

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（2009年2月2日設定） | |
| 運用方針 | 日本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、NOMURA-BPI 総合に概ね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 | ベビーフンド | 日本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。 |
| | 日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーフンド | 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 |
| | 日本債券インデックスマザーファンド | 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・配当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。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。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。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。 | |

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド



第60期（決算日：2024年4月26日）

第61期（決算日：2024年7月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「三菱UFJ 国内債券インデックスファンド」は、去る7月26日に第61期の決算を行いましたので、法令に基づいて第60期～第61期の運用状況をまとめて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10期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | NOMURA-BPI総合 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|---------------|------|----|------|--------------|------|--------|--------|-------|
| | | 税分 | 込配 | み金 | 期騰落率 | 期騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 52期(2022年4月26日) | 9,794 | | 30 | △1.7 | 379.46 | △1.6 | 99.6 | 0.1 | 3,041 |
| 53期(2022年7月26日) | 9,719 | | 30 | △0.5 | 378.13 | △0.4 | 99.8 | 0.1 | 2,895 |
| 54期(2022年10月26日) | 9,480 | | 30 | △2.2 | 370.30 | △2.1 | 99.6 | 0.1 | 2,801 |
| 55期(2023年1月26日) | 9,377 | | 30 | △0.8 | 367.70 | △0.7 | 99.5 | 0.1 | 2,716 |
| 56期(2023年4月26日) | 9,488 | | 30 | 1.5 | 373.34 | 1.5 | 99.5 | 0.1 | 2,663 |
| 57期(2023年7月26日) | 9,496 | | 30 | 0.4 | 375.27 | 0.5 | 99.7 | 0.1 | 2,618 |
| 58期(2023年10月26日) | 9,094 | | 30 | △3.9 | 360.86 | △3.8 | 99.7 | 0.1 | 2,484 |
| 59期(2024年1月26日) | 9,201 | | 15 | 1.3 | 366.05 | 1.4 | 99.6 | 0.1 | 2,329 |
| 60期(2024年4月26日) | 9,053 | | 15 | △1.4 | 361.19 | △1.3 | 99.3 | 0.4 | 2,185 |
| 61期(2024年7月26日) | 8,938 | | 15 | △1.1 | 357.56 | △1.0 | 99.2 | 0.3 | 2,090 |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | | NOMURA-BPI総合 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|------|--------------------|-------|------|--------------|------|--------|--------|
| | | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| 第60期 | (期首) 2024年1月26日 | 9,201 | — | 366.05 | — | 99.6 | 0.1 |
| | 1月末 | 9,192 | △0.1 | 365.75 | △0.1 | 101.0 | 0.1 |
| | 2月末 | 9,218 | 0.2 | 366.90 | 0.2 | 100.5 | 0.1 |
| | 3月末 | 9,205 | 0.0 | 366.50 | 0.1 | 100.6 | 0.1 |
| | (期末) 2024年4月26日 | 9,068 | △1.4 | 361.19 | △1.3 | 99.3 | 0.4 |
| 第61期 | (期首) 2024年4月26日 | 9,053 | — | 361.19 | — | 99.3 | 0.4 |
| | 4月末 | 9,081 | 0.3 | 362.35 | 0.3 | 99.5 | 0.4 |
| | 5月末 | 8,933 | △1.3 | 356.53 | △1.3 | 99.7 | 0.4 |
| | 6月末 | 8,955 | △1.1 | 357.51 | △1.0 | 99.9 | 0.4 |
| | (期末) 2024年7月26日 | 8,953 | △1.1 | 357.56 | △1.0 | 99.2 | 0.3 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、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60期～第61期：2024年1月27日～2024年7月26日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|----------|--------|
| 第 60 期 首 | 9,201円 |
| 第 61 期 末 | 8,938円 |
| 既払分配金 | 30円 |
| 騰 落 率 | -2.5% |

(分配金再投資ベース)

※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2.5%（分配金再投資ベース）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（-2.3%）を0.2%下回りました。

> 基準価額の主な変動要因**下落要因**

ベンチマークに概ね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60期～第61期：2024年1月27日～2024年7月26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ました。その後、日銀のマイナス金利解除や更なる金融引き締めに対する警戒感などから下落し、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

▶ 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド

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（分配金再投資ベース）はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 日本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。

第60期～第61期：2024/1/27～2024/7/26

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ▶ **三菱UFJ 国内債券インデックスファンド**
ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.2\%$ 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 $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

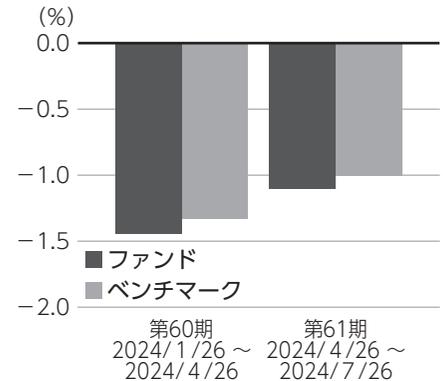
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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：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。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

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60期 | 第61期 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2024年1月27日～2024年4月26日 | 2024年4月27日～2024年7月26日 |
| 当期分配金（対基準価額比率） | 15 (0.165%) | 15 (0.168%) |
| 当期の収益 | 7 | 7 |
| 当期の収益以外 | 7 | 7 |
| 翌期繰越分配対象額 | 452 | 445 |

(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。)

▶ **三菱UFJ 国内債券インデックスファンド**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **日本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概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

2024年1月27日～2024年7月26日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第60期～第61期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 17 | 0.192 | (a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数) |
| (投 信 会 社) | (7) | (0.082) | 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) | (0.082) | 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) | (2) | (0.027) | 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 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成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 | 0.002 | (c) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数 |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.002) | 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 | 17 | 0.194 | |

作成期中の平均基準価額は、9,082円です。

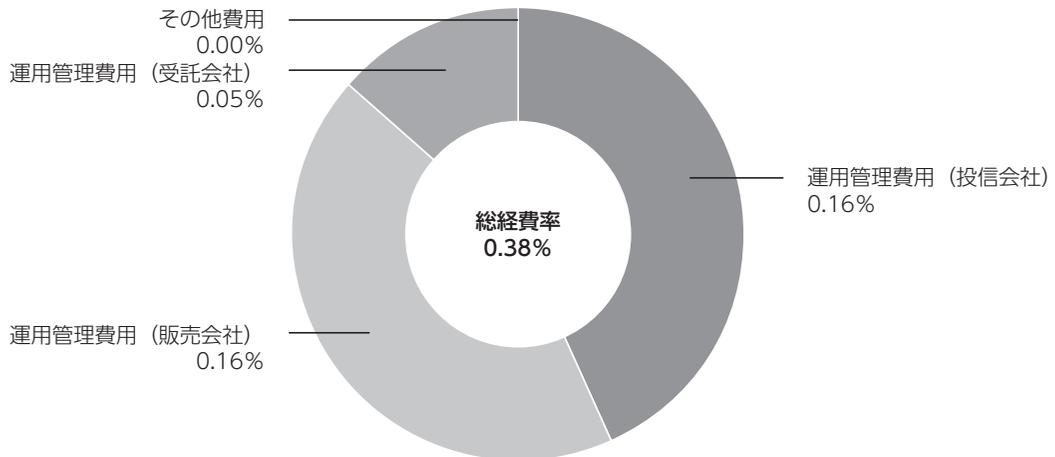
- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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）を作成期間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

当作成対象期間の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.38%**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1月27日～2024年7月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第60期～第61期 | | | |
|-------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 千口 62,660 | 千円 79,526 | 千口 210,787 | 千円 266,316 |

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2024年7月26日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 国内債券インデックスファンド>

該当事項はございません。

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 第60期～第61期 | | | | | |
|-----|--------------------|---------------|------|--------------------|---------------|------|
| | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 公社債 | 百万円 331,655 | 百万円 56,620 | 17.1 | 百万円 129,495 | 百万円 23,449 | 18.1 |

平均保有割合 0.2%

※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みません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 種 類 | 第60期～第61期 | | |
|-----|------------|------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 第61期末保有額 |
| 公社債 | 百万円 494 | 百万円 299 | 百万円 2,110 |

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 種 類 | 第60期～第61期 | |
|-----|-----------|---------------|
| | 買 付 | 額 |
| 公社債 | | 百万円 12,101 |

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年7月26日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第59期末 | 第61期末 | |
|-------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 千口 1,827,705 | 千口 1,679,579 | 千円 2,090,740 |

○投資信託財産の構成

(2024年7月26日現在)

| 項 目 | 第61期末 | |
|-------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 千円 2,090,740 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 6,407 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 2,097,147 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第60期末 | 第61期末 |
|------------------------|----------------|----------------|
| | 2024年4月26日現在 | 2024年7月26日現在 |
| | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,208,938,415 | 2,097,147,675 |
| コール・ローン等 | 2,457,668 | 2,175,809 |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 2,184,872,825 | 2,090,740,074 |
| 未収入金 | 21,607,918 | 4,231,789 |
| 未収利息 | 4 | 3 |
| (B) 負債 | 23,862,162 | 6,213,538 |
| 未払収益分配金 | 3,620,591 | 3,508,939 |
| 未払解約金 | 18,042,062 | 639,073 |
| 未払信託報酬 | 2,182,081 | 2,049,159 |
| その他未払費用 | 17,428 | 16,367 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,185,076,253 | 2,090,934,137 |
| 元本 | 2,413,727,920 | 2,339,293,289 |
| 次期繰越損益金 | △ 228,651,667 | △ 248,359,152 |
| (D) 受益権総口数 | 2,413,727,920口 | 2,339,293,289口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,053円 | 8,938円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第60期 | 第61期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2024年1月27日～ 2024年4月26日 | 2024年4月27日～ 2024年7月26日 |
| | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 386 | 357 |
| 受取利息 | 400 | 357 |
| 支払利息 | △ 14 | — |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 29,991,176 | △ 20,884,495 |
| 売買益 | 547,109 | 896,192 |
| 売買損 | △ 30,538,285 | △ 21,780,687 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,199,509 | △ 2,065,526 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 32,190,299 | △ 22,949,664 |
| (E) 前期繰越損益金 | △183,506,726 | △206,750,275 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 9,334,051 | △ 15,150,274 |
| (配当等相当額) | (110,789,519) | (105,826,271) |
| (売買損益相当額) | (△120,123,570) | (△120,976,545) |
| (G) 計(D+E+F) | △225,031,076 | △244,850,213 |
| (H) 収益分配金 | △ 3,620,591 | △ 3,508,939 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △228,651,667 | △248,359,152 |
| 追加信託差損益金 | △ 10,953,759 | △ 16,875,169 |
| (配当等相当額) | (109,193,571) | (104,111,402) |
| (売買損益相当額) | (△120,147,330) | (△120,986,571) |
| 繰越損益金 | △217,697,908 | △231,483,983 |

(注) (B)有価証券売買損益は各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。

<注記事項>

- ①作成期首(前作成期末)元本額 2,532,245,001円
 作成期中追加設定元本額 185,779,792円
 作成期中一部解約元本額 378,731,504円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8938円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は248,359,152円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2024年1月27日～ 2024年4月26日 | 2024年4月27日～ 2024年7月26日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 1,832,770円 | 1,784,044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 | —円 |
| 収益調整金額 | 110,813,279円 | 105,836,297円 |
| 分配準備積立金額 | 168,113円 | —円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 112,814,162円 | 107,620,341円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 467円 | 460円 |
| 1万口当たり分配金額 | 15円 | 15円 |
| 収益分配金金額 | 3,620,591円 | 3,508,939円 |

○分配金のお知らせ

| | 第60期 | 第61期 |
|------------------|------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 15円 | 15円 |

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

*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。

日本債券インデックスマザーファンド

《第23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]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23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23期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 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。投資成果をNOMURA-BPI総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 |
| 主要運用対象 | NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資は行いません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | NOMURA-BPI総合 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|--------|-------|--------------|-------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 19期(2020年5月12日) | 13,524 | 0.2% | 388.75 | 0.2% | 99.6% | 0.1% | 630,705 |
| 20期(2021年5月12日) | 13,462 | △0.5% | 386.93 | △0.5% | 99.5% | 0.2% | 314,171 |
| 21期(2022年5月12日) | 13,195 | △2.0% | 379.29 | △2.0% | 99.7% | 0.1% | 666,754 |
| 22期(2023年5月12日) | 13,084 | △0.8% | 375.76 | △0.9% | 99.6% | 0.1% | 723,477 |
| 23期(2024年5月13日) | 12,543 | △4.1% | 360.26 | △4.1% | 99.4% | 0.4% | 920,650 |

(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。

○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) 2023年 5月12日 | 円 13,084 | % — | 375.76 | % — | 99.6 | 0.1 |
| 5月末 | 13,069 | △0.1 | 375.27 | △0.1 | 100.6 | 0.1 |
| 6月末 | 13,101 | 0.1 | 376.29 | 0.1 | 101.0 | 0.1 |
| 7月末 | 12,898 | △1.4 | 370.43 | △1.4 | 99.8 | 0.1 |
| 8月末 | 12,805 | △2.1 | 367.76 | △2.1 | 99.9 | 0.1 |
| 9月末 | 12,714 | △2.8 | 365.13 | △2.8 | 99.7 | 0.1 |
| 10月末 | 12,512 | △4.4 | 359.31 | △4.4 | 99.2 | 0.1 |
| 11月末 | 12,776 | △2.4 | 366.88 | △2.4 | 100.3 | 0.0 |
| 12月末 | 12,829 | △1.9 | 368.38 | △2.0 | 99.7 | 0.1 |
| 2024年 1月末 | 12,735 | △2.7 | 365.75 | △2.7 | 101.0 | 0.1 |
| 2月末 | 12,775 | △2.4 | 366.90 | △2.4 | 100.5 | 0.1 |
| 3月末 | 12,760 | △2.5 | 366.50 | △2.5 | 100.6 | 0.1 |
| 4月末 | 12,614 | △3.6 | 362.35 | △3.6 | 99.5 | 0.4 |
| (期 末) 2024年 5月13日 | 12,543 | △4.1 | 360.26 | △4.1 | 99.4 | 0.4 |

(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

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−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

- ・ 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、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)

- ・ 評価時価差異[※]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)

- ・ 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

(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、12,813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

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|-------|-------------|----------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 384,256,743 | 177,764,642 |
| | 地方債証券 | 16,956,546 | 7,211,864 (70,000) |
| 内 | 特殊債券 | 12,540,611 | 7,067,950 (783,677) |
| | 社債券 | 35,789,366 | 21,005,130 (1,300,000) |

(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 6,716 | 百万円 4,108 | 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | 百万円 | % | | 百万円 | % |
| 公社債 | 449,543 | 94,047 | 20.9 | 213,049 | 39,969 | 18.8 |

(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 1,094 | 百万円 2,699 | 百万円 2,111 |

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 18,201 |

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

(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 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 807,394,000 (200,000) | 772,173,696 (200,278) | 83.9 (0.0) | — (—) | 55.3 (—) | 19.6 (0.0) | 9.0 (—) |
| 地方債証券 | 48,280,400 (48,280,400) | 48,581,318 (48,581,318) | 5.3 (5.3) | — (—) | 2.1 (2.1) | 1.9 (1.9) | 1.3 (1.3) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 34,900,958 (34,900,958) | 34,758,179 (34,758,179) | 3.8 (3.8) | — (—) | 1.9 (1.9) | 1.2 (1.2) | 0.7 (0.7) |
| 金融債券 | 2,900,000 (2,900,000) | 2,867,778 (2,867,778) | 0.3 (0.3) | — (—) | 0.0 (0.0) | 0.2 (0.2) | 0.1 (0.1) |
| 普通社債券 | 56,900,000 (56,900,000) | 56,319,048 (56,319,048) | 6.1 (6.1) | 0.0 (0.0) | 1.3 (1.3) | 3.9 (3.9) | 0.9 (0.9) |
| 合 計 | 950,375,358 (143,181,358) | 914,700,021 (142,726,602) | 99.4 (15.5) | 0.0 (0.0) | 60.7 (5.4) | 26.8 (7.2) | 11.9 (2.9) |

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当期末 | | |
|---------------|-------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| | % | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | | | |
| 第449回利付国債(2年) | 0.005 | 3,720,000 | 3,714,717 |
| 第450回利付国債(2年) | 0.005 | 1,300,000 | 1,297,933 |
| 第451回利付国債(2年) | 0.005 | 5,800,000 | 5,788,690 |
| 第452回利付国債(2年) | 0.005 | 3,100,000 | 3,092,529 |
| 第453回利付国債(2年) | 0.005 | 4,600,000 | 4,586,660 |
| 第454回利付国債(2年) | 0.1 | 3,550,000 | 3,542,971 |
| 第455回利付国債(2年) | 0.005 | 1,550,000 | 1,544,001 |
| 第456回利付国債(2年) | 0.1 | 5,100,000 | 5,085,873 |
| 第457回利付国債(2年) | 0.1 | 5,710,000 | 5,691,385 |
| 第458回利付国債(2年) | 0.2 | 6,400,000 | 6,388,544 |
| 第144回利付国債(5年) | 0.1 | 6,380,000 | 6,376,491 |
| 第145回利付国債(5年) | 0.1 | 6,410,000 | 6,401,731 |
| 第146回利付国債(5年) | 0.1 | 4,450,000 | 4,438,964 |
| 第147回利付国債(5年) | 0.005 | 5,830,000 | 5,798,343 |
| 第148回利付国債(5年) | 0.005 | 8,200,000 | 8,143,502 |
| 第149回利付国債(5年) | 0.005 | 11,570,000 | 11,479,406 |
| 第150回利付国債(5年) | 0.005 | 1,630,000 | 1,615,493 |
| 第151回利付国債(5年) | 0.005 | 50,000 | 49,492 |
| 第152回利付国債(5年) | 0.1 | 5,480,000 | 5,439,009 |
| 第153回利付国債(5年) | 0.005 | 5,620,000 | 5,555,370 |
| 第154回利付国債(5年) | 0.1 | 10,230,000 | 10,130,052 |
| 第155回利付国債(5年) | 0.3 | 2,850,000 | 2,838,343 |
| 第156回利付国債(5年) | 0.2 | 8,050,000 | 7,988,498 |
| 第157回利付国債(5年) | 0.2 | 2,020,000 | 2,002,022 |
| 第158回利付国債(5年) | 0.1 | 8,740,000 | 8,629,089 |
| 第159回利付国債(5年) | 0.1 | 1,980,000 | 1,951,686 |
| 第160回利付国債(5年) | 0.2 | 2,850,000 | 2,820,730 |
| 第161回利付国債(5年) | 0.3 | 3,820,000 | 3,796,125 |
| 第162回利付国債(5年) | 0.3 | 190,000 | 188,500 |
| 第163回利付国債(5年) | 0.4 | 13,900,000 | 13,849,543 |
| 第164回利付国債(5年) | 0.2 | 1,900,000 | 1,873,077 |
| 第165回利付国債(5年) | 0.3 | 5,600,000 | 5,545,848 |
| 第166回利付国債(5年) | 0.4 | 2,100,000 | 2,089,605 |
| 第167回利付国債(5年) | 0.4 | 750,000 | 745,035 |
| 第1回利付国債(40年) | 2.4 | 2,105,000 | 2,327,393 |
| 第2回利付国債(40年) | 2.2 | 1,335,000 | 1,420,586 |
| 第3回利付国債(40年) | 2.2 | 1,668,000 | 1,770,081 |
| 第4回利付国債(40年) | 2.2 | 1,838,000 | 1,942,931 |
| 第5回利付国債(40年) | 2.0 | 1,525,000 | 1,541,531 |
| 第6回利付国債(40年) | 1.9 | 1,230,000 | 1,209,705 |
| 第7回利付国債(40年) | 1.7 | 1,540,000 | 1,441,517 |
| 第8回利付国債(40年) | 1.4 | 2,110,000 | 1,821,541 |
| 第9回利付国債(40年) | 0.4 | 3,630,000 | 2,262,288 |
| 第10回利付国債(40年) | 0.9 | 3,000,000 | 2,195,610 |

| 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11回利付国債 (40年) | 0.8 | 3,080,000 | 2,155,568 | 2058/3/20 |
| 第12回利付国債 (40年) | 0.5 | 2,570,000 | 1,584,687 | 2059/3/20 |
| 第13回利付国債 (40年) | 0.5 | 3,170,000 | 1,924,094 | 2060/3/20 |
| 第14回利付国債 (40年) | 0.7 | 3,590,000 | 2,323,842 | 2061/3/20 |
| 第15回利付国債 (40年) | 1.0 | 4,200,000 | 2,995,188 | 2062/3/20 |
| 第16回利付国債 (40年) | 1.3 | 4,000,000 | 3,121,680 | 2063/3/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 4,020,000 | 4,031,014 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 3,470,000 | 3,479,577 | 2025/9/20 |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3 | 3,320,000 | 3,322,357 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1 | 2,570,000 | 2,560,542 | 2026/3/20 |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,870,000 | 4,846,088 | 2026/6/20 |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,620,000 | 4,594,081 | 2026/9/20 |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,340,000 | 6,299,107 | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,130,000 | 6,084,147 | 2027/3/20 |
| 第347回利付国債 (10年) | 0.1 | 5,700,000 | 5,651,037 | 2027/6/20 |
| 第348回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,970,000 | 4,921,443 | 2027/9/20 |
| 第349回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,090,000 | 6,021,852 | 2027/12/20 |
| 第350回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,530,000 | 6,447,134 | 2028/3/20 |
| 第351回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,870,000 | 4,800,359 | 2028/6/20 |
| 第352回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,110,000 | 4,042,513 | 2028/9/20 |
| 第353回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,630,000 | 4,543,604 | 2028/12/20 |
| 第354回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,320,000 | 6,191,514 | 2029/3/20 |
| 第355回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,040,000 | 5,908,026 | 2029/6/20 |
| 第356回利付国債 (10年) | 0.1 | 8,080,000 | 7,890,847 | 2029/9/20 |
| 第357回利付国債 (10年) | 0.1 | 4,150,000 | 4,046,291 | 2029/12/20 |
| 第358回利付国債 (10年) | 0.1 | 9,440,000 | 9,186,158 | 2030/3/20 |
| 第359回利付国債 (10年) | 0.1 | 9,350,000 | 9,080,159 | 2030/6/20 |
| 第360回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,340,000 | 6,140,353 | 2030/9/20 |
| 第361回利付国債 (10年) | 0.1 | 9,410,000 | 9,088,083 | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債 (10年) | 0.1 | 7,240,000 | 6,971,975 | 2031/3/20 |
| 第363回利付国債 (10年) | 0.1 | 6,320,000 | 6,067,516 | 2031/6/20 |
| 第364回利付国債 (10年) | 0.1 | 9,170,000 | 8,775,965 | 2031/9/20 |
| 第365回利付国債 (10年) | 0.1 | 11,820,000 | 11,275,452 | 2031/12/20 |
| 第366回利付国債 (10年) | 0.2 | 6,090,000 | 5,837,325 | 2032/3/20 |
| 第367回利付国債 (10年) | 0.2 | 8,390,000 | 8,016,141 | 2032/6/20 |
| 第368回利付国債 (10年) | 0.2 | 9,730,000 | 9,265,587 | 2032/9/20 |
| 第369回利付国債 (10年) | 0.5 | 8,320,000 | 8,106,009 | 2032/12/20 |
| 第370回利付国債 (10年) | 0.5 | 9,000,000 | 8,744,310 | 2033/3/20 |
| 第371回利付国債 (10年) | 0.4 | 8,410,000 | 8,076,627 | 2033/6/20 |
| 第372回利付国債 (10年) | 0.8 | 6,820,000 | 6,769,873 | 2033/9/20 |
| 第373回利付国債 (10年) | 0.6 | 8,880,000 | 8,629,228 | 2033/12/20 |
| 第374回利付国債 (10年) | 0.8 | 1,550,000 | 1,531,121 | 2034/3/20 |
| 第1回利付国債 (30年) | 2.8 | 196,000 | 219,275 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 268,000 | 295,904 | 2030/2/20 |
| 第3回利付国債 (30年) | 2.3 | 307,000 | 338,188 | 2030/5/20 |

| 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4回利付国債(30年) | 2.9 | 252,000 | 288,550 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債(30年) | 2.2 | 238,000 | 262,842 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債(30年) | 2.4 | 339,000 | 380,578 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債(30年) | 2.3 | 339,000 | 379,449 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債(30年) | 1.8 | 302,000 | 326,754 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債(30年) | 1.4 | 206,000 | 216,034 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債(30年) | 1.1 | 398,000 | 407,022 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債(30年) | 1.7 | 237,000 | 254,554 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債(30年) | 2.1 | 325,000 | 360,353 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債(30年) | 2.0 | 595,000 | 654,583 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債(30年) | 2.4 | 683,000 | 777,090 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債(30年) | 2.5 | 686,000 | 787,630 | 2034/6/20 |
| 第16回利付国債(30年) | 2.5 | 547,000 | 628,399 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債(30年) | 2.4 | 577,000 | 657,589 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債(30年) | 2.3 | 687,000 | 775,925 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債(30年) | 2.3 | 593,000 | 670,362 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債(30年) | 2.5 | 655,000 | 754,789 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債(30年) | 2.3 | 529,000 | 598,314 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債(30年) | 2.5 | 1,975,000 | 2,277,984 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債(30年) | 2.5 | 194,000 | 223,722 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債(30年) | 2.5 | 981,000 | 1,131,593 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債(30年) | 2.3 | 1,287,000 | 1,455,519 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債(30年) | 2.4 | 1,014,000 | 1,157,835 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債(30年) | 2.5 | 760,000 | 876,226 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債(30年) | 2.5 | 2,926,000 | 3,369,698 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債(30年) | 2.4 | 1,630,000 | 1,853,603 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債(30年) | 2.3 | 1,721,000 | 1,931,598 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債(30年) | 2.2 | 2,223,000 | 2,458,593 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債(30年) | 2.3 | 1,989,000 | 2,222,627 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債(30年) | 2.0 | 1,227,000 | 1,315,331 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債(30年) | 2.2 | 2,231,000 | 2,447,630 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債(30年) | 2.0 | 3,179,000 | 3,383,854 | 2041/9/20 |
| 第36回利付国債(30年) | 2.0 | 2,579,000 | 2,735,519 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債(30年) | 1.9 | 2,717,000 | 2,830,624 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債(30年) | 1.8 | 1,590,000 | 1,625,457 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債(30年) | 1.9 | 1,360,000 | 1,410,401 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債(30年) | 1.8 | 1,720,000 | 1,751,407 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債(30年) | 1.7 | 1,210,000 | 1,209,104 | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債(30年) | 1.7 | 1,820,000 | 1,813,266 | 2044/3/20 |
| 第43回利付国債(30年) | 1.7 | 2,020,000 | 2,009,455 | 2044/6/20 |
| 第44回利付国債(30年) | 1.7 | 2,230,000 | 2,214,925 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債(30年) | 1.5 | 1,940,000 | 1,858,112 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債(30年) | 1.5 | 2,530,000 | 2,418,578 | 2045/3/20 |
| 第47回利付国債(30年) | 1.6 | 2,890,000 | 2,808,039 | 2045/6/20 |
| 第48回利付国債(30年) | 1.4 | 2,100,000 | 1,962,849 | 2045/9/20 |

| 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49回利付国債 (30年) | 1.4 | 2,360,000 | 2,201,172 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,710,000 | 2,229,083 | 2046/3/20 |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3 | 2,560,000 | 1,865,804 | 2046/6/20 |
| 第52回利付国債 (30年) | 0.5 | 2,490,000 | 1,896,906 | 2046/9/20 |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6 | 2,490,000 | 1,933,808 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,040,000 | 1,653,481 | 2047/3/20 |
| 第55回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,240,000 | 1,809,539 | 2047/6/20 |
| 第56回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,310,000 | 1,859,850 | 2047/9/20 |
| 第57回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,340,000 | 1,876,212 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債 (30年) | 0.8 | 2,140,000 | 1,708,768 | 2048/3/20 |
| 第59回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,410,000 | 1,871,581 | 2048/6/20 |
| 第60回利付国債 (30年) | 0.9 | 2,200,000 | 1,787,566 | 2048/9/20 |
| 第61回利付国債 (30年) | 0.7 | 1,940,000 | 1,494,556 | 2048/12/20 |
| 第62回利付国債 (30年) | 0.5 | 1,850,000 | 1,346,874 | 2049/3/20 |
| 第63回利付国債 (30年) | 0.4 | 2,620,000 | 1,846,890 | 2049/6/20 |
| 第64回利付国債 (30年) | 0.4 | 2,330,000 | 1,634,098 | 2049/9/20 |
| 第65回利付国債 (30年) | 0.4 | 1,510,000 | 1,054,478 | 2049/12/20 |
| 第66回利付国債 (30年) | 0.4 | 1,900,000 | 1,320,120 | 2050/3/20 |
| 第67回利付国債 (30年) | 0.6 | 2,740,000 | 2,004,803 | 2050/6/20 |
| 第68回利付国債 (30年) | 0.6 | 2,540,000 | 1,851,228 | 2050/9/20 |
| 第69回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,370,000 | 1,768,968 | 2050/12/20 |
| 第70回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,340,000 | 1,740,187 | 2051/3/20 |
| 第71回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,610,000 | 1,933,801 | 2051/6/20 |
| 第72回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,410,000 | 1,778,989 | 2051/9/20 |
| 第73回利付国債 (30年) | 0.7 | 2,130,000 | 1,566,487 | 2051/12/20 |
| 第74回利付国債 (30年) | 1.0 | 3,040,000 | 2,422,576 | 2052/3/20 |
| 第75回利付国債 (30年) | 1.3 | 2,370,000 | 2,034,929 | 2052/6/20 |
| 第76回利付国債 (30年) | 1.4 | 2,420,000 | 2,124,590 | 2052/9/20 |
| 第77回利付国債 (30年) | 1.6 | 2,690,000 | 2,473,966 | 2052/12/20 |
| 第78回利付国債 (30年) | 1.4 | 3,260,000 | 2,850,022 | 2053/3/20 |
| 第79回利付国債 (30年) | 1.2 | 2,030,000 | 1,684,778 | 2053/6/20 |
| 第80回利付国債 (30年) | 1.8 | 2,800,000 | 2,688,952 | 2053/9/20 |
| 第81回利付国債 (30年) | 1.6 | 2,580,000 | 2,359,590 | 2053/12/20 |
| 第82回利付国債 (30年) | 1.8 | 1,100,000 | 1,053,954 | 2054/3/20 |
| 第78回利付国債 (20年) | 1.9 | 310,000 | 315,964 | 2025/6/20 |
| 第79回利付国債 (20年) | 2.0 | 150,000 | 153,051 | 2025/6/20 |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1 | 585,000 | 597,542 | 2025/6/20 |
| 第81回利付国債 (20年) | 2.0 | 250,000 | 256,090 | 2025/9/20 |
| 第82回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,082,000 | 1,109,818 | 2025/9/20 |
| 第83回利付国債 (20年) | 2.1 | 395,000 | 406,632 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) | 2.0 | 880,000 | 904,508 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年) | 2.1 | 520,000 | 537,258 | 2026/3/20 |
| 第86回利付国債 (20年) | 2.3 | 1,047,000 | 1,085,602 | 2026/3/20 |
| 第87回利付国債 (20年) | 2.2 | 420,000 | 434,712 | 2026/3/20 |
| 第88回利付国債 (20年) | 2.3 | 1,264,000 | 1,315,963 | 2026/6/20 |

| 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89回利付国債 (20年) | 2.2 | 340,000 | 353,266 | 2026/6/20 |
| 第90回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,270,000 | 1,325,295 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 548,000 | 573,142 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,282,000 | 1,340,036 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債 (20年) | 2.0 | 190,000 | 198,816 | 2027/3/20 |
| 第94回利付国債 (20年) | 2.1 | 875,000 | 918,067 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債 (20年) | 2.3 | 1,107,000 | 1,172,501 | 2027/6/20 |
| 第96回利付国債 (20年) | 2.1 | 340,000 | 358,033 | 2027/6/20 |
| 第97回利付国債 (20年) | 2.2 | 573,000 | 607,425 | 2027/9/20 |
| 第98回利付国債 (20年) | 2.1 | 610,000 | 644,629 | 2027/9/20 |
| 第99回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,480,000 | 1,569,066 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,030,000 | 1,099,442 | 2028/3/20 |
| 第101回利付国債 (20年) | 2.4 | 723,000 | 777,225 | 2028/3/20 |
| 第102回利付国債 (20年) | 2.4 | 520,000 | 561,059 | 2028/6/20 |
| 第103回利付国債 (20年) | 2.3 | 760,000 | 816,946 | 2028/6/20 |
| 第104回利付国債 (20年) | 2.1 | 610,000 | 650,790 | 2028/6/20 |
| 第105回利付国債 (20年) | 2.1 | 920,000 | 983,967 | 2028/9/20 |
| 第106回利付国債 (20年) | 2.2 | 571,000 | 613,139 | 2028/9/20 |
| 第107回利付国債 (20年) | 2.1 | 607,000 | 650,691 | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,000,000 | 1,062,980 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) | 1.9 | 560,000 | 596,411 | 2029/3/20 |
| 第110回利付国債 (20年) | 2.1 | 876,000 | 941,244 | 2029/3/20 |
| 第111回利付国債 (20年) | 2.2 | 861,000 | 933,108 | 2029/6/20 |
| 第112回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,050,000 | 1,132,719 | 2029/6/20 |
| 第113回利付国債 (20年) | 2.1 | 922,000 | 997,613 | 2029/9/20 |
| 第114回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,600,000 | 1,736,208 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債 (20年) | 2.2 | 944,000 | 1,029,498 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) | 2.2 | 461,000 | 504,246 | 2030/3/20 |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,320,000 | 1,436,344 | 2030/3/20 |
| 第118回利付国債 (20年) | 2.0 | 520,000 | 564,007 | 2030/6/20 |
| 第119回利付国債 (20年) | 1.8 | 400,000 | 429,136 | 2030/6/20 |
| 第120回利付国債 (20年) | 1.6 | 780,000 | 827,369 | 2030/6/20 |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,299,000 | 1,403,634 | 2030/9/20 |
| 第122回利付国債 (20年) | 1.8 | 100,000 | 107,442 | 2030/9/20 |
| 第123回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,318,000 | 1,443,091 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0 | 1,240,000 | 1,349,826 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,844,000 | 2,034,743 | 2031/3/20 |
| 第126回利付国債 (20年) | 2.0 | 200,000 | 217,990 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9 | 440,000 | 476,687 | 2031/3/20 |
| 第128回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,974,000 | 2,140,763 | 2031/6/20 |
| 第129回利付国債 (20年) | 1.8 | 280,000 | 301,753 | 2031/6/20 |
| 第130回利付国債 (20年) | 1.8 | 1,862,000 | 2,008,036 | 2031/9/20 |
| 第131回利付国債 (20年) | 1.7 | 420,000 | 450,000 | 2031/9/20 |
| 第132回利付国債 (20年) | 1.7 | 187,000 | 200,497 | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年) | 1.8 | 2,320,000 | 2,504,208 | 2031/12/20 |

| 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134回利付国債 (20年) | 1.8 | 4,545,000 | 4,909,645 | 2032/3/20 |
| 第135回利付国債 (20年) | 1.7 | 50,000 | 53,640 | 2032/3/20 |
| 第136回利付国債 (20年) | 1.6 | 190,000 | 202,346 | 2032/3/20 |
| 第137回利付国債 (20年) | 1.7 | 4,342,000 | 4,658,792 | 2032/6/20 |
| 第138回利付国債 (20年) | 1.5 | 160,000 | 169,163 | 2032/6/20 |
| 第139回利付国債 (20年) | 1.6 | 310,000 | 330,122 | 2032/6/20 |
| 第140回利付国債 (20年) | 1.7 | 2,817,000 | 3,023,795 | 2032/9/20 |
| 第141回利付国債 (20年) | 1.7 | 1,120,000 | 1,202,577 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) | 1.8 | 3,090,000 | 3,342,731 | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債 (20年) | 1.6 | 1,740,000 | 1,853,500 | 2033/3/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | 1.5 | 1,520,000 | 1,605,940 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | 1.7 | 3,100,000 | 3,329,617 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | 1.7 | 3,420,000 | 3,670,275 | 2033/9/20 |
| 第147回利付国債 (20年) | 1.6 | 3,450,000 | 3,668,316 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | 1.5 | 3,360,000 | 3,539,188 | 2034/3/20 |
| 第149回利付国債 (20年) | 1.5 | 4,180,000 | 4,397,945 | 2034/6/20 |
| 第150回利付国債 (20年) | 1.4 | 4,800,000 | 4,996,512 | 2034/9/20 |
| 第151回利付国債 (20年) | 1.2 | 4,480,000 | 4,565,881 | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | 1.2 | 3,980,000 | 4,047,978 | 2035/3/20 |
| 第153回利付国債 (20年) | 1.3 | 3,990,000 | 4,093,221 | 2035/6/20 |
| 第154回利付国債 (20年) | 1.2 | 4,160,000 | 4,216,867 | 2035/9/20 |
| 第155回利付国債 (20年) | 1.0 | 4,720,000 | 4,671,431 | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債 (20年) | 0.4 | 3,100,000 | 2,854,542 | 2036/3/20 |
| 第157回利付国債 (20年) | 0.2 | 4,980,000 | 4,453,763 | 2036/6/20 |
| 第158回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,760,000 | 3,474,954 | 2036/9/20 |
| 第159回利付国債 (20年) | 0.6 | 3,400,000 | 3,169,718 | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債 (20年) | 0.7 | 4,430,000 | 4,164,820 | 2037/3/20 |
| 第161回利付国債 (20年) | 0.6 | 3,720,000 | 3,438,098 | 2037/6/20 |
| 第162回利付国債 (20年) | 0.6 | 4,580,000 | 4,212,775 | 2037/9/20 |
| 第163回利付国債 (20年) | 0.6 | 3,550,000 | 3,251,480 | 2037/12/20 |
| 第164回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,890,000 | 3,498,043 | 2038/3/20 |
| 第165回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,810,000 | 3,408,159 | 2038/6/20 |
| 第166回利付国債 (20年) | 0.7 | 4,060,000 | 3,720,299 | 2038/9/20 |
| 第167回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,710,000 | 3,287,208 | 2038/12/20 |
| 第168回利付国債 (20年) | 0.4 | 3,800,000 | 3,300,376 | 2039/3/20 |
| 第169回利付国債 (20年) | 0.3 | 3,140,000 | 2,669,471 | 2039/6/20 |
| 第170回利付国債 (20年) | 0.3 | 3,120,000 | 2,636,306 | 2039/9/20 |
| 第171回利付国債 (20年) | 0.3 | 3,070,000 | 2,579,721 | 2039/12/20 |
| 第172回利付国債 (20年) | 0.4 | 3,790,000 | 3,221,083 | 2040/3/20 |
| 第173回利付国債 (20年) | 0.4 | 3,550,000 | 3,000,744 | 2040/6/20 |
| 第174回利付国債 (20年) | 0.4 | 6,120,000 | 5,144,716 | 2040/9/20 |
| 第175回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,620,000 | 3,079,461 | 2040/12/20 |
| 第176回利付国債 (20年) | 0.5 | 3,590,000 | 3,037,678 | 2041/3/20 |
| 第177回利付国債 (20年) | 0.4 | 3,790,000 | 3,133,041 | 2041/6/20 |
| 第178回利付国債 (20年) | 0.5 | 4,070,000 | 3,408,665 | 2041/9/20 |

| 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179回利付国債 (20年) | | 0.5 | 3,790,000 | 3,158,813 | 2041/12/20 |
| 第180回利付国債 (20年) | | 0.8 | 3,680,000 | 3,222,024 | 2042/3/20 |
| 第181回利付国債 (20年) | | 0.9 | 4,000,000 | 3,549,680 | 2042/6/20 |
| 第182回利付国債 (20年) | | 1.1 | 3,760,000 | 3,441,979 | 2042/9/20 |
| 第183回利付国債 (20年) | | 1.4 | 3,320,000 | 3,188,229 | 2042/12/20 |
| 第184回利付国債 (20年) | | 1.1 | 4,050,000 | 3,684,690 | 2043/3/20 |
| 第185回利付国債 (20年) | | 1.1 | 4,630,000 | 4,199,132 | 2043/6/20 |
| 第186回利付国債 (20年) | | 1.5 | 3,700,000 | 3,584,375 | 2043/9/20 |
| 第187回利付国債 (20年) | | 1.3 | 3,320,000 | 3,097,394 | 2043/12/20 |
| 第188回利付国債 (20年) | | 1.6 | 730,000 | 714,918 | 2044/3/20 |
| 第1回大韓民国 | | 0.475 | 100,000 | 99,995 | 2026/9/14 |
| 第2回大韓民国 | | 0.75 | 100,000 | 100,283 | 2028/9/14 |
| 小 | 計 | | 807,394,000 | 772,173,696 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 第7回東京都公募公債 (20年) | | 2.16 | 100,000 | 102,535 | 2025/9/19 |
| 第7回東京都公募公債 (30年) | | 2.51 | 80,000 | 90,874 | 2038/9/17 |
| 第10回東京都公募公債 (30年) | | 2.31 | 100,000 | 110,449 | 2039/9/20 |
| 第12回東京都公募公債 (20年) | | 2.31 | 100,000 | 106,013 | 2027/9/17 |
| 第20回東京都公募公債 (20年) | | 2.09 | 80,000 | 86,053 | 2029/9/20 |
| 第21回東京都公募公債 (20年) | | 2.19 | 80,000 | 86,740 | 2029/12/20 |
| 第28回東京都公募公債 (20年) | | 1.59 | 100,000 | 105,496 | 2033/3/18 |
| 第33回東京都公募公債 (20年) | | 0.18 | 100,000 | 88,139 | 2036/6/20 |
| 第747回東京都公募公債 | | 0.475 | 500,000 | 501,310 | 2025/9/19 |
| 第750回東京都公募公債 | | 0.444 | 200,000 | 200,314 | 2025/12/19 |
| 第751回東京都公募公債 | | 0.37 | 500,000 | 500,195 | 2025/12/19 |
| 第757回東京都公募公債 | | 0.03 | 150,000 | 148,734 | 2026/6/19 |
| 第758回東京都公募公債 | | 0.03 | 150,000 | 148,734 | 2026/6/19 |
| 第782回東京都公募公債 | | 0.23 | 100,000 | 98,734 | 2028/6/20 |
| 第783回東京都公募公債 | | 0.22 | 400,000 | 394,776 | 2028/6/20 |
| 第807回東京都公募公債 | | 0.1 | 200,000 | 193,144 | 2030/6/20 |
| 第809回東京都公募公債 | | 0.105 | 100,000 | 96,326 | 2030/9/20 |
| 平成27年度第5回北海道公募公債 | | 0.583 | 100,000 | 100,370 | 2025/6/30 |
| 平成30年度第14回北海道公募公債 | | 0.195 | 100,000 | 98,134 | 2028/12/28 |
| 令和3年度第14回北海道公募公債 (5年) | | 0.001 | 400,000 | 395,072 | 2027/1/28 |
| 第32回1号宮城県公募公債 | | 0.07 | 200,000 | 198,468 | 2026/6/24 |
| 第36回2号宮城県公募公債 | | 0.135 | 342,000 | 329,657 | 2030/10/28 |
| 第2回神奈川県公募公債 (30年) | | 2.87 | 180,000 | 212,662 | 2036/6/20 |
| 第3回神奈川県公募公債 (20年) | | 2.11 | 500,000 | 510,320 | 2025/6/20 |
| 第4回神奈川県公募公債 (30年) | | 2.62 | 100,000 | 115,205 | 2038/3/19 |
| 第19回神奈川県公募公債 (20年) | | 1.818 | 100,000 | 107,335 | 2032/1/30 |
| 第20回神奈川県公募公債 (20年) | | 1.706 | 500,000 | 532,470 | 2032/6/18 |
| 第27回神奈川県公募公債 (20年) | | 1.398 | 100,000 | 102,952 | 2034/9/20 |
| 第226回神奈川県公募公債 | | 0.195 | 100,000 | 99,251 | 2027/3/19 |
| 第234回神奈川県公募公債 | | 0.254 | 100,000 | 98,830 | 2028/6/20 |
| 第243回神奈川県公募公債 | | 0.075 | 100,000 | 96,864 | 2029/12/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第256回神奈川県公募公債 | 0.269 | 350,000 | 334,901 | 2032/3/19 |
| 第7回大阪府公募公債(20年) | 1.84 | 220,000 | 236,277 | 2031/9/26 |
| 第11回大阪府公募公債(20年) | 1.693 | 100,000 | 106,265 | 2033/9/27 |
| 第179回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 100,000 | 99,371 | 2026/1/28 |
| 第184回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 120,000 | 118,900 | 2026/6/29 |
| 第186回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 300,000 | 297,042 | 2026/8/28 |
| 第191回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 160,000 | 158,072 | 2027/1/28 |
| 第400回大阪府公募公債 | 0.531 | 136,000 | 136,450 | 2025/9/29 |
| 第407回大阪府公募公債 | 0.09 | 200,000 | 198,738 | 2026/4/27 |
| 第410回大阪府公募公債 | 0.001 | 200,000 | 198,100 | 2026/7/28 |
| 第415回大阪府公募公債 | 0.142 | 100,000 | 99,215 | 2026/12/25 |
| 第417回大阪府公募公債 | 0.248 | 300,000 | 298,278 | 2027/2/26 |
| 第418回大阪府公募公債 | 0.22 | 800,000 | 794,520 | 2027/3/30 |
| 第420回大阪府公募公債 | 0.17 | 100,000 | 99,099 | 2027/5/28 |
| 第426回大阪府公募公債 | 0.172 | 100,000 | 98,855 | 2027/11/29 |
| 第435回大阪府公募公債 | 0.2 | 130,000 | 128,012 | 2028/8/30 |
| 第439回大阪府公募公債 | 0.193 | 100,000 | 98,170 | 2028/12/27 |
| 第455回大阪府公募公債 | 0.116 | 148,000 | 143,259 | 2030/4/26 |
| 第460回大阪府公募公債 | 0.115 | 194,000 | 186,911 | 2030/9/27 |
| 第464回大阪府公募公債 | 0.072 | 800,000 | 765,568 | 2031/1/28 |
| 第465回大阪府公募公債 | 0.12 | 500,000 | 479,640 | 2031/2/25 |
| 第467回大阪府公募公債 | 0.164 | 200,000 | 192,054 | 2031/4/28 |
| 第471回大阪府公募公債 | 0.083 | 97,000 | 92,170 | 2031/8/29 |
| 第483回大阪府公募公債 | 0.799 | 200,000 | 198,016 | 2033/1/28 |
| 平成26年度第2回京都府公募公債(15年) | 1.071 | 200,000 | 204,340 | 2029/4/27 |
| 平成26年度第5回京都府公募公債(20年) | 1.455 | 100,000 | 103,593 | 2034/8/10 |
| 令和6年度第1回京都府公募公債(5年) | 0.482 | 200,000 | 198,774 | 2029/4/16 |
| 第1回兵庫県公募公債(15年) | 1.66 | 400,000 | 410,728 | 2026/7/29 |
| 第2回兵庫県公募公債(20年) | 2.37 | 300,000 | 318,633 | 2027/9/17 |
| 第2回兵庫県公募公債(30年) | 2.36 | 90,000 | 99,854 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債(12年) | 0.73 | 300,000 | 301,989 | 2026/8/6 |
| 第5回兵庫県公募公債(12年) | 0.687 | 400,000 | 402,628 | 2027/7/7 |
| 第5回兵庫県公募公債(15年) | 1.31 | 200,000 | 206,084 | 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9回兵庫県公募公債(15年) | 1.02 | 800,000 | 815,584 | 2029/7/13 |
| 第9回兵庫県公募公債(20年) | 2.25 | 200,000 | 217,260 | 2029/11/19 |
| 第27回兵庫県公募公債(20年) | 0.387 | 200,000 | 181,222 | 2036/5/12 |
| 平成28年度第29回兵庫県公募公債 | 0.238 | 100,000 | 99,403 | 2027/2/19 |
| 令和5年度第4回兵庫県公募公債(グリーン) | 0.661 | 100,000 | 97,501 | 2033/6/20 |
| 令和5年度第5回兵庫県公募公債 | 0.815 | 100,000 | 98,538 | 2033/9/22 |
| 令和6年度第1回兵庫県公募公債(5年) | 0.541 | 100,000 | 99,669 | 2029/4/23 |
| 令和6年度第2回兵庫県公募公債 | 0.938 | 200,000 | 198,416 | 2034/4/21 |
| 第1回静岡県公募公債(15年) | 1.514 | 100,000 | 102,976 | 2027/3/19 |
| 第6回静岡県公募公債(15年) | 1.062 | 300,000 | 306,510 | 2029/6/25 |
| 第11回静岡県公募公債(20年) | 1.841 | 550,000 | 588,885 | 2030/10/18 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | % | 千円 | 千円 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 第14回静岡県公募公債 (20年) | 1.736 | 100,000 | 106,762 | 2032/6/18 |
| 平成27年度第10回静岡県公募公債 | 0.461 | 400,000 | 400,948 | 2025/9/19 |
| 令和2年度第15回静岡県公募公債 (5年) | 0.01 | 120,000 | 119,139 | 2026/3/19 |
| 令和2年度第13回静岡県公募公債 (5年) | 0.01 | 120,000 | 119,139 | 2026/3/19 |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債 (20年) | 2.04 | 200,000 | 213,014 | 2028/12/20 |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年) | 2.28 | 700,000 | 757,918 | 2029/6/20 |
| 平成23年度第13回愛知県公募公債 | 1.529 | 500,000 | 513,485 | 2026/11/13 |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年) | 1.314 | 300,000 | 308,547 | 2027/12/13 |
| 平成27年度第7回愛知県公募公債 | 0.548 | 100,000 | 100,352 | 2025/7/28 |
| 平成27年度第16回愛知県公募公債 | 0.454 | 100,000 | 100,175 | 2025/12/25 |
| 平成29年度第5回愛知県公募公債 | 0.2 | 600,000 | 594,906 | 2027/6/29 |
| 平成30年度第5回愛知県公募公債 | 0.195 | 100,000 | 98,583 | 2028/6/29 |
| 平成30年度第8回愛知県公募公債 | 0.255 | 200,000 | 197,402 | 2028/8/31 |
| 令和3年度第18回愛知県公募公債 | 0.274 | 100,000 | 95,672 | 2032/3/30 |
| 令和5年度第8回愛知県公募公債 | 0.772 | 100,000 | 98,127 | 2033/9/20 |
| 令和6年度第1回愛知県公募公債 (5年) | 0.477 | 100,000 | 99,388 | 2029/4/12 |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 (20年) | 1.83 | 100,000 | 107,319 | 2031/9/22 |
| 平成28年度第1回広島県公募公債 | 0.08 | 100,000 | 99,304 | 2026/5/25 |
| 平成28年度第4回広島県公募公債 | 0.06 | 100,000 | 99,046 | 2026/11/25 |
| 平成28年度第1回広島県公募公債 (20年) | 0.414 | 100,000 | 90,311 | 2036/9/26 |
| 平成30年度第4回広島県公募公債 | 0.259 | 200,000 | 197,082 | 2028/11/22 |
| 令和3年度第7回広島県公募公債 | 0.244 | 100,000 | 95,493 | 2032/3/25 |
| 第2回埼玉県公募公債 (サステナビリティ) | 0.782 | 100,000 | 98,320 | 2033/8/29 |
| 第3回埼玉県公募公債 | 0.875 | 200,000 | 198,012 | 2033/10/18 |
| 第4回埼玉県公募公債 | 0.995 | 200,000 | 199,528 | 2034/5/19 |
| 第9回埼玉県公募公債 (20年) | 2.15 | 200,000 | 217,360 | 2030/5/24 |
| 第10回埼玉県公募公債 (20年) | 1.94 | 100,000 | 107,723 | 2030/11/12 |
| 第14回埼玉県公募公債 (20年) | 1.546 | 200,000 | 209,246 | 2034/5/8 |
| 第16回埼玉県公募公債 (20年) | 1.216 | 100,000 | 100,405 | 2035/8/14 |
| 平成29年度第1回埼玉県公募公債 | 0.205 | 100,000 | 99,245 | 2027/4/19 |
| 平成29年度第3回埼玉県公募公債 | 0.175 | 200,000 | 198,234 | 2027/5/24 |
| 平成30年度第4回埼玉県公募公債 | 0.205 | 100,000 | 98,627 | 2028/6/26 |
| 令和2年度第1回埼玉県公募公債 | 0.131 | 100,000 | 96,897 | 2030/4/15 |
| 令和3年度第2回埼玉県公募公債 (5年) | 0.01 | 110,000 | 109,159 | 2026/4/15 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年) | 2.62 | 70,000 | 80,694 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年) | 2.28 | 80,000 | 88,505 | 2038/9/17 |
| 平成21年度第2回福岡県公募公債 (20年) | 2.23 | 200,000 | 217,676 | 2030/2/22 |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債 (20年) | 2.116 | 800,000 | 872,256 | 2031/2/21 |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債 (15年) | 1.491 | 800,000 | 821,032 | 2026/11/27 |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債 | 0.464 | 100,000 | 100,191 | 2025/12/25 |
| 令和2年度第4回福岡県公募公債 | 0.14 | 200,000 | 193,078 | 2030/9/20 |
| 令和5年度第1回福岡県公募公債 (グリーン) | 0.681 | 100,000 | 97,754 | 2033/5/30 |
| 令和5年度第3回福岡県公募公債 | 0.656 | 100,000 | 97,502 | 2033/6/13 |
| 第9回千葉県公募公債 (20年) | 1.84 | 80,000 | 85,635 | 2030/10/11 |
| 第13回千葉県公募公債 (20年) | 1.701 | 300,000 | 319,485 | 2032/10/15 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第14回千葉県公募公債 (20年) | 1.137 | 100,000 | 101,642 | 2033/4/15 |
| 平成27年度第3回千葉県公募公債 | 0.524 | 200,000 | 200,632 | 2025/6/25 |
| 平成27年度第6回千葉県公募公債 | 0.469 | 500,000 | 500,995 | 2025/12/25 |
| 平成27年度第9回千葉県公募公債 | 0.095 | 200,000 | 198,868 | 2026/3/25 |
| 平成28年度第3回千葉県公募公債 | 0.05 | 400,000 | 396,644 | 2026/7/24 |
| 平成30年度第6回千葉県公募公債 | 0.145 | 100,000 | 97,896 | 2029/1/25 |
| 令和元年度第6回千葉県公募公債 | 0.135 | 100,000 | 97,112 | 2030/1/25 |
| 令和5年度第7回千葉県公募公債 (サステナビリティ) | 0.747 | 100,000 | 97,912 | 2033/9/22 |
| 令和5年度第8回千葉県公募公債 | 0.875 | 100,000 | 99,004 | 2033/10/25 |
| 令和6年度第1回千葉県公募公債 | 0.87 | 300,000 | 295,641 | 2034/4/25 |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債 | 0.215 | 100,000 | 99,679 | 2026/2/26 |
| 令和4年度第1回長野県公募公債 | 0.299 | 300,000 | 287,364 | 2032/4/23 |
| 令和5年度第2回長野県公募公債 | 0.767 | 100,000 | 98,083 | 2033/9/22 |
| 第2回群馬県公募公債 (20年) | 2.019 | 100,000 | 108,620 | 2031/7/18 |
| 第7回群馬県公募公債 (20年) | 0.313 | 100,000 | 89,638 | 2036/6/13 |
| 平成27年度第1回岐阜県公募公債 | 0.515 | 300,000 | 300,930 | 2025/9/30 |
| 令和2年度第2回岐阜県公募公債 (5年) | 0.02 | 100,000 | 99,533 | 2025/11/25 |
| 平成27年度第1回大分県公募公債 | 0.476 | 203,400 | 203,892 | 2025/10/30 |
| 第2回共同発行市場公募地方債 (グリーン) | 0.893 | 200,000 | 197,536 | 2034/3/24 |
| 第148回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 500,000 | 501,780 | 2025/7/25 |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 0.51 | 200,000 | 200,614 | 2025/9/25 |
| 第151回共同発行市場公募地方債 | 0.466 | 200,000 | 200,464 | 2025/10/24 |
| 第152回共同発行市場公募地方債 | 0.496 | 700,000 | 701,827 | 2025/11/25 |
| 第153回共同発行市場公募地方債 | 0.469 | 200,000 | 200,398 | 2025/12/25 |
| 第157回共同発行市場公募地方債 | 0.08 | 500,000 | 496,810 | 2026/4/24 |
| 第158回共同発行市場公募地方債 | 0.08 | 200,000 | 198,608 | 2026/5/25 |
| 第159回共同発行市場公募地方債 | 0.07 | 500,000 | 496,165 | 2026/6/25 |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 0.225 | 100,000 | 99,197 | 2027/7/23 |
| 第173回共同発行市場公募地方債 | 0.215 | 400,000 | 396,504 | 2027/8/25 |
| 第185回共同発行市場公募地方債 | 0.245 | 300,000 | 296,058 | 2028/8/25 |
| 第193回共同発行市場公募地方債 | 0.1 | 100,000 | 97,478 | 2029/4/25 |
| 第198回共同発行市場公募地方債 | 0.05 | 100,000 | 96,906 | 2029/9/25 |
| 第205回共同発行市場公募地方債 | 0.135 | 100,000 | 96,907 | 2030/4/25 |
| 第206回共同発行市場公募地方債 | 0.131 | 100,000 | 96,818 | 2030/5/24 |
| 第207回共同発行市場公募地方債 | 0.15 | 100,000 | 96,859 | 2030/6/25 |
| 第232回共同発行市場公募地方債 | 0.364 | 450,000 | 432,081 | 2032/7/23 |
| 令和元年度第3回堺市公募公債 | 0.11 | 100,000 | 97,055 | 2029/12/19 |
| 平成27年度第1回長崎県公募公債 | 0.515 | 300,000 | 300,930 | 2025/9/30 |
| 平成27年度第1回佐賀県公募公債 | 0.476 | 500,000 | 501,120 | 2025/11/28 |
| 平成29年度第1回佐賀県公募公債 | 0.19 | 100,000 | 98,917 | 2027/11/30 |
| 平成30年度第1回福島県公募公債 | 0.264 | 100,000 | 98,557 | 2028/11/30 |
| 第2回滋賀県公募公債 (サステナビリティ) | 0.795 | 100,000 | 98,321 | 2033/9/29 |
| 令和元年度第2回栃木県公募公債 | 0.09 | 100,000 | 96,980 | 2029/11/29 |
| 令和2年度第2回栃木県公募公債 | 0.135 | 100,000 | 96,285 | 2030/11/27 |
| 令和3年度第1回熊本県公募公債 (5年) | 0.005 | 200,000 | 198,112 | 2026/7/30 |

| 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5年度第2回奈良県公募公債 | | 0.752 | 200,000 | 196,610 | 2033/6/20 |
| 令和6年度第1回奈良県公募公債(5年) | | 0.575 | 100,000 | 99,904 | 2029/3/19 |
| 第5回大阪市公募公債(20年) | | 2.47 | 100,000 | 108,152 | 2028/9/21 |
| 第15回大阪市公募公債(20年) | | 2.12 | 100,000 | 108,995 | 2031/1/24 |
| 令和2年度第3回大阪市公募公債(5年) | | 0.02 | 500,000 | 498,270 | 2025/9/11 |
| 令和6年度第1回大阪市公募公債(5年) | | 0.58 | 300,000 | 299,640 | 2029/5/22 |
| 令和6年度第2回大阪市公募公債 | | 0.995 | 200,000 | 199,436 | 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 |
| 第9回名古屋市公募公債(20年) | | 2.07 | 100,000 | 106,642 | 2028/12/20 |
| 第9回名古屋市公募公債(30年) | | 2.095 | 90,000 | 94,944 | 2042/9/19 |
| 第28回名古屋市公募公債(5年) | | 0.01 | 500,000 | 497,325 | 2025/12/19 |
| 第33回名古屋市公募公債(5年) | | 0.58 | 300,000 | 299,712 | 2029/5/18 |
| 第491回名古屋市公募公債 | | 0.587 | 400,000 | 401,544 | 2025/6/19 |
| 第511回名古屋市公募公債 | | 0.075 | 100,000 | 96,633 | 2030/3/27 |
| 第1回京都市公募公債(15年) | | 0.781 | 100,000 | 100,324 | 2030/12/20 |
| 第3回京都市公募公債(20年) | | 2.09 | 100,000 | 102,789 | 2025/12/19 |
| 第5回京都市公募公債(20年) | | 2.36 | 50,000 | 52,468 | 2026/12/18 |
| 令和5年度第7回京都市公募公債(5年) | | 0.482 | 100,000 | 99,371 | 2029/3/21 |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債(20年) | | 2.54 | 110,000 | 114,833 | 2026/6/19 |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債(20年) | | 2.08 | 200,000 | 213,372 | 2028/12/20 |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債 | | 1.895 | 100,000 | 107,363 | 2030/9/13 |
| 平成23年度第4回神戸市公募公債(20年) | | 1.913 | 150,000 | 161,860 | 2031/9/12 |
| 令和6年度第1回神戸市公募公債(5年) | | 0.477 | 300,000 | 298,086 | 2029/4/20 |
| 第5回横浜市公募公債(20年) | | 2.17 | 100,000 | 102,130 | 2025/6/20 |
| 第7回横浜市公募公債(20年) | | 2.06 | 450,000 | 462,334 | 2025/12/19 |
| 第19回横浜市公募公債(20年) | | 2.2 | 200,000 | 216,182 | 2029/8/31 |
| 平成27年度第2回横浜市公募公債 | | 0.568 | 200,000 | 200,714 | 2025/6/16 |
| 平成27年度第3回横浜市公募公債 | | 0.524 | 400,000 | 401,304 | 2025/8/18 |
| 平成27年度第4回横浜市公募公債 | | 0.486 | 300,000 | 300,777 | 2025/10/20 |
| 第27回横浜市公募公債(20年) | | 1.599 | 100,000 | 105,611 | 2033/5/20 |
| 第33回横浜市公募公債(20年) | | 0.323 | 100,000 | 89,971 | 2036/4/28 |
| 第35回横浜市公募公債(20年) | | 0.443 | 500,000 | 452,325 | 2036/10/28 |
| 第54回横浜市公募公債(5年) | | 0.02 | 300,000 | 298,599 | 2025/11/25 |
| 第64回横浜市公募公債(5年) | | 0.477 | 800,000 | 795,104 | 2029/4/12 |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年) | | 2.277 | 80,000 | 87,591 | 2040/9/20 |
| 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23年度第9回札幌市公募公債 | | 1.493 | 600,000 | 616,926 | 2027/2/12 |
| 令和2年度第7回札幌市公募公債 | | 0.115 | 200,000 | 192,186 | 2030/12/20 |
| 令和3年度第2回札幌市公募公債(5年) | | 0.01 | 100,000 | 99,114 | 2026/6/19 |
| 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7回川崎市公募公債(20年) | | 2.08 | 100,000 | 107,349 | 2029/7/17 |
| 第12回川崎市公募公債(20年) | | 2.04 | 100,000 | 108,680 | 2031/5/30 |
| 第62回川崎市公募公債(5年) | | 0.005 | 490,000 | 485,374 | 2026/7/30 |
| 第3回北九州市公募公債(サステナビリティ) | | 0.747 | 100,000 | 97,912 | 2033/9/22 |
| 第17回北九州市公募公債(20年) | | 1.529 | 100,000 | 104,368 | 2034/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 令和3年度第1回北九州市公募公債(5年) | 0.005 | 200,000 | 197,974 | 2026/9/28 |
| 2020年度第9回福岡市公募公債(5年) | 0.01 | 200,000 | 198,920 | 2025/12/25 |
| 2023年度第8回福岡市公募公債 | 0.831 | 100,000 | 98,215 | 2034/3/15 |
| 2024年度第1回福岡市公募公債(5年) | 0.482 | 200,000 | 198,774 | 2029/4/16 |
| 令和3年度第4回千葉市公募公債 | 0.135 | 100,000 | 94,990 | 2031/12/24 |
| 令和5年度第4回千葉市公募公債(サステナビリティ) | 0.782 | 100,000 | 98,557 | 2033/6/20 |
| 第21回さいたま市公募公債 | 0.861 | 170,000 | 167,788 | 2033/12/23 |
| 令和5年度第2回鹿児島県公募公債(5年) | 0.482 | 100,000 | 99,372 | 2029/3/19 |
| 令和2年度第2回徳島県公募公債 | 0.135 | 100,000 | 96,285 | 2030/11/27 |
| 平成28年度第1回山梨県公募公債 | 0.06 | 200,000 | 198,144 | 2026/10/30 |
| 平成30年度第1回山梨県公募公債 | 0.289 | 100,000 | 98,733 | 2028/10/30 |
| 令和2年度第1回山梨県公募公債 | 0.135 | 700,000 | 674,716 | 2030/10/30 |
| 第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債 | 2.34 | 100,000 | 106,989 | 2028/12/20 |
| 小 計 | | 48,280,400 | 48,581,318 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 2.3 | 100,000 | 110,575 | 2040/2/29 |
| 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 2.2 | 100,000 | 108,988 | 2040/5/31 |
| 第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.8 | 100,000 | 103,108 | 2040/8/31 |
| 第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.9 | 100,000 | 107,610 | 2030/9/30 |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.8 | 100,000 | 107,286 | 2031/10/31 |
| 第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 2.0 | 100,000 | 104,874 | 2042/2/28 |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.737 | 100,000 | 106,904 | 2032/4/30 |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.83 | 100,000 | 102,043 | 2042/5/30 |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.39 | 100,000 | 103,199 | 2034/8/31 |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.484 | 101,000 | 101,306 | 2025/6/30 |
| 第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.557 | 100,000 | 100,396 | 2025/7/31 |
| 第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.386 | 100,000 | 100,154 | 2025/10/31 |
| 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.379 | 200,000 | 200,206 | 2025/12/26 |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.32 | 100,000 | 99,965 | 2026/1/30 |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.145 | 200,000 | 199,250 | 2026/2/27 |
| 第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.02 | 300,000 | 297,864 | 2026/4/30 |
| 第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.02 | 300,000 | 297,717 | 2026/5/29 |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.145 | 100,000 | 98,551 | 2028/5/31 |
| 第437回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.251 | 1,000,000 | 990,340 | 2028/4/28 |
| 第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.15 | 300,000 | 295,560 | 2028/6/30 |
| 第73回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.484 | 302,000 | 302,893 | 2025/6/13 |
| 第76回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.425 | 400,000 | 400,928 | 2025/9/12 |
| 第77回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.386 | 100,000 | 100,164 | 2025/10/15 |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.381 | 150,000 | 150,205 | 2025/11/18 |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.145 | 100,000 | 99,640 | 2026/2/16 |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.02 | 674,000 | 669,760 | 2026/3/13 |
| 第83回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.02 | 102,000 | 101,296 | 2026/4/17 |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.085 | 1,300,000 | 1,289,002 | 2026/12/14 |
| 第94回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.145 | 100,000 | 99,211 | 2027/3/15 |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債 | 0.09 | 325,000 | 321,031 | 2027/9/17 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 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101回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.17 | 100,000 | 99,021 | 2027/10/15 |
| 第102回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.16 | 131,000 | 129,619 | 2027/11/15 |
| 第108回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.145 | 223,000 | 219,840 | 2028/5/19 |
| 第115回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.16 | 200,000 | 196,378 | 2028/12/15 |
| 第4回政府保証新関西国際空港債券 | 0.484 | 904,000 | 906,730 | 2025/6/13 |
| 第19回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 | 0.001 | 500,000 | 496,000 | 2026/5/29 |
| 第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 | 0.001 | 600,000 | 598,548 | 2025/6/30 |
| 第6回神奈川県住宅供給公社債券 | 0.215 | 100,000 | 97,100 | 2029/4/23 |
| 第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | 2.23 | 30,000 | 31,540 | 2027/5/28 |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.99 | 100,000 | 118,067 | 2045/9/20 |
| 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 | 140,000 | 145,147 | 2026/3/19 |
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.35 | 300,000 | 313,041 | 2026/9/18 |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.87 | 30,000 | 34,782 | 2046/12/20 |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.75 | 200,000 | 227,538 | 2047/3/20 |
| 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.28 | 200,000 | 210,270 | 2027/4/20 |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.67 | 110,000 | 123,539 | 2047/3/20 |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.39 | 300,000 | 317,586 | 2027/7/20 |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.34 | 200,000 | 212,190 | 2027/10/20 |
| 第28回道路債券(財投機関債) | 2.83 | 100,000 | 115,711 | 2033/12/20 |
| 第33回道路債券(財投機関債) | 2.91 | 300,000 | 349,719 | 2034/6/20 |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.9 | 150,000 | 161,187 | 2032/3/19 |
| 第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.773 | 100,000 | 106,504 | 2032/9/17 |
| 第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.523 | 100,000 | 93,511 | 2044/12/20 |
| 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 | 300,000 | 297,324 | 2035/3/20 |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.974 | 100,000 | 96,117 | 2055/3/19 |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.284 | 100,000 | 100,388 | 2035/9/20 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.266 | 50,000 | 53,997 | 2029/6/28 |
| 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 | 106,862 | 2030/10/28 |
| 第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.132 | 100,000 | 108,807 | 2031/1/28 |
| 第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.187 | 80,000 | 87,380 | 2031/4/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.846 | 80,000 | 85,625 | 2031/8/28 |
| 第17回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.39 | 150,000 | 155,391 | 2026/3/24 |
| 第22回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.32 | 1,000,000 | 1,055,210 | 2027/6/18 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.68 | 100,000 | 105,810 | 2032/7/28 |
| 第24回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.29 | 300,000 | 320,007 | 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 | 200,000 | 212,028 | 2032/9/28 |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.785 | 50,000 | 53,334 | 2033/1/28 |
| 第29回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債) | 0.005 | 500,000 | 494,750 | 2026/7/28 |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.298 | 100,000 | 100,608 | 2035/6/28 |
| 第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.491 | 300,000 | 300,570 | 2025/10/28 |
| F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.609 | 100,000 | 103,854 | 2028/1/28 |
| F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.546 | 70,000 | 73,465 | 2031/7/30 |
| F134回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.348 | 300,000 | 308,847 | 2028/3/17 |
| F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.348 | 100,000 | 102,761 | 2027/11/5 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| F 203回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | | 1.063 | 200,000 | 203,746 | 2028/2/28 |
| F 234回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) | | 1.605 | 100,000 | 103,868 | 2035/4/27 |
| 第27回首都高速道路 | | 0.06 | 100,000 | 99,418 | 2025/12/19 |
| 第10回日本政策金融公庫 (財投機関債) | | 2.167 | 80,000 | 86,645 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫 (財投機関債) | | 1.911 | 80,000 | 85,681 | 2030/10/29 |
| 第48回福祉医療機構債券 (財投機関債) | | 0.175 | 400,000 | 396,660 | 2026/12/18 |
| 第54回福祉医療機構債券 (財投機関債) | | 0.225 | 100,000 | 98,496 | 2028/6/20 |
| 第4回中部国際空港 (財投機関債) | | 0.305 | 200,000 | 198,570 | 2027/2/22 |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | | 0.18 | 28,640 | 28,273 | 2032/5/10 |
| 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4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | | 0.08 | 34,682 | 34,169 | 2033/4/10 |
| 第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | | 0.13 | 49,638 | 48,691 | 2034/6/10 |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.95 | 17,886 | 18,579 | 2044/10/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.89 | 17,821 | 18,472 | 2044/12/10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.88 | 18,136 | 18,789 | 2045/2/10 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.87 | 17,608 | 18,234 | 2045/4/10 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.81 | 33,562 | 34,652 | 2045/5/10 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.71 | 34,846 | 35,925 | 2045/6/10 |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.61 | 18,987 | 19,540 | 2045/7/10 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.36 | 36,766 | 37,517 | 2045/9/10 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.6 | 21,889 | 22,607 | 2045/12/10 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.77 | 82,976 | 86,126 | 2046/1/10 |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.79 | 51,525 | 53,230 | 2046/2/10 |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.92 | 14,851 | 15,314 | 2046/4/10 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.89 | 31,856 | 32,915 | 2046/5/10 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.76 | 32,576 | 33,570 | 2046/6/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.67 | 33,780 | 34,739 | 2046/7/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 35,550 | 36,578 | 2046/8/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.51 | 38,230 | 39,224 | 2046/9/10 |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.48 | 40,358 | 41,397 | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.42 | 22,605 | 23,165 | 2047/1/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 22,782 | 23,364 | 2047/2/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 48,388 | 49,637 | 2047/4/10 |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.34 | 48,782 | 49,849 | 2047/5/10 |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.26 | 49,466 | 50,303 | 2047/6/10 |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 27,999 | 28,373 | 2047/7/10 |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.11 | 27,417 | 27,665 | 2047/8/10 |
| 第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.15 | 190,620 | 192,348 | 2047/10/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.12 | 91,701 | 92,437 | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.25 | 28,709 | 29,145 | 2048/3/10 |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.32 | 32,258 | 32,807 | 2048/7/10 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 27,156 | 27,532 | 2048/9/10 |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債) | | 1.751 | 30,000 | 30,793 | 2026/6/19 |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 28,392 | 28,609 | 2048/11/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 32,000 | 32,158 | 2049/2/10 |

| 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83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.04 | 34,607 | 34,665 | 2049/4/10 |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.01 | 135,172 | 135,266 | 2049/5/10 |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.02 | 70,408 | 70,430 | 2049/6/10 |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.863 | 100,000 | 107,095 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.95 | 37,773 | 37,568 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.87 | 116,622 | 115,433 | 2049/11/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.74 | 41,251 | 40,431 | 2050/1/10 |
| 第93回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.557 | 200,000 | 205,452 | 2026/12/18 |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.81 | 52,255 | 51,228 | 2050/4/10 |
| 第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.74 | 49,730 | 48,504 | 2050/5/10 |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.9 | 51,125 | 50,248 | 2050/7/10 |
| 第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.892 | 200,000 | 214,854 | 2032/4/16 |
| 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 | 102,626 | 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106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.54 | 113,826 | 108,750 | 2051/3/10 |
| 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109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 249,524 | 235,730 | 2051/6/10 |
| 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111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.19 | 515,288 | 480,959 | 2051/8/10 |
| 第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.46 | 133,334 | 126,139 | 2052/2/10 |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.47 | 463,512 | 439,233 | 2052/3/10 |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.227 | 130,000 | 139,157 | 2042/9/19 |
| 第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.44 | 206,427 | 194,518 | 2052/7/10 |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.801 | 100,000 | 106,721 | 2032/9/17 |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 68,313 | 64,199 | 2052/10/10 |
| 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 70,652 | 66,173 | 2052/12/10 |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 69,151 | 64,935 | 2053/1/10 |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.46 | 142,058 | 133,538 | 2053/2/10 |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 141,884 | 133,044 | 2053/3/10 |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 70,629 | 66,044 | 2053/4/10 |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 70,105 | 65,580 | 2053/5/10 |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.42 | 214,116 | 200,491 | 2053/6/10 |
| 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137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.47 | 146,690 | 137,562 | 2053/10/10 |
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.5 | 145,478 | 136,788 | 2053/11/10 |
| 第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.192 | 100,000 | 102,449 | 2028/10/20 |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.21 | 154,452 | 141,289 | 2054/8/10 |
| 第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.15 | 234,405 | 213,165 | 2054/9/10 |
| 第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.21 | 238,764 | 218,008 | 2054/11/10 |
| 第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.26 | 161,718 | 148,091 | 2054/12/10 |
| 第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.33 | 80,234 | 73,930 | 2055/1/10 |
| 第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.34 | 161,584 | 148,835 | 2055/2/10 |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.37 | 83,350 | 76,817 | 2055/9/10 |
| 第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.713 | 100,000 | 100,572 | 2027/6/18 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.35 | 168,884 | 155,354 | 2055/11/10 |
| 第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.514 | 100,000 | 100,239 | 2025/8/20 |
| 第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 85,251 | 78,400 | 2056/2/10 |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 256,449 | 236,369 | 2056/5/10 |
| 第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.39 | 173,996 | 160,111 | 2056/6/10 |
| 第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 174,098 | 160,009 | 2056/7/10 |
| 第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.31 | 176,090 | 161,004 | 2056/8/10 |
| 第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.31 | 87,636 | 80,111 | 2056/9/10 |
| 第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.129 | 180,000 | 177,199 | 2035/11/20 |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.36 | 89,716 | 82,312 | 2056/12/10 |
| 第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.32 | 178,670 | 163,145 | 2057/1/10 |
| 第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 179,176 | 164,736 | 2057/2/10 |
| 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 | 180,274 | 166,529 | 2057/4/10 |
| 第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.5 | 90,265 | 83,839 | 2057/5/10 |
| 第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.5 | 90,762 | 84,201 | 2057/6/10 |
| 第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.5 | 183,548 | 170,112 | 2057/7/10 |
| 第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.53 | 183,272 | 170,180 | 2057/8/10 |
| 第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.5 | 185,086 | 171,376 | 2057/9/10 |
| 第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.74 | 93,233 | 88,397 | 2057/11/10 |
| 第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.02 | 186,570 | 181,138 | 2058/1/10 |
| 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 | 94,834 | 92,113 | 2058/4/10 |
| 第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.04 | 378,580 | 370,520 | 2058/5/10 |
| 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194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.075 | 100,000 | 98,999 | 2026/10/20 |
| 第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.93 | 194,318 | 188,078 | 2058/8/10 |
| 第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.02 | 291,615 | 284,715 | 2058/9/10 |
| 第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 195,046 | 191,299 | 2058/10/10 |
| 第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.18 | 195,288 | 193,257 | 2058/11/10 |
| 第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.11 | 391,924 | 385,539 | 2058/12/10 |
| 第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.05 | 296,040 | 290,048 | 2059/1/10 |
| 第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.0 | 296,358 | 288,969 | 2059/2/10 |
| 第202回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 99,456 | 97,990 | 2059/3/10 |
| 第203回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.14 | 399,120 | 394,849 | 2059/4/10 |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.24 | 100,000 | 99,224 | 2027/3/19 |
| 第204回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 300,000 | 298,287 | 2059/5/10 |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債) | | 2.04 | 50,000 | 50,963 | 2025/6/20 |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.991 | 70,000 | 75,545 | 2031/6/13 |
| 第83回東日本高速道路 | | 0.05 | 400,000 | 396,132 | 2026/6/19 |
| 第111回東日本高速道路 | | 0.607 | 200,000 | 199,014 | 2029/4/25 |
| 第29回西日本高速道路 | | 0.31 | 200,000 | 199,494 | 2026/2/12 |
| 第56回西日本高速道路 | | 0.06 | 900,000 | 896,301 | 2025/9/19 |
| 第61回西日本高速道路 | | 0.04 | 700,000 | 693,084 | 2026/6/19 |

| 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 | 101,129 | 2029/11/27 |
| 小 計 | | 34,900,958 | 34,758,179 | |
| 金融債券 | | | | |
| い第843号商工債券 | 0.12 | 200,000 | 199,330 | 2025/8/27 |
| い第848号商工債券 | 0.1 | 100,000 | 99,296 | 2026/1/27 |
| い第850号商工債券 | 0.1 | 300,000 | 297,498 | 2026/3/27 |
| い第852号商工債券 | 0.09 | 100,000 | 98,962 | 2026/5/27 |
| い第854号商工債券 | 0.08 | 500,000 | 494,175 | 2026/7/27 |
| い第857号商工債券 | 0.09 | 100,000 | 98,692 | 2026/10/27 |
| い第871号商工債券 | 0.35 | 200,000 | 197,280 | 2027/12/27 |
| い第872号商工債券 | 0.45 | 400,000 | 395,740 | 2028/1/27 |
| い第885号商工債券 | 0.65 | 400,000 | 396,308 | 2029/2/27 |
| 第376回信金中金債 | 0.05 | 100,000 | 99,183 | 2026/3/27 |
| 第32号商工債券(10年) | 0.25 | 200,000 | 192,648 | 2029/12/20 |
| 第280号商工債券(3年) | 0.22 | 200,000 | 198,448 | 2026/5/27 |
| 第2回信金中金債(10年) | 0.52 | 100,000 | 100,218 | 2025/9/26 |
| 小 計 | | 2,900,000 | 2,867,778 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第548回東京電力 | 2.347 | 100,000 | 102,178 | 2028/9/29 |
| 第567回東京電力 | 1.958 | 100,000 | 99,961 | 2030/7/29 |
| 第566回中部電力 | 1.071 | 300,000 | 295,476 | 2034/4/25 |
| 第508回関西電力 | 0.455 | 200,000 | 198,494 | 2027/4/23 |
| 第510回関西電力 | 0.49 | 500,000 | 496,095 | 2027/7/23 |
| 第511回関西電力 | 0.41 | 100,000 | 98,888 | 2027/9/17 |
| 第518回関西電力 | 0.44 | 200,000 | 197,018 | 2028/6/20 |
| 第524回関西電力 | 0.514 | 200,000 | 196,946 | 2028/10/25 |
| 第400回中国電力 | 0.34 | 200,000 | 197,498 | 2027/9/24 |
| 第409回中国電力 | 0.4 | 200,000 | 196,328 | 2028/9/25 |
| 第446回中国電力 | 0.7 | 100,000 | 97,663 | 2031/3/25 |
| 第448回中国電力 | 0.92 | 200,000 | 194,386 | 2033/5/25 |
| 第322回北陸電力 | 0.38 | 100,000 | 99,007 | 2027/6/25 |
| 第492回東北電力 | 0.405 | 300,000 | 297,480 | 2027/4/23 |
| 第494回東北電力 | 0.425 | 200,000 | 198,290 | 2027/6/25 |
| 第527回東北電力 | 0.32 | 400,000 | 380,752 | 2031/2/25 |
| 第552回東北電力 | 0.864 | 400,000 | 399,992 | 2028/12/25 |
| 第449回九州電力 | 0.43 | 300,000 | 297,612 | 2027/4/23 |
| 第451回九州電力 | 0.45 | 300,000 | 297,678 | 2027/5/25 |
| 第468回九州電力 | 0.435 | 100,000 | 98,349 | 2028/8/25 |
| 第471回九州電力 | 0.455 | 300,000 | 294,507 | 2028/11/24 |
| 第484回九州電力 | 0.375 | 400,000 | 387,736 | 2029/11/22 |
| 第503回九州電力 | 0.36 | 600,000 | 594,012 | 2027/4/23 |
| 第524回九州電力 | 1.161 | 300,000 | 295,251 | 2034/4/25 |
| 第12回新関西国際空港 | 1.067 | 100,000 | 101,526 | 2029/9/20 |
| 第27回新関西国際空港 | 0.05 | 100,000 | 99,193 | 2026/3/19 |
| 第32回成田国際空港 | 0.22 | 100,000 | 97,697 | 2029/1/29 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第1回国際石油開発帝石 | 0.08 | 100,000 | 99,108 | 2026/3/16 |
| 第48回鹿島建設(サステナビリティ) | 0.554 | 100,000 | 99,399 | 2028/3/16 |
| 第10回明治ホールディングス(サステナビリティ) | 0.05 | 200,000 | 198,078 | 2026/4/23 |
| 第16回アサヒグループホールディングス | 0.08 | 100,000 | 99,193 | 2026/3/13 |
| 第19回アサヒグループホールディングス | 0.28 | 400,000 | 398,280 | 2026/3/6 |
| 第21回キリンホールディングス(ソーシャル) | 0.29 | 300,000 | 296,331 | 2027/6/7 |
| 第22回キリンホールディングス(ソーシャル) | 0.673 | 100,000 | 99,405 | 2028/10/26 |
| 第9回サントリーホールディングス | 0.3 | 500,000 | 495,295 | 2027/6/8 |
| 第22回味の素 | 0.305 | 100,000 | 99,660 | 2026/3/2 |
| 第3回 キューピー | 0.23 | 100,000 | 99,513 | 2026/2/13 |
| 第13回日本たばこ産業 | 0.355 | 400,000 | 392,564 | 2028/9/8 |
| 第16回日本たばこ産業 | 0.92 | 300,000 | 293,262 | 2033/4/20 |
| 第6回ヒューリック | 0.494 | 400,000 | 392,372 | 2028/10/20 |
| 第13回ヒューリック | 0.569 | 300,000 | 299,334 | 2027/4/16 |
| 第14回ヒューリック | 0.806 | 300,000 | 299,268 | 2029/4/18 |
| 第24回森ヒルズリート投資法人(グリーン) | 0.49 | 300,000 | 297,567 | 2026/11/27 |
| 第9回クラレ | 0.34 | 100,000 | 98,993 | 2027/4/30 |
| 第56回住友化学 | 0.38 | 200,000 | 196,866 | 2027/9/13 |
| 第59回住友化学 | 0.355 | 200,000 | 195,640 | 2028/4/17 |
| 第3回三菱ケミカルグループ | 0.758 | 500,000 | 496,635 | 2028/12/5 |
| 第4回野村総合研究所 | 0.34 | 100,000 | 98,278 | 2028/3/23 |
| 第12回野村総合研究所 | 0.624 | 200,000 | 197,954 | 2028/12/7 |
| 第6回花王 | 0.13 | 200,000 | 199,126 | 2025/9/19 |
| 第1回アステラス製薬 | 0.26 | 400,000 | 398,664 | 2025/12/5 |
| 第10回テルモ | 0.519 | 300,000 | 299,328 | 2027/4/23 |
| 第17回Zホールディングス | 0.79 | 100,000 | 98,879 | 2027/6/11 |
| 第22回Zホールディングス | 0.76 | 200,000 | 197,216 | 2027/9/15 |
| 第7回住友三井オートサービス(サステナビリティ) | 0.14 | 100,000 | 98,653 | 2026/10/22 |
| 第8回住友三井オートサービス(サステナビリティ) | 0.4 | 100,000 | 99,581 | 2026/2/17 |
| 第12回日本電気硝子 | 0.26 | 100,000 | 98,142 | 2028/2/25 |
| 第4回新日本製鐵 | 0.375 | 200,000 | 197,950 | 2027/5/20 |
| 第36回ジェイ エフ イー ホールディングス | 0.33 | 400,000 | 395,224 | 2027/6/9 |
| 第1回住友生命2023基金 | 0.705 | 400,000 | 393,824 | 2028/8/8 |
| 第14回LIXIL | 0.475 | 200,000 | 197,676 | 2027/8/27 |
| 第1回日本郵政(グリーン) | 0.255 | 100,000 | 98,538 | 2027/9/1 |
| 第4回日本郵政 | 0.603 | 500,000 | 496,595 | 2028/10/24 |
| 第9回住友重機械工業 | 0.736 | 200,000 | 199,512 | 2029/4/18 |
| 第30回ダイキン工業 | 0.459 | 200,000 | 195,532 | 2029/7/27 |
| 第22回パナソニック | 0.29 | 100,000 | 98,021 | 2027/12/24 |
| 第24回パナソニックホールディングス | 0.709 | 300,000 | 297,531 | 2028/9/14 |
| 第25回パナソニックホールディングス | 1.051 | 800,000 | 799,296 | 2030/9/13 |
| 第40回ソニーグループ | 0.627 | 600,000 | 595,866 | 2029/3/7 |
| 第15回デンソー | 0.245 | 300,000 | 296,532 | 2027/6/18 |
| 第18回デンソー | 0.315 | 300,000 | 295,629 | 2028/3/17 |
| 第40回三菱重工業 | 0.31 | 300,000 | 295,812 | 2027/9/8 |

| 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14回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 0.574 | 500,000 | 498,670 | 2027/4/19 |
| 第26回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 0.05 | 800,000 | 792,680 | 2026/3/18 |
| 第27回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 0.219 | 600,000 | 572,154 | 2031/3/18 |
| 第31回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 0.735 | 200,000 | 193,180 | 2033/6/1 |
| 第6回ヤマハ発動機 | 0.569 | 100,000 | 99,805 | 2027/4/23 |
| 第1回明治安田生命2019基金 | 0.29 | 200,000 | 199,892 | 2024/8/2 |
| 第7回アシックス | 0.792 | 100,000 | 99,451 | 2028/12/14 |
| 第63回三井物産 | 2.37 | 400,000 | 419,876 | 2027/4/23 |
| 第40回住友商事 | 2.261 | 200,000 | 216,030 | 2030/5/27 |
| 第51回住友商事 | 1.241 | 100,000 | 101,893 | 2029/4/23 |
| 第53回住友商事 | 0.33 | 300,000 | 296,592 | 2027/7/26 |
| 第55回住友商事 | 0.33 | 500,000 | 491,910 | 2028/4/13 |
| 第61回住友商事 | 0.644 | 100,000 | 99,684 | 2028/3/1 |
| 第44回丸井グループ | 0.629 | 100,000 | 98,613 | 2029/1/23 |
| 第101回クレディセゾン | 0.599 | 500,000 | 498,585 | 2027/4/30 |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ | 0.724 | 300,000 | 299,583 | 2025/3/5 |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ | 0.535 | 500,000 | 486,115 | 2028/5/31 |
| 第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 2.91 | 200,000 | 216,478 | 2029/10/16 |
| 第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 1.95 | 200,000 | 202,884 | 2025/11/12 |
| 第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 2.16 | 200,000 | 203,804 | 2026/1/20 |
| 第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付) | 2.46 | 100,000 | 106,163 | 2031/1/20 |
| 第88回三菱東京UFJ銀行 | 2.34 | 100,000 | 104,718 | 2027/4/20 |
| 第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付 | 0.545 | 100,000 | 97,032 | 2028/6/12 |
| 第18回みずほ銀行(劣後特約付) | 2.14 | 100,000 | 102,282 | 2026/9/11 |
| 第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ) | 0.808 | 400,000 | 399,168 | 2028/10/27 |
| 第40回芙蓉総合リース(サステナビリティ) | 0.707 | 100,000 | 99,148 | 2029/2/28 |
| 第7回みずほリース | 0.33 | 500,000 | 491,590 | 2028/1/20 |
| 第9回みずほリース | 0.23 | 300,000 | 292,263 | 2028/9/1 |
| 第12回みずほリース | 0.34 | 200,000 | 195,218 | 2028/12/15 |
| 第21回みずほリース | 0.599 | 300,000 | 296,913 | 2028/9/6 |
| 第22回みずほリース(サステナビリティ) | 0.639 | 300,000 | 297,789 | 2028/6/12 |
| 第23回みずほリース | 0.693 | 200,000 | 198,166 | 2029/2/28 |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 0.18 | 1,200,000 | 1,193,040 | 2025/12/19 |
| 第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 0.28 | 300,000 | 295,371 | 2027/12/20 |
| 第18回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 0.38 | 1,500,000 | 1,450,380 | 2030/9/20 |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.648 | 300,000 | 295,701 | 2030/6/20 |
| 第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.838 | 200,000 | 194,154 | 2033/6/20 |
| 第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.614 | 300,000 | 297,951 | 2028/9/20 |
| 第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.86 | 300,000 | 298,995 | 2030/9/20 |
| 第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 1.213 | 200,000 | 200,158 | 2033/9/20 |
| 第53回日産フィナンシャルサービス | 0.58 | 300,000 | 295,812 | 2026/9/18 |
| 第56回日産フィナンシャルサービス | 0.52 | 500,000 | 494,500 | 2026/6/19 |
| 第57回日産フィナンシャルサービス | 0.834 | 400,000 | 392,188 | 2028/6/20 |
| 第58回日産フィナンシャルサービス | 0.7 | 100,000 | 99,510 | 2027/3/19 |
| 第30回東京センチュリー | 0.29 | 100,000 | 98,200 | 2028/1/27 |

| 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34回東京センチュリー | 0.22 | 300,000 | 292,461 | 2028/7/21 |
| 第102回トヨタファイナンス | 0.414 | 700,000 | 697,053 | 2027/4/9 |
| 第103回トヨタファイナンス | 0.617 | 300,000 | 298,035 | 2029/4/11 |
| 第22回ポケットカード | 0.3 | 100,000 | 99,378 | 2025/10/29 |
| 第23回ポケットカード | 0.2 | 200,000 | 196,568 | 2026/12/3 |
| 第24回ポケットカード | 0.898 | 300,000 | 297,621 | 2028/11/22 |
| 第42回リコーリース | 0.39 | 400,000 | 395,680 | 2027/6/1 |
| 第209回オリックス | 0.39 | 500,000 | 494,230 | 2027/9/1 |
| 第220回オリックス | 0.723 | 400,000 | 397,224 | 2028/11/29 |
| 第222回オリックス | 0.677 | 500,000 | 495,145 | 2029/3/7 |
| 第34回三井住友ファイナンス&リース | 0.43 | 300,000 | 299,130 | 2026/2/2 |
| 第2回三菱HCキャピタル | 0.19 | 500,000 | 492,170 | 2027/3/1 |
| 第40回大和証券グループ本社 | 0.575 | 500,000 | 497,560 | 2026/11/27 |
| 第3回野村ホールディングス | 0.28 | 200,000 | 197,100 | 2026/9/4 |
| 第24回野村ホールディングス | 2.329 | 100,000 | 101,798 | 2025/6/24 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 101,823 | 2025/9/24 |
| 第83回三井不動産(グリーン) | 0.81 | 200,000 | 192,456 | 2033/6/6 |
| 第142回三菱地所(サステナビリティ) | 0.43 | 200,000 | 197,684 | 2028/5/2 |
| 第143回三菱地所 | 0.9 | 100,000 | 96,989 | 2033/5/2 |
| 第111回住友不動産(グリーン) | 0.52 | 100,000 | 99,058 | 2028/4/28 |
| 第76回東京急行電鉄 | 1.563 | 200,000 | 205,544 | 2027/6/7 |
| 第36回京王電鉄 | 0.325 | 200,000 | 197,786 | 2027/9/17 |
| 第53回東日本旅客鉄道 | 2.35 | 300,000 | 319,356 | 2028/4/21 |
| 第71回東日本旅客鉄道 | 1.905 | 400,000 | 425,184 | 2030/9/27 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 1.981 | 200,000 | 201,118 | 2044/1/29 |
| 第163回東日本旅客鉄道 | 0.05 | 600,000 | 594,402 | 2026/4/15 |
| 第73回西日本旅客鉄道 | 0.05 | 400,000 | 396,228 | 2026/4/22 |
| 第42回東海旅客鉄道 | 2.312 | 100,000 | 107,276 | 2029/4/24 |
| 第53回東海旅客鉄道 | 1.797 | 100,000 | 105,609 | 2030/10/25 |
| 第28回東京地下鉄 | 0.25 | 300,000 | 294,591 | 2028/5/24 |
| 第50回阪急阪神ホールディングス | 0.345 | 200,000 | 196,836 | 2028/9/13 |
| 第58回阪急阪神ホールディングス | 0.09 | 200,000 | 198,458 | 2026/2/26 |
| 第68回名古屋鉄道(サステナビリティ) | 0.375 | 200,000 | 196,606 | 2028/7/13 |
| 第71回名古屋鉄道 | 0.35 | 400,000 | 396,928 | 2027/3/12 |
| 第14回日本通運 | 0.28 | 200,000 | 197,534 | 2027/6/16 |
| 第1回横浜高速鉄道 | 0.62 | 300,000 | 299,658 | 2026/2/25 |
| 第20回三菱倉庫 | 0.759 | 100,000 | 98,764 | 2031/3/14 |
| 第31回KDDI(サステナビリティ) | 0.43 | 200,000 | 197,854 | 2027/10/27 |
| 第9回ソフトバンク | 0.48 | 600,000 | 585,972 | 2027/12/3 |
| 第13回ソフトバンク | 0.52 | 500,000 | 465,070 | 2031/6/3 |
| 第16回ソフトバンク | 0.52 | 500,000 | 462,275 | 2031/10/10 |
| 第21回ソフトバンク | 0.82 | 700,000 | 688,877 | 2028/7/12 |
| 第22回ソフトバンク | 1.0 | 300,000 | 292,674 | 2030/7/12 |
| 第49回電源開発 | 0.4 | 500,000 | 495,245 | 2027/5/20 |
| 第50回電源開発 | 0.415 | 200,000 | 198,084 | 2027/7/20 |

| 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57回電源開発 | | 0.355 | 100,000 | 98,115 | 2028/7/20 |
| 第59回電源開発 | | 0.414 | 300,000 | 294,615 | 2028/9/20 |
| 第64回電源開発 | | 0.405 | 600,000 | 586,020 | 2029/4/20 |
| 第67回電源開発 | | 0.24 | 200,000 | 192,870 | 2029/9/20 |
| 第86回電源開発 | | 0.93 | 100,000 | 97,217 | 2033/5/20 |
| 第87回電源開発 (グリーン) | | 1.106 | 200,000 | 196,052 | 2034/2/20 |
| 第89回電源開発 (グリーン) | | 1.121 | 200,000 | 196,516 | 2034/4/20 |
| 第6回東京電力パワーグリッド | | 0.85 | 100,000 | 99,879 | 2027/8/31 |
| 第13回東京電力パワーグリッド | | 0.77 | 300,000 | 297,444 | 2028/4/19 |
| 第15回東京電力パワーグリッド | | 0.89 | 100,000 | 97,867 | 2030/7/24 |
| 第25回東京電力パワーグリッド | | 1.02 | 100,000 | 99,659 | 2029/4/24 |
| 第28回東京電力パワーグリッド | | 1.01 | 400,000 | 397,404 | 2029/7/10 |
| 第31回東京電力パワーグリッド | | 0.98 | 300,000 | 297,192 | 2029/10/9 |
| 第33回東京電力パワーグリッド | | 0.68 | 700,000 | 697,200 | 2027/1/27 |
| 第35回東京電力パワーグリッド | | 1.2 | 100,000 | 99,887 | 2030/4/23 |
| 第39回東京電力パワーグリッド | | 1.08 | 400,000 | 396,080 | 2030/7/16 |
| 第47回東京電力パワーグリッド | | 0.68 | 200,000 | 190,242 | 2031/8/29 |
| 第49回東京電力パワーグリッド | | 0.6 | 400,000 | 397,044 | 2027/4/26 |
| 第16回 J E R A | | 0.64 | 200,000 | 198,280 | 2028/4/25 |
| 第17回 J E R A | | 0.9 | 400,000 | 396,076 | 2030/4/25 |
| 第21回 J E R A | | 0.689 | 200,000 | 197,888 | 2028/11/24 |
| 第22回 J E R A | | 0.5 | 1,000,000 | 993,540 | 2027/2/25 |
| 第23回 J E R A | | 1.192 | 100,000 | 97,962 | 2034/2/24 |
| 第25回 J E R A | | 1.054 | 400,000 | 398,252 | 2031/4/25 |
| 第3回東京電力リニューアブルパワー (グリーン) | | 0.85 | 400,000 | 398,732 | 2027/9/14 |
| 第51回大阪ガス | | 0.785 | 100,000 | 96,841 | 2033/6/2 |
| 第13回広島ガス | | 0.405 | 200,000 | 195,776 | 2028/9/13 |
| 第7回ファーストリテイリング | | 0.405 | 100,000 | 98,656 | 2028/6/6 |
| 第19回フランス相互信用連合銀行 | | 0.999 | 100,000 | 100,461 | 2025/10/15 |
| 第29回フランス相互信用連合銀行 | | 0.25 | 200,000 | 199,836 | 2024/10/10 |
| 第35回フランス相互信用連合銀行 | | 0.279 | 500,000 | 493,790 | 2026/10/21 |
| 第38回フランス相互信用連合銀行 | | 0.802 | 300,000 | 300,549 | 2025/10/10 |
| 第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.302 | 100,000 | 98,313 | 2026/12/16 |
| 第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.713 | 200,000 | 199,126 | 2026/7/13 |
| 第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.914 | 200,000 | 197,818 | 2028/7/13 |
| 第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.895 | 400,000 | 399,368 | 2026/12/14 |
| 第1回サントアンデル銀行 (2019) | | 0.463 | 500,000 | 498,965 | 2024/12/5 |
| 小 | 計 | | 56,900,000 | 56,319,048 | |
| 合 | 計 | | 950,375,358 | 914,700,021 | |

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | 当 期 | |
|-----|--------|----------|--------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 債券先物取引 | 10年国債標準物 | 百万円 3,311 | 百万円 — |

○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 914,700,021 | % 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 15,187,539 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 929,887,560 | 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 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 929,887,560,233 |
| コール・ローン等 | 13,449,202,663 |
| 公社債(評価額) | 914,700,021,042 |
| 未収利息 | 1,536,128,641 |
| 前払費用 | 140,463,382 |
| 差入委託証拠金 | 61,744,505 |
| (B) 負債 | 9,237,435,827 |
| 未払金 | 1,894,274,505 |
| 未払解約金 | 7,343,161,322 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 920,650,124,406 |
| 元本 | 734,007,365,151 |
| 次期繰越損益金 | 186,642,759,255 |
| (D) 受益権総口数 | 734,007,365,151口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,543円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 552,953,193,068円
期中追加設定元本額 254,696,851,852円
期中一部解約元本額 73,642,679,769円
また、1口当たり純資産額は、期末1.2543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)

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 175,958,816,366円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 111,916,725,165円 |
| 三菱UFJ J プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 59,213,449,032円 |
| 三菱UFJ J 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金) | 42,318,815,867円 |
| 三菱UFJ J プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 37,533,941,113円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 24,721,245,237円 |
| MUAM グローバルバランス(退職給付信託向け)(適格機関投資家限定) | 24,503,259,248円 |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定) | 23,446,887,158円 |
| 三菱UFJ J プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 18,930,825,944円 |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス | 18,405,294,174円 |
| つみたて8資産均等バランス | 12,368,186,970円 |
| 三菱UFJ J ライフセレクトファンド(安定成長型) | 12,165,840,984円 |
| 三菱UFJ J ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 11,567,969,451円 |
| 三菱UFJ J バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 8,994,011,242円 |
| 三菱UFJ J ライフセレクトファンド(安定型) | 7,900,455,072円 |
| 三菱UFJ J DC年金バランス(株式40) | 7,530,798,013円 |
| 三菱UFJ J DC年金バランス(株式15) | 7,397,848,968円 |
| 三菱UFJ J ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 6,668,384,159円 |
| ラップ向けインデックスf 国内債券 | 6,622,297,618円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | 6,255,315,656円 |
| 三菱UFJ J 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定) | 5,700,588,088円 |
| 三菱UFJ J ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 5,626,856,065円 |
| 日本債券インデックスファンドS | 5,544,171,553円 |
| 国内債券セレクション(ラップ向け) | 5,237,609,746円 |

○損益の状況 (2023年5月13日~2024年5月13日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 5,756,517,764 |
| 受取利息 | 5,757,618,467 |
| 支払利息 | △ 1,100,703 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 40,438,972,489 |
| 売買益 | 156,011,016 |
| 売買損 | △ 40,594,983,505 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 41,129,190 |
| 取引益 | 8,009,430 |
| 取引損 | △ 49,138,620 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 34,723,583,915 |
| (E) 前期繰越損益金 | 170,524,354,914 |
| (F) 追加信託差損益金 | 71,360,783,663 |
| (G) 解約差損益金 | △ 20,518,795,407 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 186,642,759,255 |
| 次期繰越損益金(H) | 186,642,759,255 |

(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。

| | |
|--|----------------|
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 4,941,517,546円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 4,885,797,575円 |
| つみたて4資産均等バランス | 4,802,081,776円 |
| eMAXIS バランス (8資産均等型) | 4,651,718,360円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 4,588,038,506円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,406,076,955円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 4,282,223,340円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型) | 3,294,331,907円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型) | 3,096,184,079円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 3,062,415,892円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 3,011,040,143円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 2,842,938,302円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) | 2,634,143,780円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 2,499,242,039円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 2,485,992,478円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型) | 2,303,871,049円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 2,272,430,672円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型) | 2,188,104,377円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 2,099,476,552円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 2,005,690,169円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド | 1,737,524,912円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定) | 1,606,571,779円 |
| 国内債券インデックスファンド (ラップ向け) | 1,573,070,841円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 1,452,531,530円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 1,238,179,419円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 1,236,716,237円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 930,801,383円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 616,797,431円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 611,362,804円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定) | 490,248,647円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定) | 478,244,702円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定) | 477,769,455円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定) | 477,586,919円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定) | 476,937,873円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定) | 476,919,903円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 469,836,335円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定) | 469,323,041円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定) | 462,440,331円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 450,459,048円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 429,832,474円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定) | 424,729,389円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 424,280,144円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定) | 421,626,267円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定) | 420,955,442円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 419,477,595円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定) | 418,690,273円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定) | 416,840,490円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 416,234,104円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定) | 413,671,752円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型) | 216,560,403円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型) | 196,485,913円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 140,181,077円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 91,833,237円 |
| eMAXIS バランス (波乗り型) | 89,944,163円 |

| | |
|------------------------------------|------------------|
| eMAXIS 債券バランス (2資産均等型) | 77,885,369円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 58,975,151円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 56,719,654円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 47,853,897円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 30,896,965円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 28,612,137円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 22,848,932円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 19,963,028円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 19,139,611円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 18,511,753円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 14,899,556円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 11,241,175円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 9,888,453円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 9,458,513円 |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 6,066,272円 |
| 国内債券インデックスオープンV (適格機関投資家限定) | 5,319,921円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーズ・ファンド2070 (確定拠出年金) | 3,537,687円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 3,440,927円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,156,260円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 1,607,512円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 459,872円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定) | 308,807円 |
| 合計 | 734,007,365,151円 |

【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)