	100,000	108,513	2029/12/20	
第115回利付国債(20年)	2.2	100,000	109,057	2029/12/20	
第116回利付国債(20年)	2.2	1,050,000	1,148,500	2030/3/20	
第117回利付国債(20年)	2.1	560,000	609,358	2030/3/20	
第118回利付国債(20年)	2.0	350,000	379,620	2030/6/20	
第119回利付国債(20年)	1.8	100,000	107,284	2030/6/20	
第120回利付国債(20年)	1.6	250,000	265,182	2030/6/20	
第121回利付国債(20年)	1.9	610,000	659,135	2030/9/20	
第122回利付国債(20年)	1.8	160,000	171,907	2030/9/20	
第123回利付国債(20年)	2.1	180,000	197,083	2030/12/20	
第124回利付国債(20年)	2.0	400,000	435,428	2030/12/20	
第125回利付国債(20年)	2.2	510,000	562,754	2031/3/20	
第126回利付国債(20年)	2.0	110,000	119,894	2031/3/20	
第127回利付国債(20年)	1.9	40,000	43,335	2031/3/20	
第128回利付国債(20年)	1.9	190,000	206,051	2031/6/20	
第129回利付国債(20年)	1.8	490,000	528,068	2031/6/20	
第130回利付国債(20年)	1.8	180,000	194,117	2031/9/20	
第131回利付国債(20年)	1.7	540,000	578,572	2031/9/20	
第132回利付国債(20年)	1.7	290,000	310,932	2031/12/20	
第133回利付国債(20年)	1.8	702,000	757,738	2031/12/20	
第134回利付国債(20年)	1.8	610,000	658,940	2032/3/20	
第135回利付国債(20年)	1.7	100,000	107,280	2032/3/20	
第136回利付国債(20年)	1.6	100,000	106,498	2032/3/20	
第137回利付国債(20年)	1.7	780,000	836,908	2032/6/20	
第138回利付国債(20年)	1.5	70,000	74,008	2032/6/20	
第139回利付国債(20年)	1.6	380,000	404,665	2032/6/20	
第140回利付国債(20年)	1.7	890,000	955,334	2032/9/20	
第141回利付国債(20年)	1.7	370,000	397,280	2032/12/20	
第142回利付国債(20年)	1.8	710,000	768,070	2032/12/20	
第143回利付国債(20年)	1.6	1,080,000	1,150,448	2033/3/20	
第144回利付国債(20年)	1.5	530,000	559,966	2033/3/20	
第145回利付国債(20年)	1.7	924,000	992,440	2033/6/20	
第146回利付国債(20年)	1.7	20,000	21,463	2033/9/20	
第147回利付国債(20年)	1.6	1,050,000	1,116,444	2033/12/20	
第148回利付国債(20年)	1.5	660,000	695,197	2034/3/20	
第149回利付国債(20年)	1.5	950,000	999,533	2034/6/20	
第150回利付国債(20年)	1.4	770,000	801,523	2034/9/20	
第151回利付国債(20年)	1.2	850,000	866,294	2034/12/20	
第152回利付国債(20年)	1.2	680,000	691,614	2035/3/20	
第153回利付国債(20年)	1.3	940,000	964,317	2035/6/20	
第154回利付国債(20年)	1.2	470,000	476,424	2035/9/20	
第155回利付国債(20年)	1.0	950,000	940,224	2035/12/20	
第156回利付国債(20年)	0.4	1,072,000	987,119	2036/3/20	
第157回利付国債(20年)	0.2	560,000	500,824	2036/6/20	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第158回利付国債(20年)	0.5	690,000	637,691	637,691	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	840,000	783,106	783,106	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	450,000	423,063	423,063	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,020,000	942,704	942,704	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	790,000	726,657	726,657	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	800,000	732,728	732,728	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,024,000	920,821	920,821	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	1,000,000	894,530	894,530	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	890,000	815,533	815,533	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	730,000	646,809	646,809	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	510,000	442,945	442,945	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	770,000	654,615	654,615	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	860,000	726,674	726,674	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	780,000	655,434	655,434	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	870,000	739,404	739,404	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	950,000	803,016	803,016	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	660,000	554,822	554,822	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,090,000	927,241	927,241	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	650,000	549,997	549,997	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	940,000	777,060	777,060	2041/6/20
第178回利付国債(20年)	0.5	870,000	728,633	728,633	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	890,000	741,779	741,779	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	600,000	525,330	525,330	2042/3/20
第181回利付国債(20年)	0.9	820,000	727,684	727,684	2042/6/20
第182回利付国債(20年)	1.1	1,020,000	933,728	933,728	2042/9/20
第183回利付国債(20年)	1.4	620,000	595,392	595,392	2042/12/20
第184回利付国債(20年)	1.1	1,060,000	964,388	964,388	2043/3/20
第185回利付国債(20年)	1.1	1,040,000	943,217	943,217	2043/6/20
第186回利付国債(20年)	1.5	850,000	823,437	823,437	2043/9/20
第187回利付国債(20年)	1.3	490,000	457,145	457,145	2043/12/20
第188回利付国債(20年)	1.6	350,000	342,769	342,769	2044/3/20
第1回大韓民国	0.475	100,000	99,995	99,995	2026/9/14
小計		192,472,000	185,003,769		
地方債証券					
第8回東京都公募公債(30年)	2.23	80,000	88,026	88,026	2038/9/17
第9回東京都公募公債(20年)	2.44	100,000	104,186	104,186	2026/6/19
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	106,792	106,792	2032/6/18
第750回東京都公募公債	0.444	100,000	100,157	100,157	2025/12/19
第753回東京都公募公債	0.065	150,000	149,076	149,076	2026/3/19
第792回東京都公募公債	0.05	100,000	97,314	97,314	2029/3/19
第1回神奈川県公募公債(30年)	2.54	100,000	114,265	114,265	2035/6/20
第12回神奈川県公募公債(20年)	2.19	100,000	108,113	108,113	2029/9/20
第26回神奈川県公募公債(20年)	1.477	20,000	20,778	20,778	2034/6/20
第40回神奈川県公募公債(20年)	0.2	100,000	82,416	82,416	2039/6/20
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	100,000	106,265	106,265	2033/9/27
第13回大阪府公募公債(20年)	1.203	100,000	100,177	100,177	2035/9/28

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
地方債証券	%			千円	
第176回大阪府公募公債(5年)	0.001	100,000	99,549	2025/10/29	
第187回大阪府公募公債(5年)	0.001	200,000	197,952	2026/9/29	
第412回大阪府公募公債	0.06	600,000	594,696	2026/9/29	
第449回大阪府公募公債	0.001	400,000	386,244	2029/10/30	
第451回大阪府公募公債	0.063	152,000	147,120	2029/12/26	
第466回大阪府公募公債	0.176	137,000	131,829	2031/3/20	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	0.327	100,000	89,517	2036/8/15	
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	110,949	2040/3/19	
第3回兵庫県公募公債(15年)	1.35	400,000	410,948	2027/7/16	
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	400,000	412,168	2028/5/26	
第6回兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	103,277	2028/7/14	
第15回兵庫県公募公債(20年)	1.64	200,000	211,962	2032/7/23	
平成27年度第10回静岡県公募公債	0.461	100,000	100,237	2025/9/19	
平成20年度第2回愛知県公募公債(20年)	2.46	100,000	107,732	2028/6/20	
平成25年度第5回愛知県公募公債(15年)	1.339	200,000	206,370	2028/6/19	
平成26年度第4回愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	104,594	2034/5/15	
第3回埼玉県公募公債	0.875	100,000	99,006	2033/10/18	
第4回埼玉県公募公債	0.995	100,000	99,764	2034/5/19	
平成22年度第1回福岡県公募公債(20年)	1.77	100,000	106,565	2030/8/19	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	1.491	500,000	513,145	2026/11/27	
第13回千葉県公募公債(20年)	1.701	200,000	212,990	2032/10/15	
令和4年度第6回千葉県公募公債	0.554	200,000	194,224	2032/12/24	
令和5年度第8回千葉県公募公債	0.875	100,000	99,004	2033/10/25	
第13回群馬県公募公債	0.486	300,000	300,738	2025/11/25	
平成27年度第1回大分県公募公債	0.476	200,000	200,484	2025/10/30	
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	100,199	2025/12/25	
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	198,042	2026/11/25	
第165回共同発行市場公募地方債	0.145	500,000	496,110	2026/12/25	
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	297,831	2027/1/25	
第214回共同発行市場公募地方債	0.13	100,000	96,073	2031/1/24	
第222回共同発行市場公募地方債	0.115	100,000	95,130	2031/9/25	
第227回共同発行市場公募地方債	0.244	100,000	95,571	2032/2/25	
平成27年度第1回長崎県公募公債	0.515	200,000	200,620	2025/9/30	
平成28年度第2回島根県公募公債(20年)	0.506	100,000	91,333	2036/9/30	
平成27年度第2回熊本県公募公債	0.476	200,000	200,484	2025/10/30	
令和3年度第1回熊本市公募公債	0.13	100,000	95,034	2031/11/26	
平成27年度第1回新潟市公募公債	0.464	10,000	10,019	2025/12/24	
令和3年度第1回静岡市公募公債	0.16	200,000	190,498	2031/11/25	
令和3年度第1回大阪市公募公債(5年)	0.01	300,000	297,531	2026/5/21	
令和6年度第2回大阪市公募公債	0.995	100,000	99,718	2034/5/22	
第1回名古屋市公募公債(30年)	2.53	100,000	114,100	2035/3/20	
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	2.08	100,000	106,686	2028/12/20	
第22回横浜市公募公債(20年)	1.895	200,000	214,726	2030/9/13	
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	100,000	100,326	2025/8/18	
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	108,104	2031/7/29	
平成26年度第5回札幌市公募公債	0.961	100,000	101,635	2029/9/20	

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		
令和3年度第9回札幌市公募公債(5年)	0.046	500,000	494,870	2026/12/18	
第6回川崎市公募公債(20年)	2.21	100,000	107,818	2029/5/25	
第9回川崎市公募公債(20年)	2.15	100,000	108,680	2030/5/24	
平成23年度第4回福岡市公募公債(20年)	1.89	100,000	107,718	2031/8/19	
2021年度第5回福岡市公募公債	0.135	100,000	95,183	2031/10/28	
平成30年度第5回広島市公募公債	0.195	300,000	294,546	2028/12/25	
平成30年度第3回千葉市公募公債	0.259	10,000	9,854	2028/11/22	
第148回福岡北九州高速道路債券(20年)	0.731	100,000	91,451	2037/3/19	
<b>小計</b>		10,959,000	11,038,521		
<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	102,043	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	104,088	2034/6/30	
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	99,511	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	105,263	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	98,500	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	89,853	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	195,632	2029/1/31	
第76回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.425	500,000	501,160	2025/9/12	
第78回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.381	13,000	13,017	2025/11/18	
第101回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.17	118,000	116,844	2027/10/15	
第102回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.16	122,000	120,714	2027/11/15	
第17回政府保証民間都市開発債券	0.145	200,000	199,250	2026/2/26	
第4回政府保証新関西国際空港債券	0.484	378,000	379,141	2025/6/13	
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	114,068	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	107,515	2028/9/20	
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	85,160	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	54,081	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	99,108	2035/3/20	
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	100,156	2035/6/20	
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	117,315	2034/3/24	
第8回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	2.043	100,000	107,867	2030/6/28	
第11回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.851	100,000	106,862	2030/10/28	
第16回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.846	100,000	107,032	2031/8/28	
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.32	900,000	949,689	2027/6/18	
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	106,669	2028/4/25	
第24回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.702	100,000	106,014	2032/9/28	
第48回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.121	100,000	98,284	2035/12/28	
F 89回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.602	100,000	103,463	2027/8/20	
F 149回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.145	100,000	101,202	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	29,986	29,652	2033/1/10	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	28,506	29,523	2044/6/10	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	16,781	17,326	2045/5/10	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	47,784	49,373	2046/5/10	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	50,670	52,109	2046/7/10	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	30,567	30,812	2047/11/10	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	96,774	98,421	2048/7/10	

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	86,740	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	85,176	85,828	2048/11/10
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.0	99,807	99,894	2049/3/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	105,612	105,645	2049/6/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	88,430	85,747	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	321,858	2032/2/13
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	300,000	307,878	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	54,287	53,057	2050/12/10
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	117,662	111,756	2051/4/10
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.23	316,575	296,890	2051/7/10
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	66,895	62,956	2052/5/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	136,626	128,398	2052/10/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	140,210	131,160	2053/5/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	72,003	67,181	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	73,001	68,328	2053/9/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	75,866	70,027	2054/4/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.15	312,540	284,220	2054/9/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.34	323,168	297,670	2055/2/10
第156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	162,764	149,835	2055/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	86,998	80,055	2056/6/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	89,509	82,960	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,137	83,264	2057/4/10
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.09	94,067	91,859	2058/3/10
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	189,668	184,226	2058/4/10
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.96	95,563	92,807	2058/6/10
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.94	95,875	92,948	2058/7/10
第321回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.01	300,000	296,652	2026/9/18
第84回中日本高速道路		0.07	100,000	99,699	2025/7/10
第30回西日本高速道路		0.17	130,000	129,126	2026/5/22
小計			8,970,507	8,945,401	
<b>金融債券</b>					
い第853号商工債券		0.09	100,000	98,900	2026/6/26
い第854号商工債券		0.08	100,000	98,835	2026/7/27
い第863号商工債券		0.22	200,000	197,414	2027/4/27
小計			400,000	395,149	
<b>普通社債券</b>					
第503回中部電力		0.584	10,000	10,018	2025/3/25
第554回関西電力		0.41	200,000	199,696	2025/10/24
第448回中国電力		0.92	100,000	97,193	2033/5/25
第513回東北電力		0.31	100,000	96,719	2029/10/25
第525回東北電力		0.22	100,000	98,265	2027/10/25
第552回東北電力		0.864	100,000	99,998	2028/12/25
第484回九州電力		0.375	100,000	96,934	2029/11/22
第325回北海道電力		1.264	100,000	101,483	2030/10/25
第357回北海道電力		0.475	100,000	97,860	2029/5/25
第21回新関西国際空港		1.017	100,000	79,289	2048/9/18

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券	%			千円	
第24回成田国際空港	0.25	100,000	98,697	98,697	2027/12/17
第27回成田国際空港	0.657	200,000	178,002	178,002	2038/3/12
第13回キリンホールディングス	0.23	100,000	96,558	96,558	2029/9/5
第9回サントリーホールディングス	0.3	100,000	99,059	99,059	2027/6/8
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,513	99,513	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	100,000	98,141	98,141	2028/9/8
第15回日本たばこ産業	0.713	200,000	197,774	197,774	2030/4/19
第13回ヒューリック	0.569	200,000	199,556	199,556	2027/4/16
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	99,515	99,515	2025/12/19
第9回クラレ	0.34	100,000	98,993	98,993	2027/4/30
第37回昭和電工	0.51	200,000	197,572	197,572	2027/4/28
第46回三井化学	0.37	200,000	197,676	197,676	2027/7/23
第10回テルモ	0.519	100,000	99,776	99,776	2027/4/23
第13回ヤフー	0.46	100,000	95,042	95,042	2029/7/31
第18回Zホールディングス	0.9	300,000	288,744	288,744	2030/6/11
第20回Zホールディングス(グリーン)	0.46	100,000	96,432	96,432	2028/7/28
第22回Zホールディングス	0.76	100,000	98,608	98,608	2027/9/15
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	98,975	98,975	2027/5/20
第9回新日本製鐵	0.385	100,000	98,114	98,114	2028/6/20
第1回住友生命2023基金	0.705	100,000	98,456	98,456	2028/8/8
第14回LIXIL	0.475	100,000	98,838	98,838	2027/8/27
第4回日本郵政	0.603	200,000	198,638	198,638	2028/10/24
第30回ダイキン工業	0.459	100,000	97,766	97,766	2029/7/27
第7回ジェイテクト	0.345	100,000	98,278	98,278	2028/3/8
第36回三菱重工業(グリーン)	0.14	300,000	298,251	298,251	2025/11/21
第14回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.574	200,000	199,468	199,468	2027/4/19
第31回トヨタ自動車(サステナビリティ)	0.735	100,000	96,590	96,590	2033/6/1
第18回アイシン精機	0.28	100,000	98,661	98,661	2027/9/6
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,946	99,946	2024/8/2
第7回アシックス	0.792	100,000	99,451	99,451	2028/12/14
第114回丸紅	0.614	200,000	199,296	199,296	2028/2/24
第63回三井物産	2.37	100,000	104,969	104,969	2027/4/23
第55回住友商事	0.33	200,000	196,764	196,764	2028/4/13
第61回住友商事	0.644	100,000	99,684	99,684	2028/3/1
第41回丸井グループ	0.54	100,000	99,170	99,170	2027/8/31
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	99,861	99,861	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	97,223	97,223	2028/5/31
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	101,442	101,442	2025/11/12
第33回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.21	200,000	204,584	204,584	2026/6/9
第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ)	0.808	100,000	99,792	99,792	2028/10/27
第7回みずほリース	0.33	200,000	196,636	196,636	2028/1/20
第22回みずほリース(サステナビリティ)	0.639	200,000	198,526	198,526	2028/6/12
第18回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.38	200,000	193,384	193,384	2030/9/20
第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	0.838	100,000	97,077	97,077	2033/6/20
第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	0.614	200,000	198,634	198,634	2028/9/20
第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	0.86	200,000	199,330	199,330	2030/9/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券	%			千円	
第56回日産フィナンシャルサービス	0.52	100,000	98,900	98,900	2026/6/19
第102回トヨタファイナンス	0.414	200,000	199,158	199,158	2027/4/9
第103回トヨタファイナンス	0.617	200,000	198,690	198,690	2029/4/11
第24回ポケットカード	0.898	100,000	99,207	99,207	2028/11/22
第34回三井住友ファイナンス&リース	0.43	100,000	99,710	99,710	2026/2/2
第3回野村ホールディングス	0.28	100,000	98,550	98,550	2026/9/4
第83回三井不動産（グリーン）	0.81	100,000	96,228	96,228	2033/6/6
第111回住友不動産（グリーン）	0.52	100,000	99,058	99,058	2028/4/28
第78回東急行電鉄	1.528	100,000	103,183	103,183	2028/6/12
第57回東日本旅客鉄道	2.376	100,000	107,258	107,258	2028/12/12
第73回東日本旅客鉄道	2.098	200,000	215,156	215,156	2030/12/20
第184回東日本旅客鉄道	0.21	100,000	99,688	99,688	2025/10/14
第68回東海旅客鉄道	1.584	100,000	103,087	103,087	2034/4/24
第73回東海旅客鉄道	1.014	100,000	96,847	96,847	2035/1/26
第13回東京地下鉄	1.702	100,000	104,951	104,951	2032/5/25
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,229	99,229	2026/2/26
第31回KDDI（サステナビリティ）	0.43	100,000	98,927	98,927	2027/10/27
第7回ソフトバンク	0.58	100,000	94,899	94,899	2030/7/29
第9回ソフトバンク	0.48	400,000	390,648	390,648	2027/12/3
第13回ソフトバンク	0.52	100,000	93,014	93,014	2031/6/3
第15回ソフトバンク	0.41	100,000	96,396	96,396	2028/10/12
第84回電源開発	0.754	300,000	299,940	299,940	2028/2/18
第86回電源開発	0.93	100,000	97,217	97,217	2033/5/20
第89回電源開発（グリーン）	1.121	100,000	98,258	98,258	2034/4/20
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	199,200	199,200	2027/1/27
第45回東京電力パワーグリッド	0.8	100,000	96,464	96,464	2031/4/22
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	198,522	198,522	2027/4/26
第50回東京電力パワーグリッド	0.94	100,000	96,135	96,135	2032/4/26
第16回JERA	0.64	100,000	99,140	99,140	2028/4/25
第17回JERA	0.9	100,000	99,019	99,019	2030/4/25
第22回JERA	0.5	300,000	298,062	298,062	2027/2/25
第13回広島ガス	0.405	100,000	97,888	97,888	2028/9/13
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	100,461	100,461	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,918	99,918	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	98,758	98,758	2026/10/21
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	98,313	98,313	2026/12/16
第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.713	100,000	99,563	99,563	2026/7/13
第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.914	100,000	98,909	98,909	2028/7/13
第4回フランス預金供託公庫	0.725	100,000	100,089	100,089	2024/7/30
第1回サンタンデール銀行（2019）	0.463	100,000	99,793	99,793	2024/12/5
小計		12,710,000	12,553,350		
合計		225,511,507	217,936,191		

## 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	百万円
			287	—

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 217,936,191	% 98.4
コール・ローン等、その他	3,584,510	1.6
投資信託財産総額	221,520,701	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	221,520,701,427
公社債(評価額)	782,188,470
未収入金	217,936,191,751
未収利息	2,366,683,700
前払費用	346,000,702
差入委託拠金	83,589,455
	6,047,349
(B) 負債	1,696,597,904
未払金	203,621,870
未払解約金	1,492,976,034
(C) 純資産総額(A-B)	219,824,103,523
元本	241,193,376,071
次期繰越損益金	△ 21,369,272,548
(D) 受益権総口数	241,193,376,071口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,114円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 303,911,087,355円  
 期中追加設定元本額 295,729,017,440円  
 期中一部解約元本額 358,446,728,724円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9114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)	135,970,177,104円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	24,296,315,857円
ファンド・マネジャー (国内債券)	19,523,670,373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)	18,867,767,859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)	16,589,216,480円
三菱UFJ D C バランス・イノベーション (KAKUSHIN)	7,341,983,434円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	5,314,664,693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)	5,269,365,210円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	4,708,424,155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)	2,528,624,818円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	569,841,430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)	155,399,014円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	37,582,423円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	20,343,221円
合計	241,193,376,071円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は21,369,272,548円です。

## ○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	1,568,617,464
支払利息	1,569,721,549
(B) 有価証券売買損益	△ 1,104,085
売買益	△ 9,643,800,680
売買損	513,561,082
(C) 先物取引等取引損益	△10,157,361,762
取引益	△ 4,354,960
取引損	2,252,520
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,079,538,176
(E) 前期繰越損益金	△14,984,198,566
(F) 追加信託差損益金	△22,049,184,589
(G) 解約差損益金	23,743,648,783
(H) 計(D+E+F+G)	△21,369,272,548
次期繰越損益金(H)	△21,369,272,548

(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算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]

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)