

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10月28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	ベビード ファンド	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。
	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	ベビード ファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザー ファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

*当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書



eMAXIS 国内債券インデックス



第4期（決算日：2013年1月28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「eMAXIS 国内債券インデックス」は、去る1月28日に第4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投信

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

URL : <http://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト URL : <http://maxis.muam.jp/e/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

お客様専用フリーダイヤル

TEL. 0120-151034

(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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

目次

eMAXIS 国内債券インデックスのご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇当期の運用経過	2
◇収益分配金	4
◇今後の運用方針	4
◇1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細	5
◇売買および取引の状況	5
◇主要な売買銘柄	5
◇利害関係人との取引状況等	6
◇組入資産の明細	6
◇投資信託財産の構成	14
◇資産、負債、元本および基準価額の状況	14
◇損益の状況	14
◇分配金のお知らせ	15
◇お知らせ	15

マザーファンドのご報告

◇日本債券インデックスマザーファンド	16
--------------------------	----

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。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		NOMURA-BPI総合		債券組 入率	債券先 物率	純資産 総額
		税込み 分配金	期 中 騰落率		期 中 騰落率			
(設 定 日) 2009年10月28日	円 10,000	円 —	% —	319.47	% —	% —	% —	百万円 1
1 期 (2010年 1 月26日)	10,093	0	0.9	322.80	1.0	99.4	—	145
2 期 (2011年 1 月26日)	10,237	0	1.4	328.85	1.9	99.4	—	875
3 期 (2012年 1 月26日)	10,449	0	2.1	337.28	2.6	99.5	—	1,335
4 期 (2013年 1 月28日)	10,621	0	1.6	344.18	2.0	99.0	0.5	2,131

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA-BPI 総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デレージション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(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」は買建比率一売建比率。

(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	NOMURA-BPI総合		債券組入 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2012年 1 月26日	円	%		%	%	%
	10,449	—	337.28	—	99.5	—
1 月末	10,460	0.1	337.61	0.1	99.7	—
2 月末	10,468	0.2	338.00	0.2	99.5	—
3 月末	10,470	0.2	338.18	0.3	99.7	—
4 月末	10,522	0.7	339.94	0.8	98.9	—
5 月末	10,576	1.2	341.79	1.3	97.5	0.1
6 月末	10,569	1.1	341.73	1.3	99.6	0.1
7 月末	10,605	1.5	342.99	1.7	99.2	0.1
8 月末	10,589	1.3	342.59	1.6	99.2	0.2
9 月末	10,613	1.6	343.47	1.8	99.6	0.1
10月末	10,608	1.5	343.38	1.8	99.5	0.1
11月末	10,631	1.7	344.27	2.1	99.5	0.1
12月末	10,594	1.4	343.26	1.8	99.5	0.2
(期 末) 2013年 1 月28日	10,621	1.6	344.18	2.0	99.0	0.5

(注) 騰落率は期首比。

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

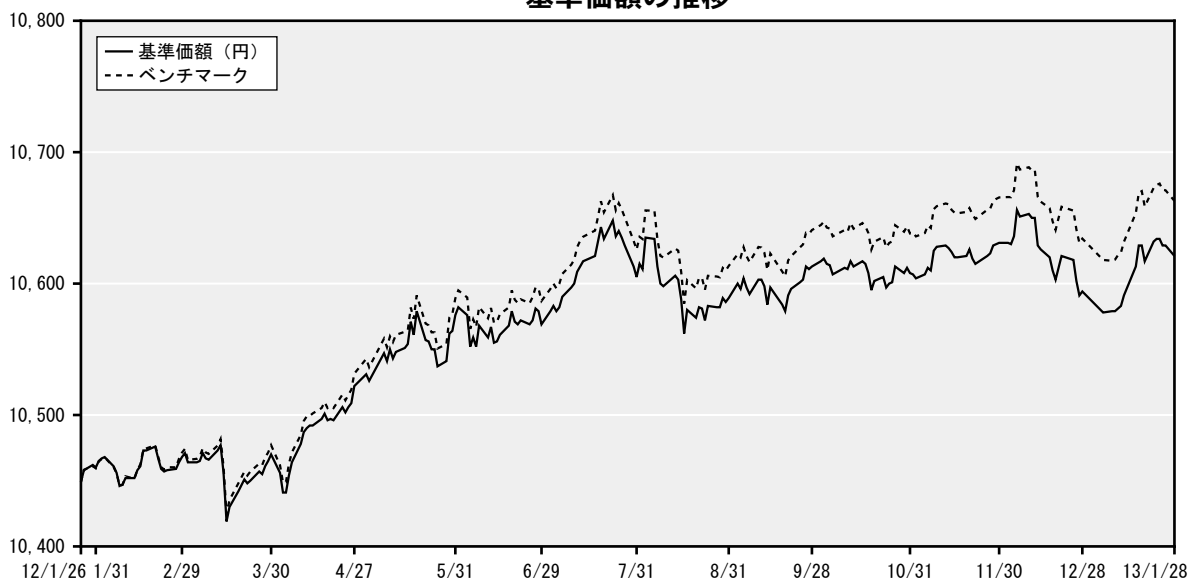
(注) 「債券先物比率」は買建比率一売建比率。

当期の運用経過

基準価額の推移

基準価額は期首に比べ1.6%の上昇となりました。

基準価額の推移



(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。

基準価額の変動要因

国内債券市況（NOMURA-BPI 総合）は期首に比べて2.0%上昇しました。資産のほぼ全額を日本債券インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）に投資したことにより、債券市況とほぼ同様の推移となりました。

＜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は△0.4%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要因は0.1%程度でした。

なお、要因の詳細な説明については、実質的な運用を行っているマザーファンドの項で説明します。

ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は、△0.4%程度と低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク との乖離	△0.4%程度	0.1%程度	△0.4%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

マザーファンドの運用経過は、以下の通りです。

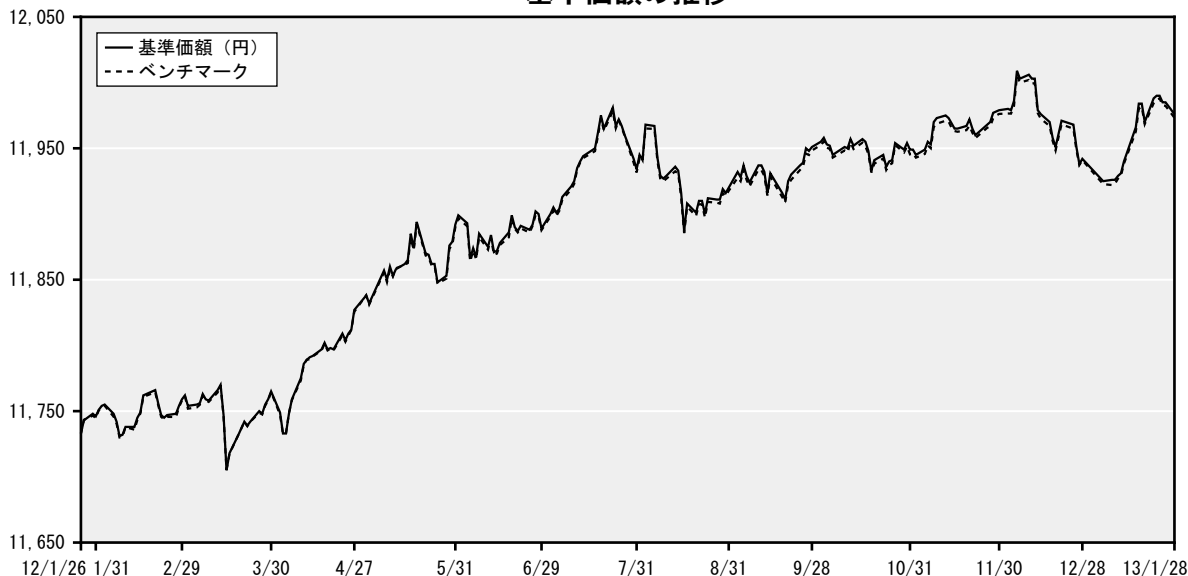
<日本債券インデックスマザーファンド>

(記載文章はベビーファンドの計算期間に基づいています。)

■ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ2.1%の上昇となりました。

基準価額の推移



(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。

■ 基準価額の変動要因

国内債券市況（NOMURA-BPI 総合）は期首に比べて2.0%上昇しました。資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資したことにより、債券市況とほぼ同様の推移となりました。

- ・ユーロ圏の財政や世界経済減速に対する懸念が長引くなか、世界的に金融緩和期待が根強く、債券市況は上昇（金利は低下）しました。

■ ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は0.1%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとの乖離	0.0%程度	△0.0%程度	0.0%程度	0.1%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・当期より、運用効率化のため先物の組み入れを開始しました。
- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、NOMURA-BPI 総合との連動性を高めるよ

う努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。なお、期末現在の組入比率（先物を含む）は、99.5%です。

- ・ポートフォリオの種別構成比については、NOMURA-BPI 総合の債券種別に基づいて、期末時点で国債76.0%、地方債7.5%、政府保証債4.3%、金融債1.3%、事業債8.4%、円建外債0.9%、RMBS（貸付債権担保住宅金融支援機構債）1.4%、ABS0.2%としており、概ねベンチマーク並みとなっています（債券現物部分における

割合です）。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、0.0%程度となりました。

利回り・デュレーション（平均回収期間）

期首（2012年1月26日）

最終利回り	0.7%
直接利回り	1.6%
デュレーション	7.0年



期末（2013年1月28日）

最終利回り	0.6%
直接利回り	1.5%
デュレーション	7.2年

- ・数値は債券現物部分（経過利子を含んでおります）で計算しております（先物は考慮していません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

- ・数値は債券現物部分（経過利子を含んでおります）で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

収益分配金

<eMAXIS 国内債券インデックス>

収益分配金につきましては、基準価額水準や市況動向等を勘案しましたが、見送りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。なお、収益分配金の計算過程につきましては、損益の状況の<注記事項>をご参照ください。

今後の運用方針

<eMAXIS 国内債券インデックス>

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合に連動する成果をめざすべく、ファン

ドの資産のほぼ全額を日本債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合に連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

1 万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	45円 (19) (20) (6)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0)
(c) 保 管 費 用 等	0
合 計	45

(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、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率

(b) 売買委託手数料、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注) 各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保管費用等は、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。

売買および取引の状況

(2012年1月27日～2013年1月28日)

設定、解約状況

	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 2,674,766	千円 3,178,501	千口 2,033,429	千円 2,418,468

主要な売買銘柄

(2012年1月27日～2013年1月28日)

日本債券インデックスマザーファンドにおける公社債の売買

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第259回利付国債（10年）	3,574,953	第72回利付国債（5年）	8,542,502
第262回利付国債（10年）	2,796,705	第253回利付国債（10年）	8,327,043
第325回利付国債（10年）	2,615,255	第256回利付国債（10年）	6,968,604
第285回利付国債（10年）	2,609,675	第71回利付国債（5年）	6,081,112
第323回利付国債（10年）	2,496,876	第259回利付国債（10年）	1,220,824
第256回利付国債（10年）	2,484,710	第281回利付国債（10年）	997,774
第287回利付国債（10年）	2,354,085	第317回利付国債（10年）	984,018
第263回利付国債（10年）	2,336,175	第279回利付国債（10年）	959,938
第321回利付国債（10年）	2,326,350	第270回利付国債（10年）	952,662
第284回利付国債（10年）	2,116,750	第283回利付国債（10年）	885,858

(注) 金額は受渡代金。（経過利子は含まれておりません。）

(注) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

利害関係人との取引状況等

(2012年1月27日～2013年1月28日)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D C
公 社 債	百万円 80,624	百万円 18,807	% 23.3	百万円 65,499	百万円 24,557	% 37.5
債券先物取引	4,460	—	—	3,316	—	—

平均保有割合 0.9%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

(3) 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	買 付 額
公 社 債	百万円 630

(2) 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	買 付 額	売 付 額	期末保有額
公 社 債	百万円 100	百万円 103	百万円 1,064

(4) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	0.581千円
うち利害関係人への支払額 (B)	—千円
(B) / (A)	—%

(注) 売買委託手数料総額は、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です。

* 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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

組入資産の明細

親投資信託残高

種 類	期首（前期末）	当 期	
	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 1,138,280	千口 1,779,617	千円 2,131,269

(注) 日本債券インデックスマザーファンド全体の受益権口数は（期末：176,492,322千口）です。

〈補足情報〉

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体の内容です。

■ 国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債の種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	150,461,000	159,190,620	75.3	—	43.4	21.1	10.9
地 方 債 証 券	13,270,950 (13,270,950)	14,025,688 (14,025,688)	6.6 (6.6)	— (—)	3.9 (3.9)	2.2 (2.2)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債 証 券)	17,944,692 (17,944,692)	18,726,008 (18,726,008)	8.9 (8.9)	— (—)	4.6 (4.6)	3.1 (3.1)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	2,710,000 (2,710,000)	2,744,763 (2,744,763)	1.3 (1.3)	— (—)	0.1 (0.1)	0.9 (0.9)	0.4 (0.4)
普 通 社 債 証 券	14,215,000 (14,215,000)	14,639,518 (14,639,518)	6.9 (6.9)	0.4 (0.4)	2.4 (2.4)	3.8 (3.8)	0.7 (0.7)
合 計	198,601,642 (48,140,642)	209,326,599 (50,135,979)	99.0 (23.7)	0.4 (0.4)	54.3 (11.0)	31.0 (9.9)	13.7 (2.8)

(注) () 内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の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）公社債の詳細開示（個別銘柄別）

2013年1月28日現在

銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第313回利付国債(2年)	0.1	460,000	460,119	2014/2/15
第321回利付国債(2年)	0.1	780,000	780,327	2014/10/15
第322回利付国債(2年)	0.1	1,050,000	1,050,462	2014/11/15
第323回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,100,506	2014/12/15
第89回利付国債(5年)	0.4	620,000	624,798	2015/6/20
第95回利付国債(5年)	0.6	330,000	335,309	2016/3/20
第99回利付国債(5年)	0.4	120,000	121,304	2016/9/20
第103回利付国債(5年)	0.3	500,000	503,595	2017/3/20
第105回利付国債(5年)	0.2	150,000	150,424	2017/6/20
第106回利付国債(5年)	0.2	1,710,000	1,714,326	2017/9/20
第107回利付国債(5年)	0.2	900,000	901,962	2017/12/20
第1回利付国債(40年)	2.4	245,000	265,494	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	340,000	350,220	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	343,000	351,623	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	448,000	457,000	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	365,000	350,754	2052/3/20
第259回利付国債(10年)	1.5	5,415,000	5,502,398	2014/3/20
第262回利付国債(10年)	1.9	5,420,000	5,556,963	2014/6/20
第263回利付国債(10年)	1.6	5,328,000	5,460,933	2014/9/20
第265回利付国債(10年)	1.5	2,988,000	3,068,257	2014/12/20
第268回利付国債(10年)	1.5	3,562,000	3,670,142	2015/3/20
第270回利付国債(10年)	1.3	3,089,000	3,179,106	2015/6/20
第273回利付国債(10年)	1.5	2,388,000	2,477,597	2015/9/20
第276回利付国債(10年)	1.6	3,490,000	3,643,350	2015/12/20
第279回利付国債(10年)	2.0	2,555,000	2,708,351	2016/3/20
第281回利付国債(10年)	2.0	3,543,000	3,771,452	2016/6/20
第283回利付国債(10年)	1.8	3,532,000	3,750,348	2016/9/20
第284回利付国債(10年)	1.7	4,146,000	4,401,186	2016/12/20
第285回利付国債(10年)	1.7	3,818,000	4,066,131	2017/3/20
第287回利付国債(10年)	1.9	3,300,000	3,554,727	2017/6/20
第288回利付国債(10年)	1.7	1,796,000	1,925,114	2017/9/20
第289回利付国債(10年)	1.5	1,533,000	1,633,411	2017/12/20

銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第292回利付国債(10年)	1.7	1,794,000	1,934,685	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	1,441,000	1,565,531	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	1,300,000	1,393,834	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	1,836,000	1,960,205	2018/12/20
第300回利付国債(10年)	1.5	1,257,000	1,350,696	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,122,000	1,206,744	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,905,000	2,038,064	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	1,568,000	1,667,050	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,648,000	1,763,524	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	2,024,000	2,150,823	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	2,256,000	2,345,879	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	1,550,000	1,633,560	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,859,000	1,972,157	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,703,000	1,791,726	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	1,877,000	1,955,665	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	100,000	103,369	2021/12/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,929,000	2,006,989	2022/3/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,705,000	1,755,689	2022/6/20
第323回利付国債(10年)	0.9	2,475,000	2,520,812	2022/9/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,605,000	2,623,782	2022/12/20
第326回利付国債(10年)	0.7	700,000	696,773	2023/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	76,000	90,480	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	98,000	110,580	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	117,000	129,946	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	127,000	152,091	2030/8/20
第5回利付国債(30年)	2.2	108,000	117,255	2031/1/20
第6回利付国債(30年)	2.4	169,000	188,135	2031/4/20
第7回利付国債(30年)	2.3	164,000	179,473	2032/7/20
第8回利付国債(30年)	1.8	142,000	143,043	2032/10/20
第9回利付国債(30年)	1.4	116,000	109,124	2033/1/20
第10回利付国債(30年)	1.1	185,000	164,163	2033/4/20
第11回利付国債(30年)	1.7	137,000	135,258	2033/7/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第12回利付国債(30年)	2.1	150,000	158,079	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	205,000	212,351	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	263,000	290,717	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	346,000	388,194	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	232,000	260,125	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	267,000	294,463	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	297,000	322,031	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	203,000	220,072	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	245,000	274,348	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	229,000	247,961	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	220,000	246,358	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	194,000	217,064	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	191,000	213,879	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	352,000	380,445	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	514,000	565,410	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	430,000	481,376	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	561,000	628,409	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	450,000	494,757	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	686,000	739,727	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	638,000	674,232	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	779,000	838,538	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	704,000	712,236	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	796,000	838,243	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	849,000	856,012	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	789,000	794,112	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	517,000	507,849	2042/9/20
第38回利付国債(20年)	3.7	876,000	959,701	2015/9/21
第32回利付国債(20年)	3.7	77,000	85,708	2016/3/21
第33回利付国債(20年)	3.8	36,000	40,835	2016/9/20
第35回利付国債(20年)	3.3	117,000	132,305	2017/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	201,000	227,544	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	400,000	451,852	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	601,000	671,365	2018/9/20
第42回利付国債(20年)	2.6	869,000	992,371	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	74,000	86,381	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	480,000	550,104	2020/3/20
第47回利付国債(20年)	2.2	114,000	128,784	2020/9/21
第48回利付国債(20年)	2.5	209,000	241,277	2020/12/21
第49回利付国債(20年)	2.1	515,000	578,993	2021/3/22
第51回利付国債(20年)	2.0	200,000	223,344	2021/6/21
第52回利付国債(20年)	2.1	214,000	240,863	2021/9/21
第54回利付国債(20年)	2.2	480,000	544,800	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	241,000	269,524	2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	449,000	502,399	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	147,000	163,147	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	589,000	642,575	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	289,000	295,525	2023/3/20
第63回利付国債(20年)	1.8	442,000	486,014	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	441,000	489,276	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	318,000	352,677	2023/12/20
第68回利付国債(20年)	2.2	846,000	964,126	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	522,000	605,995	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	454,000	512,202	2024/9/20
第74回利付国債(20年)	2.1	528,000	595,399	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	685,000	771,960	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	60,000	66,133	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	495,000	557,157	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	662,000	744,121	2025/12/20
第83回利付国債(20年)	2.1	813,000	912,486	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	725,000	830,081	2026/6/20
第88回利付国債(20年)	2.3	504,000	576,248	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	968,000	1,105,097	2026/12/20
第92回利付国債(20年)	2.1	742,000	826,907	2026/12/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第94回利付国債(20年)	2.1	795,000	884,135	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	747,000	848,845	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	903,000	1,012,281	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	775,000	856,607	2027/12/20
第101回利付国債(20年)	2.4	743,000	850,118	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	900,000	1,028,250	2028/6/20
第106回利付国債(20年)	2.2	791,000	879,512	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	1,057,000	1,157,668	2028/12/20
第110回利付国債(20年)	2.1	856,000	935,471	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	971,000	1,073,100	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	822,000	893,612	2029/9/20
第115回利付国債(20年)	2.2	984,000	1,081,908	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,026,000	1,125,429	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	916,000	974,449	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,089,000	1,138,636	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	868,000	932,240	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,024,000	1,112,698	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	634,000	657,280	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	922,000	939,029	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	937,000	936,325	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	965,000	977,516	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,172,000	1,165,202	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,257,000	1,246,893	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	360,000	356,292	2032/12/20
小計	—	150,461,000	159,190,620	—
地方債証券				
第1回東京都公募公債(20年)	1.54	20,000	21,328	2023/6/20
第8回東京都公募公債(30年)	2.23	80,000	82,350	2038/9/17
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	80,000	85,935	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	80,000	86,905	2029/12/20
第22回東京都公募公債(20年)	1.92	120,000	124,887	2030/6/20
第24回東京都公募公債(20年)	1.98	70,000	72,644	2031/6/20
第615回東京都公募公債	1.53	100,000	102,301	2014/9/19
第619回東京都公募公債	1.53	230,000	236,923	2015/3/20
第624回東京都公募公債	1.5	100,000	103,286	2015/6/20
第630回東京都公募公債	1.63	100,000	104,330	2015/12/18
第636回東京都公募公債	2.04	120,000	127,718	2016/6/20
第638回東京都公募公債	1.9	100,000	106,381	2016/9/20
第648回東京都公募公債	1.84	100,000	107,255	2017/6/20
第651回東京都公募公債	1.62	142,000	151,383	2017/9/20
第666回東京都公募公債	1.46	100,000	106,963	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	54,035	2019/6/20
第676回東京都公募公債	1.37	100,000	106,480	2019/9/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	106,534	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	106,569	2020/3/19
第684回東京都公募公債	1.26	200,000	211,210	2020/6/19
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,341	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	123,484	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	70,000	72,223	2022/3/18
平成16年度第3回北海道公募公債	1.6	100,000	102,009	2014/6/30
平成17年度第1回北海道公募公債	1.4	120,000	123,261	2015/4/28
平成18年度第6回北海道公募公債	2.1	118,000	125,967	2016/8/31
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	119,691	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	21,520	2017/6/29
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	58,168	2018/8/29
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	102,775	2020/10/29
第1回神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	116,741	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	90,642	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	92,193	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	111,561	2025/6/20
第127回神奈川県公募公債	1.8	49,000	50,229	2014/7/30
第139回神奈川県公募公債	1.94	127,700	134,913	2016/3/18
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	117,382	2018/3/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第162回神奈川県公債	1.62	140,450	151,649	2019/6/20
第165回神奈川県公債	1.4	54,660	58,289	2019/9/20
第170回神奈川県公債	1.38	100,000	106,465	2020/3/18
第176回神奈川県公債	1.16	128,900	135,060	2020/9/18
第57回大阪府公債	0.64	100,000	100,946	2015/1/28
第271回大阪府公債	1.6	70,200	71,955	2014/10/28
第277回大阪府公債	1.4	115,500	118,662	2015/4/27
第279回大阪府公債	1.3	20,000	20,541	2015/6/29
第281回大阪府公債	1.4	100,000	103,146	2015/8/28
第285回大阪府公債	1.5	50,000	51,915	2015/12/25
第300回大阪府公債	1.8	135,000	143,802	2017/3/29
第306回大阪府公債	1.83	30,000	32,199	2017/9/27
第313回大阪府公債	1.66	100,000	107,203	2018/4/27
第314回大阪府公債	1.8	30,000	32,406	2018/5/29
第316回大阪府公債	1.85	100,000	108,448	2018/7/30
第325回大阪府公債	1.66	53,000	57,164	2019/4/26
第326回大阪府公債	1.66	10,000	10,788	2019/5/28
第331回大阪府公債	1.41	100,000	106,355	2019/10/29
第332回大阪府公債	1.58	71,600	76,958	2019/11/27
第337回大阪府公債	1.44	100,000	106,497	2020/4/28
第348回大阪府公債	1.32	10,000	10,540	2021/3/30
平成21年度第5回京都府公債	1.35	20,000	21,254	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公債	1.26	110,000	115,990	2020/12/21
平成17年度第8回兵庫県公債	1.4	100,000	103,277	2015/9/28
平成17年度第9回兵庫県公債	1.6	100,000	104,054	2015/11/30
平成20年度第3回兵庫県公債	1.93	50,000	54,411	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公債	1.62	20,000	21,534	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公債	1.62	90,000	96,920	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公債	1.54	100,000	107,306	2019/11/20
平成18年度第2回静岡県公債	2.0	41,300	43,907	2016/6/27
平成19年度第1回静岡県公債	1.77	66,900	71,473	2017/5/30
平成20年度第1回静岡県公債	1.73	14,500	15,650	2018/5/28
平成20年度第4回静岡県公債	1.65	100,000	107,707	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公債	1.59	11,000	11,824	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公債	1.56	52,920	56,969	2019/8/20
平成22年度第5回静岡県公債	1.178	100,000	104,965	2020/7/22
平成23年度第2回静岡県公債	0.621	100,000	101,561	2016/4/4
平成23年度第5回静岡県公債	1.158	100,000	104,423	2021/6/28
平成18年度第4回愛知県公債	1.8	110,700	117,447	2016/10/17
平成23年度第7回愛知県公債	1.11	100,000	103,952	2021/7/29
平成23年度第17回愛知県公債	0.996	100,000	102,679	2022/1/31
平成23年度第1回広島県公債	1.19	100,000	104,633	2021/5/27
平成16年度第5回埼玉県公債	1.5	45,000	46,127	2014/11/26
平成18年度第3回埼玉県公債	2.1	87,600	93,556	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公債	1.9	62,100	66,222	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公債	1.85	112,600	120,269	2017/2/27
平成19年度第3回埼玉県公債	1.94	39,100	42,207	2017/8/8
平成19年度第6回埼玉県公債	1.63	100,000	107,060	2018/1/30
平成23年度第1回埼玉県公債	1.37	100,000	106,215	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公債	1.2	100,000	104,719	2021/7/27
平成17年度第5回福岡県公債	1.5	63,200	65,789	2016/1/27
平成19年度第1回福岡県公債(30年)	2.62	70,000	77,290	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公債(30年)	2.28	80,000	83,021	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公債	1.44	100,000	106,895	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公債	1.11	100,000	104,449	2020/8/24
第9回千葉県公債(20年)	1.84	80,000	81,834	2030/10/11
平成16年度第1回千葉県公債	1.6	80,500	82,164	2014/6/25
平成18年度第1回千葉県公債	2.0	109,490	116,220	2016/5/25
平成20年度第2回千葉県公債	1.8	90,000	97,460	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公債	1.78	80,000	86,673	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公債	1.6	80,000	86,000	2018/9/25
平成21年度第5回千葉県公債	0.82	50,700	51,248	2014/8/25
平成22年度第7回千葉県公債	0.92	100,000	102,932	2020/10/23

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
平成23年度第1回新潟県公債	1.02	100,000	102,874	2021/11/30
第1回群馬県公債	1.5	100,000	102,493	2014/11/25
第12回共同発行市場公募地方債	1.4	129,000	130,893	2014/3/25
第21回共同発行市場公募地方債	1.4	120,100	123,000	2014/12/25
第22回共同発行市場公募地方債	1.4	113,000	115,843	2015/1/23
第27回共同発行市場公募地方債	1.3	110,000	113,097	2015/6/25
第28回共同発行市場公募地方債	1.3	150,000	154,363	2015/7/24
第34回共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	103,778	2016/1/25
第35回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	104,508	2016/2/25
第38回共同発行市場公募地方債	2.0	12,000	12,737	2016/5/25
第45回共同発行市場公募地方債	1.7	37,500	39,730	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債	1.8	117,000	124,716	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	30,996	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	102,000	109,784	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	321	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	22,437	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	107,678	2018/2/23
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	108,810	2018/6/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	96,801	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	107,652	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	108,116	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,753	2019/8/23
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	116,148	2019/12/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,521	2021/2/25
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,413	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	103,040	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	102,730	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	70,000	72,093	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,483	2022/5/25
平成18年度第1回堺市公債	1.84	30,000	31,933	2016/12/26
平成19年度第1回堺市公債	1.73	100,000	107,307	2017/12/19
平成18年度第2回熊本県公債	1.8	84,540	89,695	2016/10/27
平成23年度第1回浜松市公債	1.045	38,200	39,392	2021/11/25
第5回大阪府市公債(20年)	2.47	100,000	112,865	2028/9/21
平成18年度第6回大阪府市公債	2.0	75,000	80,038	2016/10/26
平成19年度第4回大阪府市公債	1.9	30,000	32,193	2017/6/21
平成21年度第6回大阪府市公債	1.57	125,000	134,353	2019/11/25
平成23年度第10回大阪府市公債	0.956	10,000	10,194	2022/1/27
第5回京都市公債(20年)	2.36	50,000	56,673	2026/12/18
平成16年度第5回神戸市公債	1.4	100,000	102,382	2014/12/24
平成17年度第13回神戸市公債	1.6	111,000	115,923	2016/2/23
平成18年度第3回神戸市公債	2.54	120,000	138,871	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公債	2.09	80,000	84,240	2031/1/24
平成17年度第4回横浜市長市公債	1.52	17,800	18,516	2015/12/21
第17回横浜市長市公債(20年)	2.07	80,000	86,297	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市長市公債	1.71	100,000	108,205	2018/11/16
第20回横浜市長市公債(20年)	2.1	80,000	85,892	2029/10/19
平成21年度第5回札幌市公債	1.36	112,000	119,107	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公債(30年)	2.277	80,000	82,332	2040/9/20
第23回川崎市公債	0.72	152,300	153,757	2014/9/19
第77回川崎市公債	1.4	64,500	66,675	2015/9/28
第82回川崎市公債	1.52	100,000	107,384	2019/9/20
平成17年度第3回福岡市公債	1.6	60,000	62,476	2015/11/30
平成18年度第6回福岡市公債	1.8	70,000	74,417	2016/12/26
平成20年度第5回福岡市公債	1.57	91,000	97,618	2018/10/24
平成18年度第1回千葉市公債	1.8	50,000	53,034	2016/10/25
平成20年度第1回岡山県公債	1.56	48,700	52,276	2018/12/25
小計	—	13,270,950	14,025,688	—
特殊債券(除く金融債券)				
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	104,576	2016/2/26
第11回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	57,000	60,100	2016/4/26

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
%	千円	千円		
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	106,699	2016/8/31
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	106,054	2016/12/28
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	112,000	120,823	2017/8/31
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	90,000	96,353	2017/9/28
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	106,000	114,125	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	106,525	2018/1/31
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	56,000	59,484	2018/4/20
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	34,000	36,737	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	56,000	60,230	2018/8/29
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	115,000	123,863	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	159,000	168,649	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	123,000	130,493	2019/3/19
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	110,000	118,082	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	79,000	83,834	2019/9/30
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	107,953	2020/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	139,000	146,521	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	10,000	10,605	2020/1/31
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	53,028	2020/3/19
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	107,419	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,028	2020/6/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	115,197	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	74,637	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	105,004	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	94,797	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	60,000	62,424	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	125,828	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	103,023	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	100,990	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	140,033	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	114,200	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	170,000	173,209	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	102,492	2022/4/28
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	95,271	2042/5/30

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
%	千円	千円		
第326回政府保証道路債券	1.4	130,000	131,943	2014/3/26
第333回政府保証道路債券	1.6	100,000	102,599	2014/10/28
第334回政府保証道路債券	1.5	100,000	102,542	2014/11/28
第335回政府保証道路債券	1.4	113,000	115,779	2014/12/24
第339回政府保証道路債券	1.4	116,000	119,366	2015/4/28
第341回政府保証道路債券	1.3	100,000	102,778	2015/5/29
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	108,226	2020/7/15
第346回政府保証道路債券	1.4	111,000	114,690	2015/8/26
第2回政府保証首都高道路債券	1.8	24,000	25,459	2016/9/26
第3回政府保証首都高道路債券	1.7	9,000	9,574	2017/3/27
第4回政府保証首都高道路債券	1.7	79,000	84,566	2017/9/25
第190回政府保証首都高道路債券	1.4	81,000	82,172	2014/3/14
第193回政府保証首都高道路債券	1.5	55,000	56,262	2014/9/26
第195回政府保証首都高道路債券	1.4	100,000	102,557	2015/1/26
第200回政府保証首都高道路債券	1.3	8,000	8,252	2015/9/25
第1回政府保証阪神高速道路債券	1.6	5,000	5,233	2016/3/31
第137回政府保証阪神高速道路債券	1.4	50,000	50,732	2014/3/19
第23回政府保証都市再生債券	0.3	100,000	100,557	2015/12/10
第27回政府保証北四国連絡債券	1.4	100,000	103,330	2015/8/31
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	38,000	39,726	2016/2/22
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	75,000	79,521	2016/6/27
第6回政府保証東日本高速道路債券	1.8	62,000	65,903	2016/11/24
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	36,659	2017/8/24
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	89,000	94,679	2017/12/21
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	30,130	2018/10/19
第3回政府保証中日本高速道路債券	1.6	27,000	28,224	2016/2/24
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,611	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	49,219	2018/9/14
第8回政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	101,000	103,688	2014/8/27
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	1.4	100,000	103,312	2015/8/26
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	10,000	10,734	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	26,681	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	107,394	2019/8/16
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	113,322	2022/7/15
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	106,699	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	48,000	51,512	2019/5/24
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	106,017	2020/5/22
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	11,000	11,336	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	51,909	2021/12/14
第841回政府保証公営企業債券	1.8	101,000	103,534	2014/7/25
第843回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	102,314	2014/9/29
第849回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	102,979	2015/3/20
第851回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	102,753	2015/5/25
第852回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	102,866	2015/6/29
第860回政府保証公営企業債券	1.6	73,000	76,320	2016/2/19
第861回政府保証公営企業債券	1.6	129,000	134,997	2016/3/17
第864回政府保証公営企業債券	1.9	14,000	14,840	2016/6/22
第866回政府保証公営企業債券	2.0	63,000	67,178	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	52,000	55,143	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	109,161	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	106,155	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	121,082	2018/4/17
第885回政府保証公営企業債券	1.7	104,000	112,179	2018/5/22
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	112,187	2021/4/16
第190回政府保証中小企業債券	1.8	13,000	13,850	2017/1/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	111,000	118,775	2017/9/15
第12回政府保証国民生活債券	1.4	102,000	103,493	2014/3/19
第15回政府保証国民生活債券	1.5	98,000	100,900	2015/3/18
第17回政府保証国民生活債券	1.6	41,000	42,899	2016/3/17
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,127	2017/12/18
第185回政府保証預金保険機構債券	0.2	200,000	200,524	2016/5/17

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	137,000	141,259	2021/9/14
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	160,775	2018/1/24
第11回政府保証中部国際空港債券	0.7	100,000	102,205	2017/2/23
第5回政府保証西日本高速道路債券	1.8	41,000	43,684	2017/1/25
第6回政府保証西日本高速道路債券	1.8	51,000	54,403	2017/2/27
第9回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	106,559	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	33,249	2017/11/28
第15回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.298	100,000	100,160	2014/9/19
第16回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.52	100,000	102,159	2014/9/19
第19回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.4	200,000	205,136	2015/3/20
第24回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.65	100,000	103,805	2015/9/18
第27回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.98	100,000	106,381	2016/9/20
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	53,571	2018/3/20
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.64	100,000	104,119	2015/12/18
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	20,000	22,772	2026/3/19
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	100,000	113,165	2022/9/20
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	10,000	10,477	2046/12/20
第21回道路債券(財投機関債)	2.75	20,000	22,204	2033/6/20
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	100,000	100,268	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	60,000	67,309	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	214,220	2017/9/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	106,684	2018/3/20
第41回道路債券(財投機関債)	1.52	100,000	102,802	2015/3/20
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	107,297	2018/12/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	49,999	2032/3/19
第30回道路債券(財投機関債)	1.76	100,000	101,768	2014/3/20
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	54,863	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	85,089	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,289	2023/3/22
第5回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.51	100,000	101,090	2016/5/27
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	110,931	2023/12/20
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	57,002	2024/9/24
第10回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.28	200,000	200,552	2017/5/26
第12回公営企業債券(財投機関債)	1.53	150,000	153,378	2014/9/24
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	85,247	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,516	2020/9/28
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	80,623	2031/8/28
第18回公営企業債券(財投機関債)	1.53	100,000	103,922	2015/12/18
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,602	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,227	2021/1/28
F22回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.05	100,000	104,044	2018/5/10
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	75,431	2023/3/17
第28回公営企業債券(財投機関債)	1.89	100,000	107,759	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	100,000	102,166	2022/4/28

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第14回公営企業債券(財投機関債)	1.45	50,000	51,377	2015/3/24
第9回首都高速道路債券(財投機関債)	1.84	100,000	101,847	2014/3/20
第10回首都高速道路	0.336	100,000	100,141	2017/9/20
第13回首都高速道路債券(財投機関債)	1.48	200,000	205,390	2015/3/20
第5回阪神高速道路	0.381	50,000	50,185	2015/9/24
第6回阪神高速道路債券(財投機関債)	1.48	100,000	102,695	2015/3/20
第11回水資源債券(財投機関債)	1.63	100,000	102,288	2014/9/19
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	85,700	2030/3/19
第14回日本政策金融公庫(財投機関債)	0.371	100,000	100,448	2015/9/18
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	82,060	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	107,524	2018/9/20
第29回都市再生債券(財投機関債)	1.08	100,000	101,199	2014/6/20
第54回都市再生債券(財投機関債)	0.434	100,000	100,664	2016/9/20
第65回都市再生債券(財投機関債)	0.216	100,000	99,989	2015/9/18
第4回北四国道路債券(財投機関債)	1.5	50,000	51,209	2014/12/19
第10回福祉医療機構債券(財投機関債)	2.16	100,000	106,531	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	52,760	56,232	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	37,248	39,678	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	53,208	56,854	2042/6/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.27	38,562	41,414	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.8	100,000	106,361	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	53,042	56,963	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	32,414	34,150	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	33,663	36,216	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	52,103	55,527	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	44,399	46,853	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	34,143	36,719	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	54,929	58,115	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	70,000	74,687	2017/9/20
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	35,145	37,683	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	50,710	54,140	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	27,100	28,024	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	36,072	38,599	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	59,754	63,770	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	32,118	33,545	2039/1/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	60,967	64,247	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	61,194	64,098	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	36,851	38,669	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	39,377	41,903	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.92	100,000	108,812	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	49,514	51,641	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	52,730	55,002	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	55,311	57,655	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	79,534	83,579	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	82,994	87,289	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	84,208	88,271	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	53,272	56,058	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	52,385	54,990	2041/2/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	54,144	57,560	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	51,285	55,251	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	90,501	93,578	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	90,839	95,088	2046/1/10
第45回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.4	100,000	106,014	2020/3/19
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	91,040	96,199	2046/4/10

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	183,108	193,113	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	92,427	96,500	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	92,874	96,288	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	51,015	54,525	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	93,327	96,614	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	94,538	96,603	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	95,865	97,698	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	96,625	98,428	2047/4/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	98,018	97,807	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	98,379	97,323	2047/8/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	82,937	2031/6/13
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	128,780	2042/9/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	55,034	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	72,094	2031/6/13
第18回東日本高速道路	0.387	100,000	100,375	2017/9/20
第2回中日本高速道路	1.6	50,000	51,260	2014/12/19
第20回中日本高速道路	0.417	100,000	100,385	2015/9/18
第21回中日本高速道路	0.592	100,000	101,128	2017/9/20
第37回中日本高速道路	0.385	100,000	100,338	2016/2/26
第42回中日本高速道路	0.942	100,000	100,730	2022/3/18
第34回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	0.44	200,000	200,940	2014/12/19
第5回東京都住宅供給公社債券	2.02	100,000	107,118	2017/9/20
第9回オーストリア共和国政府保証オーストリア輸出銀行	1.35	100,000	101,418	2014/6/17
第1回オランダ開発金融公庫	1.33	100,000	101,233	2014/7/7
小計	—	17,944,692	18,726,008	—
金融債券				
い第709号商工債券	1.2	100,000	101,456	2014/6/27
い第721号商工債券	0.55	100,000	100,898	2015/6/26
い第723号商工債券	0.5	100,000	100,820	2015/8/27
い第724号商工債券	0.5	50,000	50,423	2015/9/25
い第729号商工債券	0.7	100,000	101,611	2016/2/26
い第735号商工債券	0.4	100,000	100,763	2016/8/26
い第736号商工債券	0.45	100,000	100,944	2016/9/27
い第712号農林債券	0.9	50,000	50,574	2014/9/26
い第713号農林債券	0.8	100,000	101,043	2014/10/27
い第715号農林債券	0.7	130,000	131,210	2014/12/26
い第716号農林債券	0.75	50,000	50,542	2015/1/27
い第720号農林債券	0.65	100,000	101,029	2015/5/27
い第721号農林債券	0.6	100,000	100,945	2015/6/26
い第725号農林債券	0.4	80,000	80,414	2015/10/27
い第728号農林債券	0.55	100,000	101,020	2016/1/27
い第731号農林債券	0.75	100,000	101,739	2016/4/27
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,658	2016/7/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	101,030	2017/2/27
い第744号農林債券	0.4	100,000	100,618	2017/5/26
第234回信金中金債	1.15	50,000	50,647	2014/5/27
第237回信金中金債	1.0	100,000	101,305	2014/8/27
第240回信金中金債	0.9	100,000	101,322	2014/11/27
第244回信金中金債	0.65	50,000	50,511	2015/3/27
第249回信金中金債	0.5	100,000	100,820	2015/8/27
第255回信金中金債	0.75	150,000	152,622	2016/2/26
第257回信金中金債	0.7	50,000	50,838	2016/4/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,367	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,266	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,521	2017/6/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	107,532	2018/12/20
第138号商工債券(3年)	0.35	100,000	100,273	2014/7/25
小計	—	2,710,000	2,744,763	—

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
普通社債券				
第428回東京電力	4.1	100,000	102,957	2015/5/29
第519回東京電力	1.59	120,000	115,384	2015/12/28
第524回東京電力	1.795	100,000	94,896	2017/3/13
第528回東京電力	1.905	20,000	18,187	2019/6/14
第532回東京電力	1.75	50,000	46,779	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	91,090	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	92,290	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	93,063	2018/6/25
第546回東京電力	1.505	100,000	98,306	2014/7/22
第567回東京電力	1.958	80,000	58,005	2030/7/29
第407回中部電力	3.4	50,000	53,598	2015/7/24
第467回中部電力	1.54	100,000	102,089	2014/12/25
第473回中部電力	1.55	100,000	103,051	2015/12/25
第478回中部電力	1.89	100,000	104,947	2016/9/23
第484回中部電力	1.41	100,000	101,604	2014/9/25
第489回中部電力	1.018	100,000	100,761	2014/5/23
第498回中部電力	0.566	100,000	99,958	2017/9/25
第448回関西電力	2.16	100,000	103,211	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	103,118	2017/7/25
第473回関西電力	1.665	100,000	99,587	2019/4/25
第485回関西電力	1.285	100,000	95,139	2020/12/18
第346回中国電力	1.81	100,000	105,305	2017/4/25
第277回北陸電力	1.47	60,000	61,127	2014/12/25
第288回北陸電力	1.89	100,000	106,068	2017/10/25
第383回東北電力	2.9	100,000	108,887	2017/12/25
第445回東北電力	1.792	100,000	103,392	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	102,189	2019/5/24
第408回九州電力	1.672	100,000	103,479	2019/6/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	87,587	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	26,316	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	50,670	2020/12/25
第314回北海道電力	0.581	100,000	99,937	2016/1/25
第9回沖縄電力	0.88	31,000	31,764	2018/3/20
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,518	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	107,438	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	110,675	2024/3/8
第24回関西国際空港	0.581	100,000	100,653	2015/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	50,954	2021/12/20
第1回成田国際空港	1.57	20,000	20,502	2014/12/19
第32回アサヒビール	0.633	100,000	100,906	2015/4/27
第4回サントリーホールディングス	0.74	100,000	101,903	2017/7/7
第1回コカ・コーラウエスト	0.683	100,000	100,857	2014/12/17
第8回旭化成	1.455	100,000	106,090	2019/12/11
第33回三菱化学	2.01	100,000	105,124	2016/2/19
第1回第一三共	1.078	100,000	101,191	2014/6/24
第2回第一三共	1.776	100,000	108,214	2019/6/24
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	99,702	2022/12/2
第67回新日本製鐵	1.293	100,000	101,374	2021/3/19
第16回ジェイ・エフ・イーホールディングス	0.858	100,000	101,003	2017/5/26
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	110,113	2019/3/20
第8回小松製作所	0.578	100,000	101,126	2016/6/9
第11回クボタ	1.53	100,000	102,669	2015/2/27
第1回日本電産	0.386	100,000	100,134	2017/9/20
第7回デンソー	0.548	100,000	101,087	2016/6/20
第1回日東電工	1.233	100,000	101,336	2014/6/3
第3回松下電工	1.66	100,000	100,887	2015/6/19
第1回日本生命2010基金	0.88	100,000	100,963	2015/8/5
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	102,126	2017/8/5
第1回明治安田生命2011基金	1.05	100,000	101,442	2016/8/5
第5回アイシン精機	1.35	100,000	102,275	2015/2/27
第7回リコー	1.393	100,000	101,258	2014/3/4
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,396	2020/12/16

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,138	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	107,220	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	109,921	2019/3/20
第30回住友商事	1.7	100,000	104,413	2016/3/1
第69回三菱商事	1.99	100,000	108,442	2018/5/22
第78回三菱商事	1.155	100,000	102,737	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行(同順位特約付)	2.08	100,000	107,937	2017/7/27
第20回みずほコーポレート銀行	0.71	100,000	101,036	2015/4/20
第23回みずほコーポレート銀行	0.43	100,000	100,492	2015/10/20
第25回みずほコーポレート銀行	0.755	100,000	101,632	2016/4/20
第27回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	201,868	2016/10/20
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	100,000	100,713	2017/4/21
第7回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.11	100,000	109,304	2019/12/20
第8回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.64	100,000	103,258	2015/7/22
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	200,000	230,278	2020/2/27
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	100,000	105,180	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	106,575	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	106,929	2017/4/20
第121回三菱東京UFJ銀行	0.555	100,000	101,135	2016/1/20
第1回三菱UFJ信託銀行(特定社債間限定同順位)	0.345	100,000	100,540	2017/6/7
第5回住友信託銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	105,654	2016/4/27
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	2.78	100,000	113,848	2026/4/27
第3回中央三井信託銀行(劣後特約付)	2.03	100,000	103,037	2015/1/28
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,533	2017/6/20
第9回三井住友銀行(劣後特約付)	1.75	100,000	103,571	2015/8/17
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	109,666	2019/7/24
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	105,521	2020/12/17
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	107,962	2026/6/1
第48回三井住友銀行	0.77	100,000	101,021	2014/10/20
第53回三井住友銀行	0.69	100,000	101,619	2016/4/20
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	101,015	2016/7/20
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,400	2017/10/20
第2回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	102,973	2015/8/7
第6回みずほ銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	106,443	2016/11/4
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	2.52	100,000	109,101	2027/4/27
第40回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.56	100,000	101,058	2016/6/20
第21回日産フィナンシャルサービス	0.306	100,000	99,929	2015/9/18
第17回ホンダフィナンクス	0.465	200,000	201,404	2016/12/20
第40回トヨタフィナンクス	1.478	100,000	101,751	2014/6/20
第152回オリックス	0.92	100,000	101,297	2016/8/31
第3回三井住友フィナンクス&リース	0.621	100,000	101,059	2016/8/3
第13回三菱UFJリース	0.796	100,000	101,473	2016/4/22
第15回野村ホールディングス	2.01	100,000	102,049	2014/6/13
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	99,854	2025/9/24
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	107,390	2018/6/20
第5回三井住友海上火災保険	0.67	100,000	100,952	2016/1/27
第31回三井不動産	1.645	100,000	102,277	2014/9/19
第98回三菱地所	1.165	100,000	103,994	2020/6/19
第7回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.9	100,000	105,895	2016/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	103,091	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	106,662	2017/11/29
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	107,763	2018/12/20
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	104,186	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	103,533	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	108,427	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	104,295	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	106,281	2017/3/17
第59回日本電信電話	1.69	100,000	107,939	2019/6/20
第19回KDDI	1.151	100,000	103,382	2020/6/19
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1.96	100,000	108,721	2018/6/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第21回電源開発	1.69	100,000	104,941	2017/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	103,283	2019/11/20
第30回東京ガス	1.658	100,000	103,394	2015/5/29
第9回大阪ガス	2.9	100,000	113,018	2018/1/30
第10回西部瓦斯	0.807	100,000	101,949	2017/1/26
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	106,276	2020/3/19
第9回GEキャピタルコーポレーション	1.77	100,000	101,595	2014/6/2
第7回JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	1.8	100,000	101,827	2014/5/30
第8回JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	101,632	2016/2/22
第5回パークレイズ・バンク	1.29	100,000	101,493	2015/9/9
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	1.01	100,000	101,642	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	103,029	2017/1/20
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	100,000	101,405	2016/6/10
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	101,570	2015/9/3
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	101,850	2016/8/12
第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行	1.22	100,000	101,633	2015/2/10
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.98	100,000	101,535	2016/1/21
第3回ラボバンク・ネダーランド	1.01	100,000	101,054	2015/2/18
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	104,571	2021/1/28
第17回ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,134	2015/11/2
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	101,694	2015/7/28
第2回エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー	1.01	100,000	101,558	2015/9/10
小計	—	14,215,000	14,639,518	—
合計	—	198,601,642	209,326,599	—

(C) 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	百万円	百万円
	10年国債標準物	1,154	—

投資信託財産の構成

2013年1月28日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	2,131,269	94.3
コール・ローン等、その他	128,861	5.7
投資信託財産総額	2,260,130	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況

2013年1月28日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,260,130,577円
コール・ローン等	105,028,880
日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,131,269,844
未 収 入 金	23,831,578
未 収 利 息	275
(B) 負 債	128,647,591
未 払 解 約 金	124,139,061
未 払 信 託 報 酬	4,479,473
そ の 他 未 払 費 用	29,057
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,131,482,986
元 本	2,006,928,368
次 期 繰 越 損 益 金	124,554,618
(D) 受 益 権 総 口 数	2,006,928,368口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,621円

損益の状況

(2012年1月27日～2013年1月28日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	25,220円
受 取 利 息	25,220
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,339,480
売 益	30,250,834
買 損	△ 19,911,354
(C) 信 託 報 酬 等	△ 7,680,626
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,684,074
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	53,008
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	121,817,536
(配 当 等 相 当 額)	(52,660,428)
(売 買 損 益 相 当 額)	(69,157,108)
(G) 計 (D+E+F)	124,554,618
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	124,554,618
追 加 信 託 差 損 益 金	121,817,536
(配 当 等 相 当 額)	(63,301,458)
(売 買 損 益 相 当 額)	(58,516,078)
分 配 準 備 積 立 金	21,404,703
繰 越 損 益 金	△ 18,667,621

(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。

〈注記事項〉

- ①期首元本額 1,278,370,317円
 期中追加設定元本額 8,589,098,108円
 期中一部解約元本額 7,860,540,057円

②分配金の計算過程

		第 4 期
費用控除後の配当等収益額	A	21,281,172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	B	－円
収益調整金額	C	103,149,915円
分配準備積立金額	D	123,531円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	124,554,618円
当ファンドの期末残存口数	F	2,006,928,368口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	620円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	－円

分配金のお知らせ

■ 収益分配金および分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

	第 4 期
当期分配金	－
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	620

◆「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数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。

※三菱ＵＦＪ投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載していますが、2013年6月21日以降は、以下の通り変更する予定です。
 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、「<http://www.am.mufg.jp/>」のアドレスに掲載します。
- ②投資信託約款に記載されていた「社団法人投資信託協会」を「一般社団法人投資信託協会」へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2013年1月4日)
- ③2013年1月1日から、2013年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税7%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、並びに地方税3%（法人受益者は7.147%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。
- なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

日本債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2012年5月14日

[計算期間：2011年5月13日～2012年5月14日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月14日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	NOMURA-BPI 総合インデックス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 総合インデックス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 総合インデックス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。

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 総合インデックス		債券組入率 比	債券先物率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2011年5月12日	円	%		%	%	%
	11,540	—	331.63	—	99.4	—
5月末	11,520	△0.2	331.05	△0.2	98.4	—
6月末	11,555	0.1	332.09	0.1	99.2	—
7月末	11,600	0.5	333.38	0.5	98.7	—
8月末	11,633	0.8	334.34	0.8	98.0	—
9月末	11,676	1.2	335.57	1.2	98.6	—
10月末	11,652	1.0	334.96	1.0	99.7	—
11月末	11,650	1.0	334.89	1.0	98.2	—
12月末	11,723	1.6	336.99	1.6	99.6	—
2012年1月末	11,746	1.8	337.61	1.8	99.7	—
2月末	11,759	1.9	338.00	1.9	99.5	—
3月末	11,765	1.9	338.18	2.0	99.7	—
4月末	11,827	2.5	339.94	2.5	98.9	—
(期 末) 2012年5月14日	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 騰落率は期首比。

(注) NOMURA-BPI 総合インデックスとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

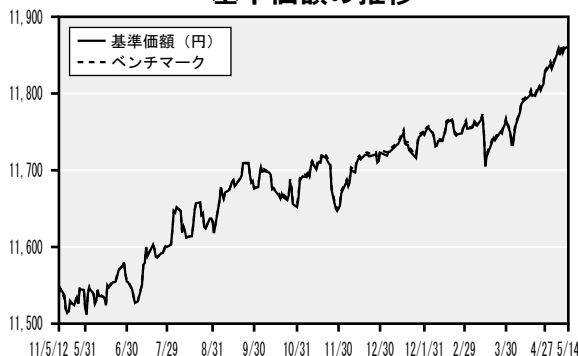
(注) 純資産総額は、期首207,058百万円、期末203,547百万円。

当期の運用経過

基準価額の推移

基準価額は期首に比べ2.8%の上昇となりました。

基準価額の推移



(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。

基準価額の変動要因

国内債券市況（NOMURA-BPI 総合インデックス）は期首に比べて2.8%上昇しました。資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資したことにより、債券市況とほぼ同様の推移となりました。

- ・ユーロ圏の財政懸念が長引くなか、世界的に金融緩和期待が根強く、債券市況は上昇（金利は低下）しました。

ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとの乖離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・当期より、運用効率化のため先物の組み入れを開始しました。
- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、NOMURA-BPI 総合インデックスとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。なお、期末現在の組入比率（先物を含む）は、99.5%です。
- ・ポートフォリオの種別構成比については、NOMURA-BPI 総合インデックスの債券種別に基づいて、期末時点で国債76.4%、地方債7.3%、政府保証債4.2%、金融債1.3%、事業債8.3%、円建外債0.7%、RMB（貸付債権担保住宅金融支援機構債）1.5%、ABS 0.2%としており、概ねベンチマーク並みとなっています（債券現物部分における割合です）。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

今後の運用方針

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合インデックスに連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

1 万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	0円 (0)
合 計	0

(a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

(2011年5月13日～2012年5月14日)

(1) 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	71,203,463	72,907,930
	地 方 債 証 券	6,329,361	6,674,677
	特 殊 債 券	7,523,387	8,909,295 (374,162)
	社 債 券	3,104,614	5,186,065

(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。

(2) 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 143	百万円 —	百万円 —	百万円 —

組入資産の明細

■ 公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債の種類別開示

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	145,586,000	154,636,502	76.0	—	42.2	21.8	12.0
地 方 債 証 券	12,561,440 (12,561,440)	13,249,821 (13,249,821)	6.5 (6.5)	— (—)	3.8 (3.8)	2.5 (2.5)	0.2 (0.2)
特 殊 債 証 券 (除く金融債券)	15,800,222 (15,800,222)	16,559,612 (16,559,612)	8.1 (8.1)	— (—)	5.2 (5.2)	2.5 (2.5)	0.4 (0.4)
金 融 債 証 券	2,620,000 (2,620,000)	2,659,262 (2,659,262)	1.3 (1.3)	— (—)	0.1 (0.1)	1.1 (1.1)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券	14,865,000 (14,865,000)	15,172,823 (15,172,823)	7.5 (7.5)	0.4 (0.4)	3.2 (3.2)	3.9 (3.9)	0.3 (0.3)
合 計	191,432,662 (45,846,662)	202,278,022 (47,641,519)	99.4 (23.4)	0.4 (0.4)	54.4 (12.2)	31.8 (10.1)	13.1 (1.1)

(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）公社債の詳細開示（個別銘柄別）

2012年5月14日現在

銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第72回利付国債(5年)	1.5	3,840,000	3,898,636	2013/6/20
第1回利付国債(40年)	2.4	235,000	262,008	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	350,000	370,345	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	343,000	361,669	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	460,000	481,689	2051/3/20
第253回利付国債(10年)	1.6	6,958,000	7,097,994	2013/9/20
第256回利付国債(10年)	1.4	6,520,000	6,655,159	2013/12/20
第259回利付国債(10年)	1.5	6,615,000	6,784,807	2014/3/20
第262回利付国債(10年)	1.9	2,820,000	2,925,834	2014/6/20
第263回利付国債(10年)	1.6	3,518,000	3,641,165	2014/9/20
第265回利付国債(10年)	1.5	2,988,000	3,095,538	2014/12/20
第268回利付国債(10年)	1.5	3,612,000	3,753,771	2015/3/20
第270回利付国債(10年)	1.3	3,699,000	3,833,606	2015/6/20
第273回利付国債(10年)	1.5	2,188,000	2,287,904	2015/9/20
第276回利付国債(10年)	1.6	3,560,000	3,745,333	2015/12/20
第279回利付国債(10年)	2.0	3,170,000	3,392,819	2016/3/20
第281回利付国債(10年)	2.0	3,458,000	3,714,618	2016/6/20
第283回利付国債(10年)	1.8	4,047,000	4,327,011	2016/9/20
第284回利付国債(10年)	1.7	4,466,000	4,767,901	2016/12/20
第285回利付国債(10年)	1.7	3,348,000	3,583,732	2017/3/20
第287回利付国債(10年)	1.9	1,915,000	2,073,983	2017/6/20
第288回利付国債(10年)	1.7	1,571,000	1,688,982	2017/9/20
第289回利付国債(10年)	1.5	1,313,000	1,399,342	2017/12/20
第292回利付国債(10年)	1.7	1,829,000	1,973,216	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	1,496,000	1,624,970	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	1,120,000	1,197,000	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	1,696,000	1,802,695	2018/12/20
第300回利付国債(10年)	1.5	1,352,000	1,446,721	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,427,000	1,527,403	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	2,040,000	2,169,356	2019/9/20

銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第305回利付国債(10年)	1.3	1,668,000	1,760,507	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,518,000	1,611,979	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	1,894,000	1,994,041	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	2,556,000	2,625,778	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	1,300,000	1,354,353	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,724,000	1,807,872	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	2,093,000	2,174,103	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	1,825,000	1,875,881	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	2,334,000	2,394,263	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,440,000	1,460,275	2022/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	76,000	90,598	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	98,000	110,527	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	117,000	130,087	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	127,000	153,431	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	108,000	118,133	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	169,000	190,236	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	164,000	181,813	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	142,000	145,041	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	116,000	110,354	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	185,000	165,872	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	137,000	137,105	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	170,000	182,076	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	205,000	215,908	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	263,000	296,095	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	246,000	281,682	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	207,000	236,694	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	207,000	232,937	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	297,000	328,482	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	203,000	224,501	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	197,000	225,411	2035/9/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第21回利付国債(30年)	2.3	229,000	252,990	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	220,000	251,783	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	169,000	193,432	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	196,000	224,353	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	237,000	261,889	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	464,000	522,097	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	376,000	431,193	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	501,000	574,511	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	480,000	541,142	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	661,000	730,728	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	638,000	691,100	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	689,000	761,365	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	721,000	748,765	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	789,000	853,776	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	869,000	900,640	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	358,000	370,461	2042/3/20
第30回利付国債(20年)	3.7	876,000	980,489	2015/9/21
第32回利付国債(20年)	3.7	77,000	87,454	2016/3/21
第33回利付国債(20年)	3.8	36,000	41,604	2016/9/20
第35回利付国債(20年)	3.3	117,000	134,303	2017/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	201,000	229,927	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	400,000	454,480	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	601,000	672,519	2018/9/20
第42回利付国債(20年)	2.6	869,000	994,031	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	74,000	86,679	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	480,000	550,377	2020/3/20
第47回利付国債(20年)	2.2	114,000	128,248	2020/9/21
第48回利付国債(20年)	2.5	209,000	240,588	2020/12/21
第49回利付国債(20年)	2.1	515,000	576,037	2021/3/22
第51回利付国債(20年)	2.0	200,000	221,764	2021/6/21
第52回利付国債(20年)	2.1	214,000	239,243	2021/9/21
第54回利付国債(20年)	2.2	480,000	541,339	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	241,000	267,273	2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	484,000	536,499	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	162,000	178,008	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	589,000	634,888	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	289,000	290,277	2023/3/20
第63回利付国債(20年)	1.8	442,000	480,193	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	441,000	483,172	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	333,000	364,521	2023/12/20
第68回利付国債(20年)	2.2	686,000	773,170	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	522,000	599,882	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	454,000	505,828	2024/9/20
第74回利付国債(20年)	2.1	548,000	609,978	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	705,000	783,896	2025/3/20
第80回利付国債(20年)	2.1	580,000	643,811	2025/6/20
第82回利付国債(20年)	2.1	655,000	725,740	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	836,000	925,034	2025/12/20
第86回利付国債(20年)	2.3	725,000	819,184	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	547,000	617,305	2026/6/20
第91回利付国債(20年)	2.3	886,000	999,177	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	742,000	816,326	2026/12/20
第94回利付国債(20年)	2.1	823,000	904,353	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	652,000	733,350	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	798,000	885,357	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	785,000	859,190	2027/12/20
第101回利付国債(20年)	2.4	743,000	843,171	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	957,000	1,084,845	2028/6/20
第106回利付国債(20年)	2.2	791,000	873,438	2028/9/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第107回利付国債(20年)	2.1	802,000	872,904	2028/12/20
第110回利付国債(20年)	2.1	846,000	919,813	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	971,000	1,068,566	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	822,000	891,113	2029/9/20
第115回利付国債(20年)	2.2	939,000	1,030,505	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,044,000	1,145,247	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	996,000	1,060,082	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,044,000	1,093,068	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	915,000	986,223	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	794,000	868,000	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	619,000	646,161	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	970,000	995,714	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	1,033,000	1,041,418	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	575,000	589,214	2032/3/20
小計	—	145,586,000	154,636,502	—
地方債証券				
第1回東京都公募公債(20年)	1.54	20,000	20,995	2023/6/20
第8回東京都公募公債(30年)	2.23	80,000	84,259	2038/9/17
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	80,000	85,560	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	80,000	86,601	2029/12/20
第22回東京都公募公債(20年)	1.92	120,000	124,604	2030/6/20
第24回東京都公募公債(20年)	1.98	70,000	73,035	2031/6/20
第26回東京都公募公債(5年)	0.36	110,000	110,628	2015/6/19
第604回東京都公募公債	1.5	100,000	102,161	2013/12/25
第615回東京都公募公債	1.53	100,000	103,220	2014/9/19
第618回東京都公募公債	1.45	115,000	118,824	2014/12/19
第619回東京都公募公債	1.53	100,000	103,871	2015/3/20
第624回東京都公募公債	1.5	100,000	104,101	2015/6/19
第630回東京都公募公債	1.63	100,000	105,144	2015/12/18
第632回東京都公募公債	2.0	117,000	125,008	2016/3/18
第636回東京都公募公債	2.04	20,000	21,475	2016/6/20
第651回東京都公募公債	1.62	115,000	122,836	2017/9/20
第666回東京都公募公債	1.46	100,000	106,357	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	53,782	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	105,748	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,722	2020/3/19
第684回東京都公募公債	1.26	100,000	104,572	2020/6/19
第685回東京都公募公債	1.13	100,000	103,573	2020/6/19
第691回東京都公募公債	1.24	100,000	104,125	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	105,139	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	20,000	20,268	2021/9/17
平成16年度第3回北海道公募公債	1.6	100,000	102,858	2014/6/30
平成17年度第1回北海道公募公債	1.4	110,000	113,678	2015/4/28
平成18年度第6回北海道公募公債	2.1	100,000	107,502	2016/8/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	21,598	2017/7/29
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	40,000	42,922	2018/8/29
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	101,147	2020/10/29
第1回神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	115,424	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	89,393	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	94,297	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	109,933	2025/6/20
第127回神奈川県公募公債	1.8	29,000	30,044	2014/7/30
第139回神奈川県公募公債	1.94	115,700	123,308	2016/3/18
第152回神奈川県公募公債	1.53	10,000	10,651	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	150,875	2019/6/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	100,000	105,570	2020/3/20
第46回大阪府公募公債	1.21	100,000	101,737	2014/2/26
第57回大阪府公募公債	0.64	100,000	101,063	2015/1/28
第270回大阪府公募公債	1.5	100,000	102,991	2014/9/29

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第277回大阪府公募公債	1.6	70,200	72,532	2014/10/28
第277回大阪府公募公債	1.4	115,500	119,394	2015/4/27
第281回大阪府公募公債	1.4	100,000	103,719	2015/8/28
第285回大阪府公募公債	1.5	50,000	52,202	2015/12/25
第300回大阪府公募公債	1.8	120,000	128,276	2017/3/29
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	32,247	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	106,890	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	32,324	2018/5/29
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,719	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	105,407	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	76,330	2019/11/27
第337回大阪府公募公債	1.44	100,000	105,418	2020/4/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,392	2021/3/30
平成21年度第5回京都市公募公債	1.35	20,000	21,084	2019/12/24
平成22年度第5回京都市公募公債	1.26	110,000	114,626	2020/12/21
平成23年度第1回京都市公募公債	0.49	130,680	132,007	2016/6/22
平成17年度第8回兵庫県公募公債	1.4	100,000	103,849	2015/9/28
平成17年度第9回兵庫県公募公債	1.6	100,000	104,710	2015/11/30
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	54,313	2018/6/20
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	70,000	74,886	2019/5/22
平成18年度第2回静岡県公募公債	2.0	41,300	44,274	2016/6/27
平成19年度第1回静岡県公募公債	1.77	66,900	71,768	2017/5/30
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,627	2018/5/28
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	107,401	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,776	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	56,635	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	103,782	2020/7/22
平成23年度第2回静岡県公募公債	0.621	100,000	101,545	2016/4/21
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	102,956	2021/6/28
平成18年度第4回愛知県公募公債	1.8	110,700	118,161	2016/10/17
平成22年度第1回愛知県公募公債	1.417	100,000	105,806	2020/4/30
平成22年度第16回愛知県公募公債	1.245	100,000	104,004	2021/1/28
平成22年度第19回愛知県公募公債	1.398	110,000	115,691	2021/3/30
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	102,439	2021/7/29
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	103,199	2021/5/27
平成16年度第2回埼玉県公募公債	1.6	43,150	44,407	2014/5/28
平成16年度第5回埼玉県公募公債	1.5	45,000	46,511	2014/11/26
平成18年度第3回埼玉県公募公債	2.1	53,600	57,738	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公募公債	1.9	62,100	66,644	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公募公債	1.85	112,600	120,930	2017/2/27
平成19年度第3回埼玉県公募公債	1.94	39,100	42,373	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	100,000	107,021	2018/1/30
平成22年度第3回埼玉県公募公債	1.31	100,000	104,883	2020/6/24
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	104,893	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	103,251	2021/7/27
平成17年度第5回福岡県公募公債	1.5	50,000	52,372	2016/1/27
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	79,156	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	84,957	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	106,051	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	103,168	2020/8/24
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	80,000	81,799	2030/10/11
平成16年度第1回千葉県公募公債	1.6	80,500	82,934	2014/6/25
平成18年度第1回千葉県公募公債	2.0	109,490	117,227	2016/5/25
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	97,361	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	86,516	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	85,689	2018/9/25
平成21年度第5回千葉県公募公債	0.82	50,700	51,448	2014/8/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	100,000	101,511	2020/10/23
第1回群馬県公募公債	1.5	100,000	103,330	2014/11/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第6回共同発行市場公募地方債	1.6	85,000	86,657	2013/9/25
第10回共同発行市場公募地方債	1.3	50,000	50,957	2014/1/24
第12回共同発行市場公募地方債	1.4	129,000	131,959	2014/3/25
第21回共同発行市場公募地方債	1.4	120,100	123,931	2014/12/25
第22回共同発行市場公募地方債	1.4	113,000	116,714	2015/1/23
第25回共同発行市場公募地方債	1.4	140,000	145,003	2015/4/24
第27回共同発行市場公募地方債	1.3	110,000	113,817	2015/6/25
第28回共同発行市場公募地方債	1.3	150,000	155,311	2015/7/24
第34回共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	104,370	2016/1/25
第35回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	105,201	2016/2/25
第38回共同発行市場公募地方債	2.0	12,000	12,848	2016/5/25
第45回共同発行市場公募地方債	1.7	18,500	19,699	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債	1.8	107,000	114,622	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	31,110	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	90,000	97,269	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	322	2017/8/25
第54回共同発行市場公募地方債	1.7	112,100	120,135	2017/9/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	22,424	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	107,552	2018/2/23
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	108,736	2018/6/25
第66回共同発行市場公募地方債	1.55	150,000	160,153	2018/9/25
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	107,082	2019/5/24
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,688	2019/8/23
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	115,199	2019/12/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	104,239	2021/2/25
平成18年度第1回京都市公募公債	1.84	30,000	32,097	2016/12/26
平成19年度第1回京都市公募公債	1.73	100,000	107,314	2017/12/19
平成18年度第2回熊本県公募公債	1.8	84,540	90,173	2016/10/27
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	111,824	2028/9/21
平成18年度第6回大阪市公募公債	2.0	75,000	80,460	2016/10/26
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	32,266	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	100,000	106,493	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,009	2022/1/27
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	55,953	2026/12/18
平成16年度第5回神戸市公募公債	1.4	100,000	103,120	2014/12/24
平成17年度第13回神戸市公募公債	1.6	100,000	105,095	2016/2/23
平成18年度第3回神戸市公募公債	2.54	120,000	137,157	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債	2.09	80,000	84,486	2031/1/24
平成17年度第4回横浜市公募公債	1.52	17,800	18,641	2015/12/21
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	85,609	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	107,829	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	85,494	2029/10/19
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	100,000	105,538	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	84,461	2040/9/20
第23回川崎市公募公債	0.72	138,810	140,563	2014/9/19
第77回川崎市公募公債	1.4	64,500	67,094	2015/9/28
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	106,667	2019/9/20
平成17年度第3回福岡市公募公債	1.6	60,000	62,914	2015/11/30
平成18年度第6回福岡市公募公債	1.8	70,000	74,800	2016/12/26
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	97,198	2018/10/24
平成18年度第1回千葉県公募公債	1.8	50,000	53,328	2016/10/25
平成20年度第1回岡山県公募公債	1.56	48,700	52,039	2018/12/25
小計	—	12,561,440	13,249,821	—
特殊債券(除く金融債券)				
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	105,284	2016/2/26
第11回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	57,000	60,562	2016/4/26
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	111,000	118,613	2016/6/22

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券（除く金融債券）	%	千円	千円	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	107,534	2016/8/31
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	106,580	2016/12/28
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	112,000	121,282	2017/8/31
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	12,000	12,875	2017/9/28
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	79,000	85,234	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	106,385	2018/1/31
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	56,000	59,314	2018/4/20
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	34,000	36,656	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	56,000	60,029	2018/8/29
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	107,272	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	144,000	151,715	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	105,365	2019/3/19
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	106,731	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	44,000	46,340	2019/9/30
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	107,381	2020/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	129,000	134,739	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	10,000	10,516	2020/1/31
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	52,544	2020/3/19
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	107,129	2020/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,978	2020/6/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	101,408	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	73,766	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	105,231	2021/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	150,000	154,120	2021/5/31
第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,484	2021/6/30
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	50,000	51,286	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	101,599	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	101,446	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	101,760	2021/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	137,861	2021/11/30
第325回政府保証道路債券	1.3	115,000	117,352	2014/2/24
第326回政府保証道路債券	1.4	130,000	133,036	2014/3/26
第333回政府保証道路債券	1.6	100,000	103,550	2014/10/28

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第334回政府保証道路債券	1.5	100,000	103,406	2014/11/28
第335回政府保証道路債券	1.4	100,000	103,254	2014/12/24
第339回政府保証道路債券	1.4	116,000	120,232	2015/4/28
第341回政府保証道路債券	1.3	100,000	103,451	2015/5/29
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	107,328	2020/7/15
第346回政府保証道路債券	1.4	100,000	104,035	2015/8/26
第2回政府保証首都高速道路債券	1.8	24,000	25,613	2016/9/26
第3回政府保証首都高速道路債券	1.7	9,000	9,613	2017/3/27
第4回政府保証首都高速道路債券	1.7	79,000	84,729	2017/9/25
第190回政府保証首都高速道路債券	1.4	81,000	82,850	2014/3/14
第193回政府保証首都高速道路債券	1.5	55,000	56,746	2014/9/26
第195回政府保証首都高速道路債券	1.4	100,000	103,338	2015/1/26
第200回政府保証首都高速道路債券	1.3	8,000	8,299	2015/9/25
第1回政府保証阪神高速道路債券	1.6	5,000	5,268	2016/3/31
第137回政府保証阪神高速道路債券	1.4	50,000	51,151	2014/3/19
第23回政府保証都市再生債券	0.3	100,000	100,444	2015/12/10
第27回政府保証北四国道路橋債券	1.4	100,000	104,017	2015/8/31
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	38,000	40,002	2016/2/22
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	75,000	80,128	2016/6/27
第6回政府保証東日本高速道路債券	1.8	37,000	39,560	2016/11/24
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	36,798	2017/8/24
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	89,000	94,626	2017/12/21
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	30,021	2018/10/19
第3回政府保証中日本高速道路債券	1.6	27,000	28,419	2016/2/24
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,585	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	49,018	2018/9/14
第8回政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	101,000	104,798	2014/8/27
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	1.4	100,000	104,001	2015/8/26
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	26,509	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	106,741	2019/8/16
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	112,269	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	101,000	105,548	2019/12/13
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	106,020	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	48,000	51,223	2019/5/24
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,117	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,035	2020/5/22
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	103,881	2020/12/14
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	51,000	52,929	2021/2/15
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	51,130	2021/12/14
第841回政府保証公営企業債券	1.8	101,000	104,649	2014/7/25
第843回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	103,199	2014/9/29
第849回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	103,815	2015/3/20
第851回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	103,438	2015/5/25
第852回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	103,531	2015/6/29
第856回政府保証公営企業債券	1.5	101,000	105,570	2015/10/20
第860回政府保証公営企業債券	1.6	73,000	76,852	2016/2/19
第864回政府保証公営企業債券	1.9	14,000	14,957	2016/6/22
第866回政府保証公営企業債券	2.0	63,000	67,707	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	52,000	55,420	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	109,432	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	105,892	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	105,910	2018/4/17
第885回政府保証公営企業債券	1.7	104,000	112,015	2018/5/22
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	111,384	2021/4/16
第190回政府保証中小企業債券	1.8	13,000	13,922	2017/1/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	9,000	9,652	2017/9/15
第12回政府保証国民生活債券	1.4	102,000	104,348	2014/3/19
第15回政府保証国民生活債券	1.5	98,000	101,717	2015/3/18
第17回政府保証国民生活債券	1.6	41,000	43,187	2016/3/17

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債券)	%	千円	千円	
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,126	2017/12/18
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	121,000	122,942	2021/9/14
第46回政府保証関西国際空港債券	1.6	100,000	103,021	2014/6/16
第52回政府保証関西国際空港債券	1.4	100,000	103,051	2014/10/29
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	47,000	49,991	2018/1/24
第5回政府保証西日本高速道路債券	1.8	41,000	43,911	2017/1/25
第6回政府保証西日本高速道路債券	1.8	51,000	54,678	2017/2/27
第8回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	106,967	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	33,284	2017/11/28
第2回日本政策投資銀行債券(財政機関債)	1.367	100,000	101,792	2013/12/20
第16回日本政策投資銀行債券(財政機関債)	1.52	100,000	102,967	2014/9/19
第27回日本政策投資銀行債券(財政機関債)	1.98	100,000	107,058	2016/9/20
第46回日本政策投資銀行債券(財政機関債)	1.69	50,000	53,486	2018/3/20
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.99	100,000	110,844	2045/9/20
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	1.64	100,000	104,843	2015/12/18
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.45	20,000	22,396	2026/3/19
第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.12	100,000	107,308	2016/6/20
第13回道路債券(財政機関債)	2.28	100,000	111,694	2022/9/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.87	10,000	10,778	2046/12/20
第21回道路債券(財政機関債)	2.75	20,000	22,443	2033/6/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.67	100,000	103,187	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	2.39	60,000	66,235	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	1.82	100,000	107,358	2017/9/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	1.61	100,000	106,518	2018/3/20
第41回道路債券(財政機関債)	1.52	100,000	103,578	2015/3/20
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	1.63	100,000	106,813	2018/12/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財政機関債)	1.9	50,000	50,323	2032/3/19
第30回道路債券(財政機関債)	1.76	100,000	102,790	2014/3/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財政機関債)	2.266	50,000	54,478	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.406	80,000	84,508	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財政機関債)	1.03	20,000	19,875	2023/3/22
第5回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.395	100,000	105,524	2019/10/28
第6回公営企業債券(20年)(財政機関債)	2.03	100,000	109,288	2023/12/20
第6回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.518	100,000	106,393	2019/11/28
第8回公営企業債券(20年)(財政機関債)	2.33	50,000	56,174	2024/9/24
第12回公営企業債券(財政機関債)	1.53	50,000	51,558	2014/9/24
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財政機関債)	2.187	80,000	85,524	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.164	100,000	103,221	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財政機関債)	1.846	80,000	81,224	2031/8/28
第18回公営企業債券(財政機関債)	1.53	100,000	104,600	2015/12/18
第19回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.274	50,000	51,975	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.28	100,000	103,950	2021/1/28
F22回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.05	100,000	103,498	2018/5/10
F24回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.681	70,000	74,233	2023/3/17
第28回公営企業債券(財政機関債)	1.89	100,000	108,032	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財政機関債)	1.006	100,000	100,876	2022/4/28

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第14回公営企業債券(財政機関債)	1.45	50,000	51,755	2015/3/24
第9回首都高速道路債券(財政機関債)	1.84	100,000	102,937	2014/3/20
第5回阪神高速道路	0.381	50,000	50,143	2015/9/24
第6回阪神高速道路債券(財政機関債)	1.48	100,000	103,465	2015/3/20
第1回水資源債券(財政機関債)	1.63	100,000	103,176	2014/9/19
第10回日本政策金融公庫(財政機関債)	2.167	80,000	85,294	2030/3/19
第14回日本政策金融公庫(財政機関債)	0.371	100,000	100,351	2015/9/18
第15回日本政策金融公庫(財政機関債)	1.911	80,000	81,796	2030/10/29
第29回都市再生債券(財政機関債)	1.08	100,000	101,639	2014/6/20
第4回本州四国連絡橋債券(財政機関債)	1.5	50,000	51,614	2014/12/19
第10回福祉医療機構債券(財政機関債)	2.16	100,000	107,427	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	59,939	63,493	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	43,654	46,225	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	60,755	64,541	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	45,234	48,143	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財政機関債)	1.8	100,000	106,826	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	60,742	64,887	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	36,274	37,820	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	38,017	40,583	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	60,328	63,870	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	52,068	54,470	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	38,680	41,278	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	63,426	66,665	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財政機関債)	1.73	70,000	74,820	2017/9/20
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	39,372	41,876	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	57,732	61,220	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	32,890	33,740	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	40,676	43,178	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	67,556	71,729	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	37,871	39,288	2039/1/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	68,200	71,510	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	68,518	71,400	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	42,201	43,945	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	44,024	46,554	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財政機関債)	1.92	100,000	108,570	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	55,477	57,338	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	58,751	60,752	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	60,893	62,976	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	85,355	89,224	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	87,618	91,572	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	88,595	92,267	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	59,537	62,165	2040/12/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	88,970	92,072	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	90,094	92,499	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	58,542	60,978	2041/2/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	60,206	63,607	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	57,603	61,731	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	93,549	96,101	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	93,925	97,806	2046/1/10
第45回一般担保住宅金融支援機構債券(財政機関債)	1.4	100,000	105,089	2020/3/19
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	94,502	99,323	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	95,007	99,676	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	95,819	99,500	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	96,274	99,286	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	58,384	62,033	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	96,683	99,545	2046/8/10

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券（除く金融債券）	%	千円	千円	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	97,518	99,116	2046/10/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	99,763	101,150	2047/4/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.066	80,000	83,258	2031/6/13
第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	2.04	50,000	54,113	2025/6/20
第7回国際協力機構債券（財投機関債）	1.991	70,000	72,464	2031/6/13
第2回中日本高速道路	1.6	50,000	51,716	2014/12/19
第37回中日本高速道路	0.385	100,000	100,262	2016/2/26
第10回西日本高速道路	0.423	100,000	100,244	2013/12/20
第9回オーストリア共和国政府保証オーストリア輸出銀行	1.35	100,000	100,915	2014/6/17
第1回オランダ開発金融公庫	1.33	100,000	101,549	2014/7/7
小計	—	15,800,222	16,559,612	—
金融債券				
い第705号商工債券	1.4	100,000	102,097	2014/2/27
い第709号商工債券	1.2	100,000	102,057	2014/6/27
い第723号商工債券	0.5	100,000	100,815	2015/8/27
い第724号商工債券	0.5	50,000	50,408	2015/9/25
い第729号商工債券	0.7	100,000	101,593	2016/2/26
い第732号商工債券	0.6	100,000	101,216	2016/5/27
い第736号商工債券	0.45	100,000	100,538	2016/9/27
い第702号農林債券	1.55	50,000	50,993	2013/11/27
い第712号農林債券	0.9	50,000	50,753	2014/9/26
い第713号農林債券	0.8	100,000	101,317	2014/10/27
い第714号農林債券	0.9	100,000	101,614	2014/11/27
い第715号農林債券	0.7	130,000	131,470	2014/12/26
い第716号農林債券	0.75	50,000	50,651	2015/1/27
い第720号農林債券	0.65	100,000	101,145	2015/5/27
い第721号農林債券	0.6	100,000	101,006	2015/6/26
い第725号農林債券	0.4	80,000	80,300	2015/10/27
い第728号農林債券	0.55	100,000	100,916	2016/1/27
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,538	2016/7/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	100,588	2017/2/27
第231回信金中金債	1.35	60,000	61,194	2014/2/27
第234回信金中金債	1.15	50,000	50,926	2014/5/27
第237回信金中金債	1.0	200,000	203,480	2014/8/27
第240回信金中金債	0.9	100,000	101,665	2014/11/27
第244回信金中金債	0.65	50,000	50,569	2015/3/27
第249回信金中金債	0.5	100,000	100,782	2015/8/27
第255回信金中金債	0.75	150,000	152,614	2016/2/26
第257回信金中金債	0.7	50,000	50,781	2016/4/27
第8号商工債券（10年）	1.66	100,000	106,970	2018/12/20
第138号商工債券（3年）	0.35	100,000	100,262	2014/7/25
小計	—	2,620,000	2,659,262	—
普通社債券				
第428回東京電力	4.1	100,000	96,065	2015/5/29
第519回東京電力	1.59	120,000	104,600	2015/12/28
第524回東京電力	1.795	100,000	83,929	2017/3/14
第532回東京電力	1.75	50,000	40,987	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	77,393	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	80,472	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	80,660	2018/6/25
第546回東京電力	1.505	100,000	91,843	2014/7/22
第549回東京電力	1.699	140,000	109,471	2018/10/17
第560回東京電力	2.114	80,000	54,196	2029/12/10
第567回東京電力	1.958	80,000	53,357	2030/7/29
第407回中部電力	3.4	50,000	54,414	2015/7/24
第467回中部電力	1.54	100,000	102,659	2014/12/25
第473回中部電力	1.55	100,000	103,289	2015/12/25
第478回中部電力	1.89	100,000	105,125	2016/9/23

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第481回中部電力	1.51	100,000	102,024	2014/5/23
第484回中部電力	1.41	100,000	102,116	2014/9/25
第489回中部電力	1.018	100,000	101,028	2014/5/23
第448回関西電力	2.16	100,000	107,070	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	105,932	2017/7/25
第485回関西電力	1.285	100,000	100,505	2020/12/18
第350回中国電力	1.57	100,000	102,524	2014/10/24
第277回北陸電力	1.47	60,000	61,455	2014/12/25
第383回東北電力	2.9	100,000	110,840	2017/12/25
第431回東北電力	2.05	120,000	127,569	2018/3/23
第445回東北電力	1.792	100,000	104,817	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	103,550	2019/5/24
第379回九州電力	1.88	100,000	102,943	2014/7/25
第408回九州電力	1.672	100,000	104,637	2019/6/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	89,148	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	26,531	2017/11/24
第293回北海道電力	1.86	100,000	105,672	2017/9/25
第302回北海道電力	2.154	100,000	101,110	2029/1/25
第310回北海道電力	1.286	50,000	50,434	2020/12/25
第9回沖縄電力	0.88	31,000	31,409	2018/3/20
第19回沖縄電力	1.452	80,000	83,274	2020/4/24
第347回東京交通債券	2.05	100,000	108,965	2024/3/8
第24回関西国際空港	0.581	100,000	100,647	2015/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	50,182	2021/12/20
第1回成田国際空港	1.57	20,000	20,660	2014/12/19
第32回アサヒビール	0.633	100,000	101,022	2015/4/27
第4回サントリーホールディングス	0.74	100,000	101,554	2017/7/7
第1回コカ・コーラウエスト	0.683	100,000	101,067	2014/12/17
第8回旭化成	1.455	100,000	105,319	2019/12/11
第33回三菱化学	2.01	100,000	106,085	2016/2/19
第39回三井化学	1.93	100,000	106,638	2017/5/2
第1回大日本住友製薬	0.534	100,000	100,444	2014/3/7
第1回第一三共	1.078	100,000	101,722	2014/6/24
第2回第一三共	1.776	100,000	107,719	2019/6/24
第4回フジ・メディア・ホールディングス	1.066	100,000	102,954	2016/12/20
第2回コニカミノルタホールディングス	0.956	100,000	101,986	2017/12/1
第29回新日本石油	1.69	100,000	102,788	2014/6/11
第11回旭硝子	1.278	100,000	101,744	2014/1/29
第6回日本電気硝子	0.996	100,000	102,551	2016/12/9
第67回新日本製鐵	1.293	100,000	103,173	2021/3/19
第16回ジェイ・エフ・イー・ホールディングス	0.858	100,000	102,101	2017/5/26
第11回YKK	0.841	100,000	101,795	2018/6/15
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	109,819	2019/3/20
第8回小松製作所	0.578	100,000	100,996	2016/6/9
第11回クボタ	1.53	100,000	103,437	2015/2/27
第14回ダイキン工業	1.003	100,000	101,392	2014/7/30
第14回日立製作所	1.56	100,000	103,988	2015/8/18
第43回三菱電機	0.581	100,000	100,515	2013/12/9
第43回日本電気	0.649	100,000	99,495	2015/12/2
第26回富士通	0.307	100,000	100,053	2013/10/18
第10回パナソニック	0.752	100,000	101,015	2016/3/18
第25回ソニー	1.298	100,000	101,966	2014/6/20
第7回デンソー	0.548	100,000	100,963	2016/6/20
第1回日東電工	1.233	100,000	101,972	2014/6/3
第3回松下電工	1.66	100,000	103,797	2015/6/19
第1回日本生命2010基金	0.88	100,000	100,208	2015/8/5
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	100,714	2017/8/5
第1回明治安田生命2011基金	1.05	100,000	100,335	2016/8/5
第5回アイシン精機	1.35	100,000	102,939	2015/2/27

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第7回リコー	1.393	100,000	102,022	2014/3/4
第5回凸版印刷	1.397	100,000	104,212	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	103,981	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	107,167	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	109,609	2019/3/20
第30回住友商事	1.7	100,000	105,126	2016/3/1
第69回三菱商事	1.99	100,000	108,448	2018/5/22
第78回三菱商事	1.155	100,000	101,293	2022/3/9
第18回みずほコーポレート銀行	0.83	100,000	101,267	2014/10/16
第23回みずほコーポレート銀行	0.43	100,000	100,328	2015/10/20
第26回みずほコーポレート銀行	0.54	100,000	100,648	2016/7/20
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	100,000	100,257	2017/4/21
第7回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.11	100,000	108,302	2019/12/20
第8回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.64	100,000	103,644	2015/7/22
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	200,000	229,576	2020/2/27
第20回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	100,000	103,401	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	104,622	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	107,346	2017/4/20
第121回三菱東京UFJ銀行	0.555	100,000	101,040	2016/1/20
第2回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.95	100,000	103,136	2014/6/17
第5回住友信託銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	106,012	2016/4/27
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	2.78	100,000	110,198	2026/4/27
第3回中央三井信託銀行(劣後特約付)	2.03	100,000	103,816	2015/1/28
第9回三井住友銀行(劣後特約付)	1.75	100,000	103,981	2015/8/17
第10回三井住友銀行(劣後特約付)	2.11	100,000	106,907	2017/2/16
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	108,843	2019/7/24
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	103,795	2020/12/17
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	104,663	2026/6/1
第48回三井住友銀行	0.77	100,000	101,275	2014/10/20
第53回三井住友銀行	0.69	100,000	101,524	2016/4/20
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	100,691	2016/7/20
第2回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	103,218	2015/8/7
第6回みずほ銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	106,464	2016/11/4
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	2.52	100,000	105,691	2027/4/27
第40回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.56	100,000	100,920	2016/6/20
第16回ホンダファイナンス	0.589	100,000	100,999	2015/12/18
第40回トヨタファイナンス	1.478	100,000	102,556	2014/6/20
第3回三井住友ファイナンス&リース	0.621	100,000	100,656	2016/8/3
第13回三菱UFJリース	0.796	100,000	101,386	2016/4/22
第15回野村ホールディングス	2.01	100,000	102,618	2014/6/13
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	98,941	2025/9/24
第2回財政融資マスター ラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	107,504	2018/6/20
第5回三井住友海上火災保険	0.67	100,000	100,901	2016/1/27
第31回三井不動産	1.645	100,000	103,179	2014/9/19
第98回三菱地所	1.165	100,000	102,887	2020/6/19

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第1回イオンモール	1.6	100,000	101,102	2013/8/6
第7回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.9	100,000	106,567	2016/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	102,471	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	106,583	2017/11/29
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	107,224	2018/12/20
第5回東海旅客鉄道	2.6	30,000	34,219	2020/1/28
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	104,904	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	102,111	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	107,898	2019/5/31
第11回商船三井	1.278	100,000	101,674	2014/5/27
第4回関西高速鉄道	1.633	100,000	106,505	2019/8/14
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	103,011	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	106,683	2017/3/17
第53回日本電信電話	1.54	100,000	105,985	2017/12/20
第59回日本電信電話	1.69	100,000	107,351	2019/6/20
第19回KDDI	1.151	100,000	102,197	2020/6/19
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1.96	100,000	108,603	2018/6/20
第30回東京ガス	1.658	100,000	104,219	2015/5/30
第9回大阪ガス	2.9	100,000	113,713	2018/1/29
第10回西部瓦斯	0.807	100,000	101,518	2017/1/26
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,374	2020/3/19
第7回JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	1.8	100,000	102,117	2014/5/30
第5回バークレイズ・バンク	1.29	100,000	99,684	2015/9/9
第4回ナショナル・オーストラリア銀行	1.16	100,000	101,204	2015/7/29
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	1.01	100,000	100,719	2016/2/4
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	100,000	100,180	2016/6/10
第5回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.23	100,000	101,276	2015/1/27
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	100,963	2015/9/3
第1回オーストラリア連邦保証ANZ銀行	1.65	100,000	102,080	2014/2/10
第5回オーストラリア・ニュージランド銀行	1.22	100,000	101,183	2015/2/10
第6回オーストラリア・ニュージランド銀行	0.98	100,000	100,531	2016/1/21
第3回ラボバンク・ネダーランド	1.01	100,000	100,168	2015/2/18
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	98,963	2021/1/28
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	101,019	2015/7/28
小計	—	14,865,000	15,172,823	—
合計	—	191,432,662	202,278,022	—

(C) 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	百万円 143	百万円 —
債券先物取引		
10年国債標準物		

投資信託財産の構成

2012年5月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 202,278,022	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,070,547	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	204,348,569	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況

2012年5月14日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	204,348,539,968円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	709,541,819
公 社 債 (評価額)	202,278,022,086
未 収 入 金	531,899,080
未 収 利 息	772,168,204
前 払 費 用	56,398,779
差 入 委 託 証 拠 金	510,000
(B) 負 債	800,775,142
未 払 金	276,847,900
未 払 解 約 金	523,927,242
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	203,547,764,826
元 本	171,589,551,863
次 期 繰 越 損 益 金	31,958,212,963
(D) 受 益 権 総 口 数	171,589,551,863口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,862円

損益の状況

(2011年5月13日～2012年5月14日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,219,334,805円
受 取 利 息	3,219,334,805
(B) 有 価 証 券 買 買 損 益	2,330,047,780
売 買 損 益	3,153,120,519
売 買 損 益	△ 823,072,739
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	38,950
取 引 損 益	38,950
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	5,549,421,535
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	27,639,317,703
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,404,562,082
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,635,088,357
(H) 計 (D + E + F + G)	31,958,212,963
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	31,958,212,963

- (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をいいます。

〈注記事項〉

- ①期首元本額
期中追加設定元本額
期中一部解約元本額
②期末における元本の内訳
ファンド・マネジャー（国内債券）
eMAXIS 国内債券インデックス
eMAXIS バランス（8資産均等型）
eMAXIS バランス（波乗り型）
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA
三菱UFJ バランスVA 30D（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスVA 60D（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスVA 30G（適格機関投資家限定）
三菱UFJ バランスVA 60G（適格機関投資家限定）
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）
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）
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）
合計

179,419,655,523円
26,089,227,091円
33,919,330,751円
319,765,878円
1,315,963,745円
21,675,373円
23,840,970円
52,728,206,433円
18,569,749,178円
3,542,707,436円
8,826,745,743円
24,064,725,018円
20,435,228,629円
6,334,619,296円
4,509,502,438円
1,028,665,688円
497,983,750円
7,668,133,508円
4,551,972,000円
15,110,760円
321,622,394円
394,440,477円
327,943,180円
252,747,900円
181,780,369円
1,341,695,074円
3,087,341,339円
1,376,104,046円
1,996,096,070円
1,452,956,038円
1,649,045,341円
2,882,210,154円
1,283,237,595円
587,736,043円
171,589,551,863円



三菱UFJ投信より
基準価額・分配金をメール配信
<http://k.m-muam.jp/a/1/3>

*メール配信対象外ファンドもあります。

