

## 【表紙】

|  |                      |
|--|----------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書            |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿              |
| 【提出日】                                    | 2024年10月25日提出        |
| 【発行者名】                                   | 三菱UFJアセットマネジメント株式会社  |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 横川 直           |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都港区東新橋一丁目9番1号      |
| 【事務連絡者氏名】                                | 伊藤 晃                 |
| 【電話番号】                                   | 03-4223-3037         |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 1兆円を上限とします。          |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。          |

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2024年4月25日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

**2【訂正の内容】**

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、NOMURA - BPI総合（指数）に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

\* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

## 商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域       | 投資対象資産<br>(収益の源泉) | 独立区分  | 補足分類    |
|---------|--------------|-------------------|-------|---------|
| 単位型     | 国内           | 株式                | MMF   | インデックス型 |
|         | 海外           | 債券                |       |         |
| 追加型     |              | 内外                | 不動産投信 | MRF     |
|         | その他資産<br>( ) |                   | ETF   |         |
|         |              | 資産複合              |       |         |

## 属性区分表

| 投資対象資産                                   | 決算頻度         | 投資対象地域                | 投資形態                 | 為替<br>ヘッジ | 対象<br>インデックス                   | 特殊型                           |
|--|--------------|-----------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|-------------------------------|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株                  | 年1回          | グローバル                 | ファミリー<br>ファンド        | あり<br>( ) | 日経225                          | ブル・ベア型                        |
|  | 年2回          | 日本                    |                      |           |                                |                               |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券            | 年4回          | 北米                    | ファンド・<br>オブ・<br>ファンズ | なし        | TOPIX                          | 条件付運用型                        |
|  | 年6回<br>(隔月)  | 欧州                    |                      |           |                                |                               |
| クレジット<br>属性<br>( )                       | 年12回<br>(毎月) | アジア                   |                      |           | その他<br>(NOMURA -<br>BPI総合(指数)) | ロング・<br>ショート型/<br>絶対収益<br>追求型 |
|  | 日々           | オセアニア                 |                      |           |                                |                               |
| 不動産投信<br>その他資産<br>(投資信託証<br>券(債券一<br>般)) | その他          | 中南米                   |                      |           |                                | その他<br>( )                    |
|  | ( )          | アフリカ                  |                      |           |                                |                               |
| 資産複合<br>( )                              | ( )          | 中近東<br>(中東)<br>エマージング |                      |           |                                |                               |

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけ

ます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

#### 商品分類の定義

|         |                       |  |
|---------|-----------------------|--|
| 単位型・追加型 | 単位型                   | 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われずファンドをいいます。  |
|         | 追加型                   | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。  |
| 投資対象地域  | 国内                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|         | 海外                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|         | 内外                    | 信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
| 投資対象資産  | 株式                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|         | 債券                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|         | 不動産投信（リート）            | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                               |
|         | その他資産                 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|         | 資産複合                  | 信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                       |
| 独立区分    | MMF（マネー・マネージメント・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MRF及びMMFの運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。  |
|         | MRF（マネー・リザーブ・ファンド）    | 一般社団法人投資信託協会が定める「MRF及びMMFの運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。  |
|         | ETF                   | 投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。 |
| 補足分類    | インデックス型               | 信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。  |
|         | 特殊型                   | 信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。   |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

#### 属性区分の定義

|        |    |      |                                       |
|--------|----|------|---------------------------------------|
| 投資対象資産 | 株式 | 一般   | 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。       |
|        |    | 大型株  | 信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        |    | 中小型株 | 信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
|        | 債券 | 一般   | 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。    |

|        |          |   |
|--------|----------|---|
|        | 公債       | 信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 社債       | 信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | その他債券    | 信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | クレジット属性  | 目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。 |
|        | 不動産投信    | 信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | その他資産    | 信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | 資産複合     | 信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。  |
| 決算頻度   | 年1回      | 信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 年2回      | 信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 年4回      | 信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 年6回（隔月）  | 信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 年12回（毎月） | 信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | 日々       | 信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | その他      | 上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。   |
| 投資対象地域 | グローバル    | 信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 日本       | 信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 北米       | 信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 欧州       | 信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | アジア      | 信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | オセアニア    | 信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|        | 中南米      | 信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|        | アフリカ     | 信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。   |
|        | 中近東（中東）  | 信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |
|        | エマージング   | 信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。  |

|          |                     |  |
|----------|---------------------|--|
| 投資形態     | ファミリーファンド           | 信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。   |
|          | ファンド・オブ・ファンズ        | 一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。   |
| 為替ヘッジ    | あり                  | 信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。   |
|          | なし                  | 信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。   |
| 対象インデックス | 日経225               | 信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。   |
|          | TOPIX               | 信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。   |
|          | その他                 | 信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。   |
| 特殊型      | ブル・ベア型              | 信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。                        |
|          | 条件付運用型              | 信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。 |
|          | ロング・ショート型 / 絶対収益追求型 | 信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。  |
|          | その他                 | 信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。  |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

#### [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、わが国の公社債の指標であるNOMURA-BPI総合(指数)に概ね連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

特色

1

わが国の公社債を主要投資対象とします。

公社債(債券とも言われます)は、資金調達をしようとする国や地方公共団体、企業など(発行体)が多数の投資者から資金を借入れる際に発行する、いわば「借用証書」です。発行体は発行時に定めた返済の期日(償還期日)までの期間中に一定の利子を支払うことを約束しています。

特色

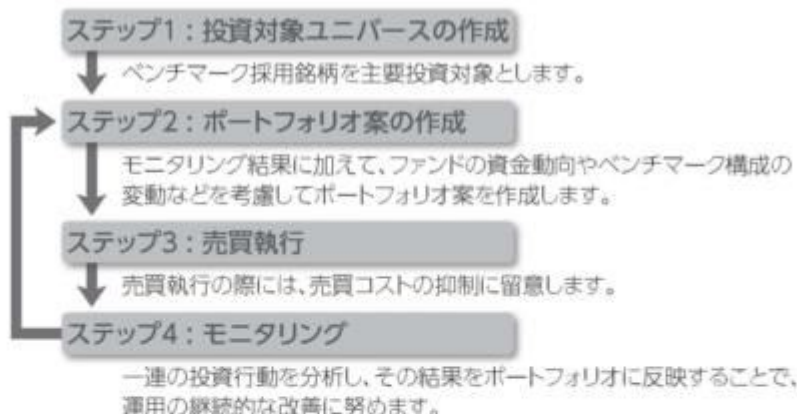
2

日本の債券市場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。

ベンチマーク\*(NOMURA-BPI総合(指数))に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

※ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

### <運用プロセスのイメージ>



■ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

☞ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。  
([https://www.am.mufg.jp/investment\\_policy/fm.html](https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html))

### NOMURA-BPI総合(指数)とは

NOMURA-BPI総合(指数)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。

## NOMURA-BPIの銘柄組入基準

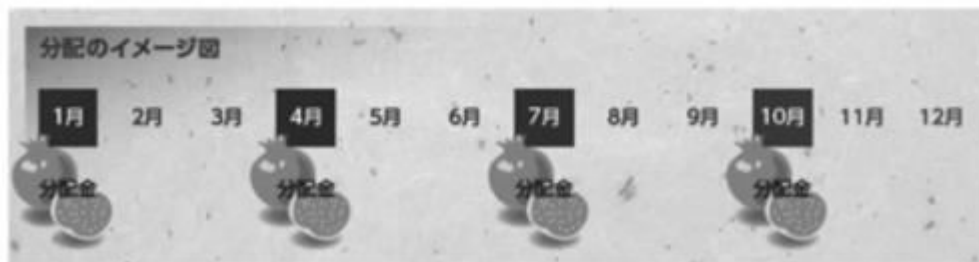
- 国内発行の公募固定利付円貨債券(ただし転換社債、ワラント付社債、資産担保証券、社債担保証券、ローン担保証券、ステップ・アップ債、個人向け債券を除く。なお、資産担保証券のうち、財政融資資金貸付金ABS、生命保険会社の基金・劣後ローン債、投資法人債は組入対象とする)
- 残存額面は10億円以上、残存期間は1年以上
- 事業債、円建外債、MBSおよびABSの場合、A格相当以上の格付け(S&Pグローバル・レーティング(S&P)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研究所(JCR)のうちいずれかから取得)
- 新発債の組み入れは、国債が発行月の翌月、金融債は発行月から3ヵ月後、その他一般債は発行月の翌々月から行う。
- 銘柄入替は毎月末に行い、翌月1ヵ月間については組入銘柄を固定


 特色3

年4回の決算時(1・4・7・10月の各26日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行うことをめざします。

以下の収益分配方針に基づき分配を行います。

- ・分配対象額は、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。)等の全額とします。
- ・分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- ・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。
- ・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。



上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

### ■ファンドの仕組み

運用は主に日本債券インデックスマザーファンドへの投資を通じて、わが国の公社債へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



### ■主な投資制限

- ・デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



## (3) 【ファンドの仕組み】

&lt;訂正前&gt;

## 委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要  |
|--------------------------------------|---|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。   |

## 委託会社の概況（2024年4月1日現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更  
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更  
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更
- ・大株主の状況

| 株主名                   | 住所                | 所有株式数    | 所有比率   |
|-----------------------|-------------------|----------|--------|
| 株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区丸の内二丁目7番1号 | 211,581株 | 100.0% |

&lt;訂正後&gt;

## 委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要  |
|--------------------------------------|---|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。   |

## 委託会社の概況（2024年7月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革
  - 1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
  - 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
  - 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
  - 2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
  - 2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更

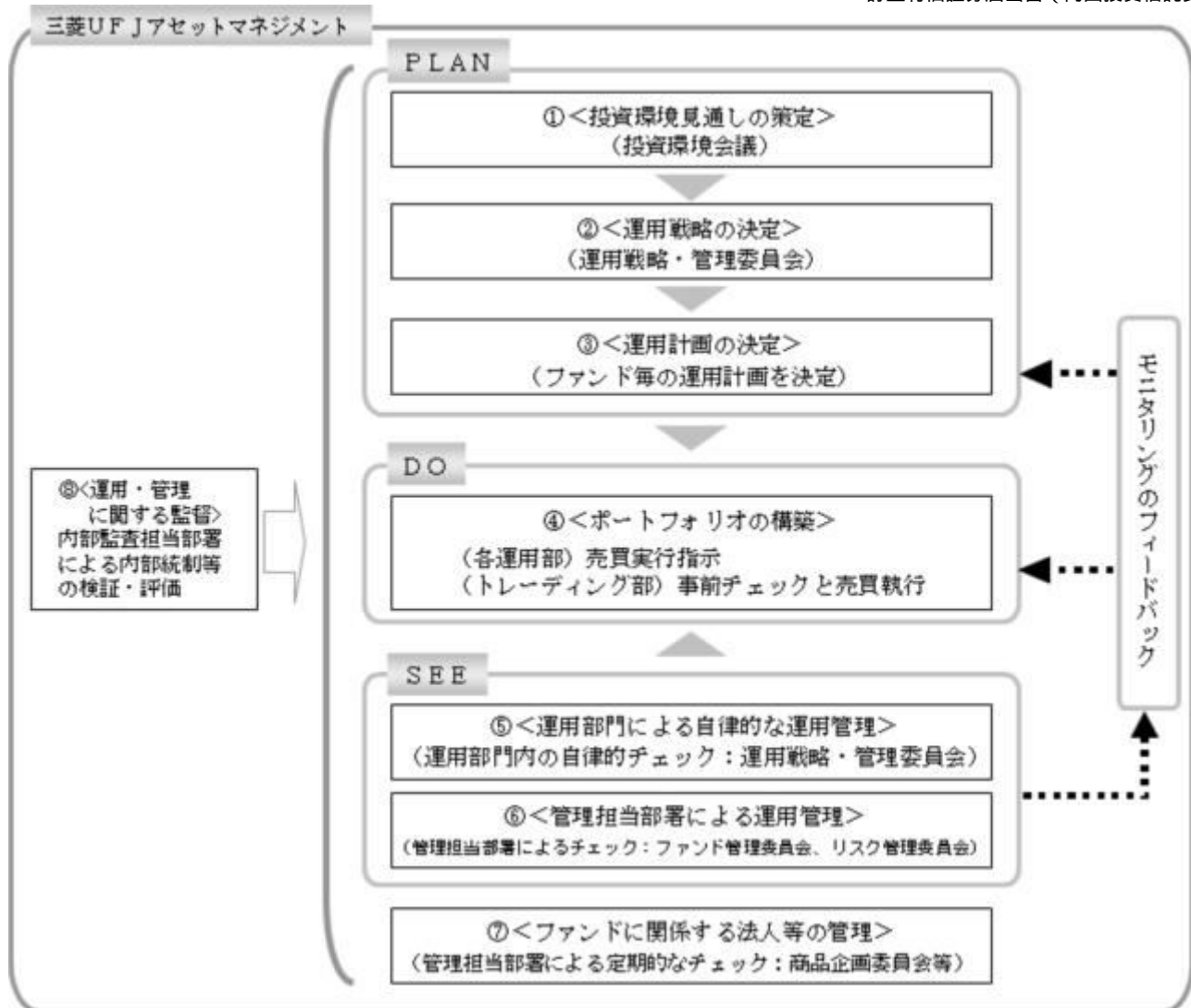
## ・大株主の状況

| 株主名                   | 住所                | 所有株式数    | 所有比率   |
|-----------------------|-------------------|----------|--------|
| 株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区丸の内二丁目7番1号 | 211,581株 | 100.0% |

## 2【投資方針】

## (3)【運用体制】

&lt;更新後&gt;



#### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

#### 運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

#### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

#### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

#### 運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

#### 管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

#### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担

当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 [https://www.am.mufg.jp/investment\\_policy/fm.html](https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html)

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### (1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに

相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、NOMURA - B P I総合(指数)の動きに概ね連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、債券先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、分配金を準備するためにファンド内に資金が滞留すること等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・一般的に金利が低下した場合、資産担保証券(MBS、ABS)の担保となるローンの期限前返済が増加し、資産担保証券の期限前償還が増加することがあります。そのため当初期待した利回りでの再投資ができない可能性、もしくは証券を額面価額より高く購入している場合、償還損を被る可能性等があります。

## (2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

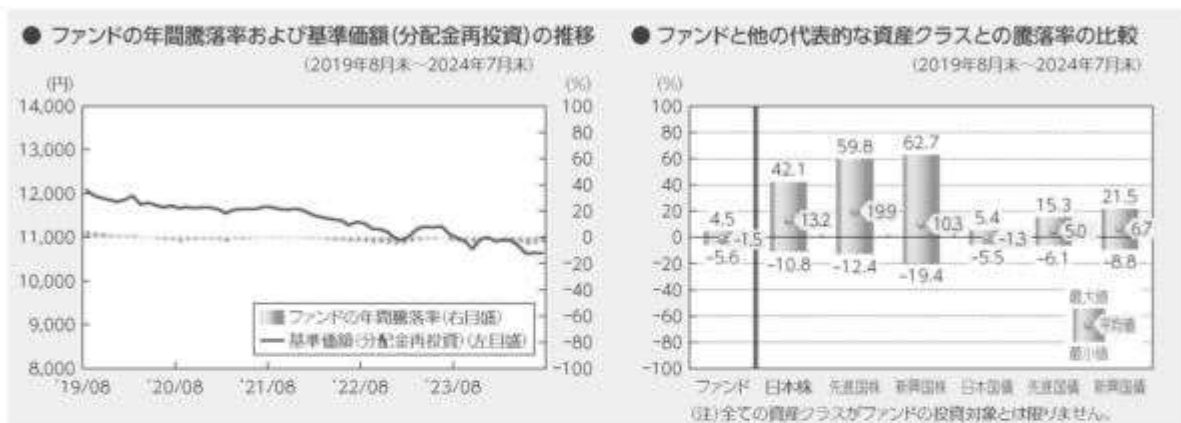
### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等   |
|-------|-------------------------------|---|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(配当込み)       | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。   |
| 先進国株  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み)     | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。  |
| 新興国株  | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。   |
| 日本国債  | NOMURA-BPI(国債)                | NOMURA-BPI(国債)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国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。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。  |
| 先進国債  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本)      | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド   | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。   |

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

#### 個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

##### 1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

##### 2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象です。販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

#### 個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

#### 収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は2024年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2024年1月27日～2024年7月26日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.38%     | 0.38%      | 0.00%     |

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を当期間の平均受益権口数に平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除しています。

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

## 5【運用状況】

### 【三菱UFJ 国内債券インデックスファンド】

#### （1）【投資状況】

2024年 7月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 2,091,386,096 | 99.99   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 105,205       | 0.01    |
| 純資産総額                    |      | 2,091,491,301 | 100.00  |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位30銘柄

2024年 7月31日現在

| 国/地域 | 種類        | 銘柄名               | 数量            | 簿価単価<br>（円） | 簿価金額<br>（円）   | 評価単価<br>（円） | 評価金額<br>（円）   | 投資比率<br>（%） |
|------|-----------|-------------------|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド | 1,681,989,783 | 1.2447      | 2,093,573,308 | 1.2434      | 2,091,386,096 | 99.99       |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

##### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 7月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|----|---------|
|----|---------|



|           |       |
|-----------|-------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計        | 99.99 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### （3）【運用実績】

##### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                         | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-------------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                         | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第22計算期間末日 (2014年10月27日) | 2,138,223,438 | 2,144,402,743 | 10,381                 | 10,411 |
| 第23計算期間末日 (2015年 1月26日) | 2,056,393,609 | 2,062,245,995 | 10,541                 | 10,571 |
| 第24計算期間末日 (2015年 4月27日) | 2,743,548,457 | 2,751,396,243 | 10,488                 | 10,518 |
| 第25計算期間末日 (2015年 7月27日) | 2,760,860,686 | 2,768,821,252 | 10,405                 | 10,435 |
| 第26計算期間末日 (2015年10月26日) | 2,809,544,105 | 2,817,615,559 | 10,443                 | 10,473 |
| 第27計算期間末日 (2016年 1月26日) | 2,826,807,680 | 2,834,863,525 | 10,527                 | 10,557 |
| 第28計算期間末日 (2016年 4月26日) | 2,886,076,578 | 2,893,990,537 | 10,940                 | 10,970 |
| 第29計算期間末日 (2016年 7月26日) | 3,205,294,363 | 3,214,025,948 | 11,013                 | 11,043 |
| 第30計算期間末日 (2016年10月26日) | 3,226,092,708 | 3,235,039,804 | 10,817                 | 10,847 |
| 第31計算期間末日 (2017年 1月26日) | 3,432,062,173 | 3,441,803,687 | 10,569                 | 10,599 |
| 第32計算期間末日 (2017年 4月26日) | 3,560,136,158 | 3,570,216,206 | 10,596                 | 10,626 |
| 第33計算期間末日 (2017年 7月26日) | 3,550,558,340 | 3,560,689,836 | 10,513                 | 10,543 |
| 第34計算期間末日 (2017年10月26日) | 3,519,322,011 | 3,529,386,685 | 10,490                 | 10,520 |
| 第35計算期間末日 (2018年 1月26日) | 3,269,687,346 | 3,279,052,193 | 10,474                 | 10,504 |
| 第36計算期間末日 (2018年 4月26日) | 3,162,384,318 | 3,171,441,591 | 10,475                 | 10,505 |
| 第37計算期間末日 (2018年 7月26日) | 3,092,484,681 | 3,101,389,192 | 10,419                 | 10,449 |
| 第38計算期間末日 (2018年10月26日) | 3,013,234,971 | 3,021,964,378 | 10,355                 | 10,385 |
| 第39計算期間末日 (2019年 1月28日) | 2,740,277,621 | 2,748,132,076 | 10,466                 | 10,496 |
| 第40計算期間末日 (2019年 4月26日) | 2,751,795,872 | 2,759,664,362 | 10,492                 | 10,522 |
| 第41計算期間末日 (2019年 7月26日) | 2,792,720,063 | 2,800,633,184 | 10,588                 | 10,618 |
| 第42計算期間末日 (2019年10月28日) | 3,011,849,326 | 3,020,434,065 | 10,525                 | 10,555 |
| 第43計算期間末日 (2020年 1月27日) | 3,312,854,244 | 3,322,349,843 | 10,466                 | 10,496 |
| 第44計算期間末日 (2020年 4月27日) | 3,206,235,214 | 3,215,503,664 | 10,378                 | 10,408 |
| 第45計算期間末日 (2020年 7月27日) | 3,393,708,402 | 3,403,619,890 | 10,272                 | 10,302 |
| 第46計算期間末日 (2020年10月26日) | 3,533,675,898 | 3,544,043,814 | 10,225                 | 10,255 |
| 第47計算期間末日 (2021年 1月26日) | 3,531,487,909 | 3,541,888,641 | 10,186                 | 10,216 |
| 第48計算期間末日 (2021年 4月26日) | 3,522,408,979 | 3,532,821,370 | 10,149                 | 10,179 |

|           |               |               |               |        |        |
|-----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第49計算期間末日 | (2021年 7月26日) | 3,461,880,504 | 3,472,108,351 | 10,154 | 10,184 |
| 第50計算期間末日 | (2021年10月26日) | 3,330,938,970 | 3,340,884,402 | 10,048 | 10,078 |
| 第51計算期間末日 | (2022年 1月26日) | 3,167,570,673 | 3,177,081,709 | 9,991  | 10,021 |
| 第52計算期間末日 | (2022年 4月26日) | 3,041,778,382 | 3,051,095,774 | 9,794  | 9,824  |
| 第53計算期間末日 | (2022年 7月26日) | 2,895,465,727 | 2,904,402,818 | 9,719  | 9,749  |
| 第54計算期間末日 | (2022年10月26日) | 2,801,287,148 | 2,810,152,154 | 9,480  | 9,510  |
| 第55計算期間末日 | (2023年 1月26日) | 2,716,929,669 | 2,725,622,322 | 9,377  | 9,407  |
| 第56計算期間末日 | (2023年 4月26日) | 2,663,187,911 | 2,671,608,277 | 9,488  | 9,518  |
| 第57計算期間末日 | (2023年 7月26日) | 2,618,140,213 | 2,626,411,078 | 9,496  | 9,526  |
| 第58計算期間末日 | (2023年10月26日) | 2,484,933,873 | 2,493,131,178 | 9,094  | 9,124  |
| 第59計算期間末日 | (2024年 1月26日) | 2,329,992,782 | 2,333,791,149 | 9,201  | 9,216  |
| 第60計算期間末日 | (2024年 4月26日) | 2,185,076,253 | 2,188,696,844 | 9,053  | 9,068  |
| 第61計算期間末日 | (2024年 7月26日) | 2,090,934,137 | 2,094,443,076 | 8,938  | 8,953  |
|           | 2023年 7月末日    | 2,592,958,151 |               | 9,374  |        |
|           | 8月末日          | 2,564,358,603 |               | 9,303  |        |
|           | 9月末日          | 2,534,942,785 |               | 9,234  |        |
|           | 10月末日         | 2,477,198,975 |               | 9,055  |        |
|           | 11月末日         | 2,478,375,834 |               | 9,243  |        |
|           | 12月末日         | 2,387,941,451 |               | 9,278  |        |
|           | 2024年 1月末日    | 2,323,633,649 |               | 9,192  |        |
|           | 2月末日          | 2,292,679,219 |               | 9,218  |        |
|           | 3月末日          | 2,267,271,553 |               | 9,205  |        |
|           | 4月末日          | 2,193,983,458 |               | 9,081  |        |
|           | 5月末日          | 2,129,376,538 |               | 8,933  |        |
|           | 6月末日          | 2,103,611,808 |               | 8,955  |        |
|           | 7月末日          | 2,091,491,301 |               | 8,928  |        |

## 【分配の推移】

|         | 1万口当たりの分配金 |
|---------|------------|
| 第22計算期間 | 30円        |
| 第23計算期間 | 30円        |
| 第24計算期間 | 30円        |
| 第25計算期間 | 30円        |
| 第26計算期間 | 30円        |
| 第27計算期間 | 30円        |
| 第28計算期間 | 30円        |
| 第29計算期間 | 30円        |
| 第30計算期間 | 30円        |
| 第31計算期間 | 30円        |
| 第32計算期間 | 30円        |
| 第33計算期間 | 30円        |
| 第34計算期間 | 30円        |
| 第35計算期間 | 30円        |

|         |     |
|---------|-----|
| 第36計算期間 | 30円 |
| 第37計算期間 | 30円 |
| 第38計算期間 | 30円 |
| 第39計算期間 | 30円 |
| 第40計算期間 | 30円 |
| 第41計算期間 | 30円 |
| 第42計算期間 | 30円 |
| 第43計算期間 | 30円 |
| 第44計算期間 | 30円 |
| 第45計算期間 | 30円 |
| 第46計算期間 | 30円 |
| 第47計算期間 | 30円 |
| 第48計算期間 | 30円 |
| 第49計算期間 | 30円 |
| 第50計算期間 | 30円 |
| 第51計算期間 | 30円 |
| 第52計算期間 | 30円 |
| 第53計算期間 | 30円 |
| 第54計算期間 | 30円 |
| 第55計算期間 | 30円 |
| 第56計算期間 | 30円 |
| 第57計算期間 | 30円 |
| 第58計算期間 | 30円 |
| 第59計算期間 | 15円 |
| 第60計算期間 | 15円 |
| 第61計算期間 | 15円 |

## 【収益率の推移】

|         | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 第22計算期間 | 0.55   |
| 第23計算期間 | 1.83   |
| 第24計算期間 | 0.21   |
| 第25計算期間 | 0.50   |
| 第26計算期間 | 0.65   |
| 第27計算期間 | 1.09   |
| 第28計算期間 | 4.20   |
| 第29計算期間 | 0.94   |
| 第30計算期間 | 1.50   |
| 第31計算期間 | 2.01   |
| 第32計算期間 | 0.53   |
| 第33計算期間 | 0.50   |
| 第34計算期間 | 0.06   |
| 第35計算期間 | 0.13   |

|         |      |
|---------|------|
| 第36計算期間 | 0.29 |
| 第37計算期間 | 0.24 |
| 第38計算期間 | 0.32 |
| 第39計算期間 | 1.36 |
| 第40計算期間 | 0.53 |
| 第41計算期間 | 1.20 |
| 第42計算期間 | 0.31 |
| 第43計算期間 | 0.27 |
| 第44計算期間 | 0.55 |
| 第45計算期間 | 0.73 |
| 第46計算期間 | 0.16 |
| 第47計算期間 | 0.08 |
| 第48計算期間 | 0.06 |
| 第49計算期間 | 0.34 |
| 第50計算期間 | 0.74 |
| 第51計算期間 | 0.26 |
| 第52計算期間 | 1.67 |
| 第53計算期間 | 0.45 |
| 第54計算期間 | 2.15 |
| 第55計算期間 | 0.77 |
| 第56計算期間 | 1.50 |
| 第57計算期間 | 0.40 |
| 第58計算期間 | 3.91 |
| 第59計算期間 | 1.34 |
| 第60計算期間 | 1.44 |
| 第61計算期間 | 1.10 |

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配の額）を控除した額を当該基準価額（分配の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

#### （４）【設定及び解約の実績】

|         | 設定口数          | 解約口数          | 発行済口数         |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 第22計算期間 | 1,050,869,797 | 824,474,631   | 2,059,768,654 |
| 第23計算期間 | 1,032,536,313 | 1,141,509,566 | 1,950,795,401 |
| 第24計算期間 | 1,256,110,243 | 590,976,767   | 2,615,928,877 |
| 第25計算期間 | 551,949,161   | 514,355,904   | 2,653,522,134 |
| 第26計算期間 | 385,905,225   | 348,942,402   | 2,690,484,957 |
| 第27計算期間 | 390,184,792   | 395,387,870   | 2,685,281,879 |
| 第28計算期間 | 895,548,968   | 942,844,356   | 2,637,986,491 |
| 第29計算期間 | 807,850,149   | 535,308,269   | 2,910,528,371 |
| 第30計算期間 | 774,408,208   | 702,570,965   | 2,982,365,614 |
| 第31計算期間 | 720,348,251   | 455,542,437   | 3,247,171,428 |
| 第32計算期間 | 539,055,160   | 426,210,257   | 3,360,016,331 |
| 第33計算期間 | 351,364,999   | 334,215,741   | 3,377,165,589 |
| 第34計算期間 | 425,522,797   | 447,796,725   | 3,354,891,661 |

|         |             |             |               |
|---------|-------------|-------------|---------------|
| 第35計算期間 | 236,187,723 | 469,463,560 | 3,121,615,824 |
| 第36計算期間 | 256,410,013 | 358,934,787 | 3,019,091,050 |
| 第37計算期間 | 210,627,687 | 261,548,299 | 2,968,170,438 |
| 第38計算期間 | 203,722,904 | 262,090,891 | 2,909,802,451 |
| 第39計算期間 | 248,097,739 | 539,748,210 | 2,618,151,980 |
| 第40計算期間 | 248,425,259 | 243,747,228 | 2,622,830,011 |
| 第41計算期間 | 229,677,499 | 214,800,477 | 2,637,707,033 |
| 第42計算期間 | 374,473,382 | 150,600,746 | 2,861,579,669 |
| 第43計算期間 | 522,381,151 | 218,760,932 | 3,165,199,888 |
| 第44計算期間 | 247,253,215 | 322,969,488 | 3,089,483,615 |
| 第45計算期間 | 325,854,394 | 111,508,597 | 3,303,829,412 |
| 第46計算期間 | 317,852,281 | 165,709,628 | 3,455,972,065 |
| 第47計算期間 | 236,020,860 | 225,082,249 | 3,466,910,676 |
| 第48計算期間 | 237,587,514 | 233,701,177 | 3,470,797,013 |
| 第49計算期間 | 182,330,183 | 243,844,681 | 3,409,282,515 |
| 第50計算期間 | 179,522,728 | 273,661,214 | 3,315,144,029 |
| 第51計算期間 | 90,721,130  | 235,519,816 | 3,170,345,343 |
| 第52計算期間 | 85,624,564  | 150,172,343 | 3,105,797,564 |
| 第53計算期間 | 67,887,093  | 194,654,196 | 2,979,030,461 |
| 第54計算期間 | 71,927,886  | 95,956,332  | 2,955,002,015 |
| 第55計算期間 | 73,105,876  | 130,556,591 | 2,897,551,300 |
| 第56計算期間 | 72,327,949  | 163,090,264 | 2,806,788,985 |
| 第57計算期間 | 87,633,413  | 137,467,198 | 2,756,955,200 |
| 第58計算期間 | 73,032,892  | 97,552,826  | 2,732,435,266 |
| 第59計算期間 | 85,352,483  | 285,542,748 | 2,532,245,001 |
| 第60計算期間 | 137,611,867 | 256,128,948 | 2,413,727,920 |
| 第61計算期間 | 48,167,925  | 122,602,556 | 2,339,293,289 |

（参考）

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 投資状況

2024年 7月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計            | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券                     | 日本   | 795,961,579,060 | 83.23   |
| 地方債証券                    | 日本   | 49,644,773,592  | 5.19    |
| 特殊債券                     | 日本   | 39,550,285,386  | 4.14    |
| 社債券                      | 日本   | 58,910,064,000  | 6.16    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 12,267,079,046  | 1.28    |
| 純資産総額                    |      | 956,333,781,084 | 100.00  |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

2024年 7月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類  | 建別 | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------|----|------|---------------|---------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本   | 3,282,560,000 | 0.34    |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

2024年 7月31日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名            | 数量             | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円)    | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円)    | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資比率<br>(%) |
|------|------|----------------|----------------|-------------|----------------|-------------|----------------|-----------|-----------------|-------------|
| 日本   | 国債証券 | 第149回利付国債(5年)  | 12,670,000,000 | 99.22       | 12,571,334,900 | 99.07       | 12,553,309,300 | 0.005000  | 2026/9/20       | 1.31        |
| 日本   | 国債証券 | 第359回利付国債(10年) | 11,290,000,000 | 97.08       | 10,960,643,400 | 96.55       | 10,900,946,600 | 0.100000  | 2030/6/20       | 1.14        |
| 日本   | 国債証券 | 第365回利付国債(10年) | 10,970,000,000 | 95.39       | 10,464,398,200 | 94.85       | 10,405,374,100 | 0.100000  | 2031/12/20      | 1.09        |
| 日本   | 国債証券 | 第368回利付国債(10年) | 10,130,000,000 | 95.20       | 9,644,627,100  | 94.62       | 9,585,107,300  | 0.200000  | 2032/9/20       | 1.00        |
| 日本   | 国債証券 | 第370回利付国債(10年) | 9,860,000,000  | 97.09       | 9,573,841,800  | 96.44       | 9,509,772,800  | 0.500000  | 2033/3/20       | 0.99        |
| 日本   | 国債証券 | 第373回利付国債(10年) | 9,780,000,000  | 97.03       | 9,489,694,800  | 96.40       | 9,428,115,600  | 0.600000  | 2033/12/20      | 0.99        |
| 日本   | 国債証券 | 第356回利付国債(10年) | 9,580,000,000  | 97.53       | 9,343,716,000  | 97.14       | 9,306,491,000  | 0.100000  | 2029/9/20       | 0.97        |
| 日本   | 国債証券 | 第163回利付国債(5年)  | 9,330,000,000  | 99.60       | 9,293,548,500  | 99.21       | 9,256,479,600  | 0.400000  | 2028/9/20       | 0.97        |
| 日本   | 国債証券 | 第363回利付国債(10年) | 9,520,000,000  | 95.97       | 9,137,000,000  | 95.49       | 9,091,028,800  | 0.100000  | 2031/6/20       | 0.95        |
| 日本   | 国債証券 | 第371回利付国債(10年) | 9,510,000,000  | 96.00       | 9,129,633,600  | 95.29       | 9,062,839,800  | 0.400000  | 2033/6/20       | 0.95        |
| 日本   | 国債証券 | 第369回利付国債(10年) | 9,370,000,000  | 97.27       | 9,114,329,000  | 96.69       | 9,060,040,400  | 0.500000  | 2032/12/20      | 0.95        |
| 日本   | 国債証券 | 第361回利付国債(10年) | 9,360,000,000  | 96.48       | 9,030,528,000  | 96.06       | 8,991,871,200  | 0.100000  | 2030/12/20      | 0.94        |
| 日本   | 国債証券 | 第358回利付国債(10年) | 9,240,000,000  | 97.29       | 8,990,506,500  | 96.77       | 8,941,917,600  | 0.100000  | 2030/3/20       | 0.94        |
| 日本   | 国債証券 | 第158回利付国債(5年)  | 9,040,000,000  | 98.73       | 8,925,741,400  | 98.41       | 8,896,625,600  | 0.100000  | 2028/3/20       | 0.93        |
| 日本   | 国債証券 | 第372回利付国債(10年) | 8,570,000,000  | 99.12       | 8,495,293,500  | 98.44       | 8,437,079,300  | 0.800000  | 2033/9/20       | 0.88        |
| 日本   | 国債証券 | 第168回利付国債(5年)  | 8,300,000,000  | 99.80       | 8,284,110,000  | 99.86       | 8,288,712,000  | 0.600000  | 2029/3/20       | 0.87        |
| 日本   | 国債証券 | 第367回利付国債(10年) | 8,390,000,000  | 95.54       | 8,016,141,600  | 94.95       | 7,966,388,900  | 0.200000  | 2032/6/20       | 0.83        |
| 日本   | 国債証券 | 第156回利付国債(5年)  | 8,050,000,000  | 99.23       | 7,988,498,000  | 98.91       | 7,962,899,000  | 0.200000  | 2027/12/20      | 0.83        |
| 日本   | 国債証券 | 第150回利付国債(5年)  | 7,430,000,000  | 99.05       | 7,359,777,000  | 98.93       | 7,351,019,100  | 0.005000  | 2026/12/20      | 0.77        |
| 日本   | 国債証券 | 第148回利付国債(5年)  | 7,200,000,000  | 99.30       | 7,149,976,000  | 99.20       | 7,142,760,000  | 0.005000  | 2026/6/20       | 0.75        |
| 日本   | 国債証券 | 第362回利付国債(10年) | 7,440,000,000  | 96.28       | 7,163,641,200  | 95.80       | 7,127,668,800  | 0.100000  | 2031/3/20       | 0.75        |
| 日本   | 国債証券 | 第153回利付国債(5年)  | 7,220,000,000  | 98.85       | 7,137,496,000  | 98.63       | 7,121,374,800  | 0.005000  | 2027/6/20       | 0.74        |

|    |      |                |               |       |               |       |               |          |            |      |
|----|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第366回利付国債(10年) | 7,210,000,000 | 95.72 | 6,901,879,700 | 95.27 | 6,869,111,200 | 0.200000 | 2032/3/20  | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第460回利付国債(2年)  | 6,700,000,000 | 99.90 | 6,693,722,000 | 99.81 | 6,687,739,000 | 0.300000 | 2026/5/1   | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第457回利付国債(2年)  | 6,510,000,000 | 99.66 | 6,488,217,400 | 99.61 | 6,484,676,100 | 0.100000 | 2026/2/1   | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 6,530,000,000 | 98.73 | 6,447,134,300 | 98.41 | 6,426,434,200 | 0.100000 | 2028/3/20  | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債(10年) | 6,640,000,000 | 96.84 | 6,430,594,400 | 96.32 | 6,396,112,800 | 0.100000 | 2030/9/20  | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第145回利付国債(5年)  | 6,410,000,000 | 99.87 | 6,401,731,100 | 99.76 | 6,394,744,200 | 0.100000 | 2025/9/20  | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第458回利付国債(2年)  | 6,400,000,000 | 99.82 | 6,388,544,000 | 99.72 | 6,382,336,000 | 0.200000 | 2026/3/1   | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債(10年) | 6,340,000,000 | 99.35 | 6,299,107,000 | 99.16 | 6,286,807,400 | 0.100000 | 2026/12/20 | 0.66 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 7月31日現在

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 83.23   |
| 地方債証券 | 5.19    |
| 特殊債券  | 4.14    |
| 社債券   | 6.16    |
| 合計    | 98.72   |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

2024年 7月31日現在

| 資産の種類  | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額(円)       | 評価金額(円)       | 投資比率(%) |
|--------|-------|---------------|----|----|----|---------------|---------------|---------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物24年09月限 | 買建 | 23 | 円  | 3,298,801,505 | 3,282,560,000 | 0.34    |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

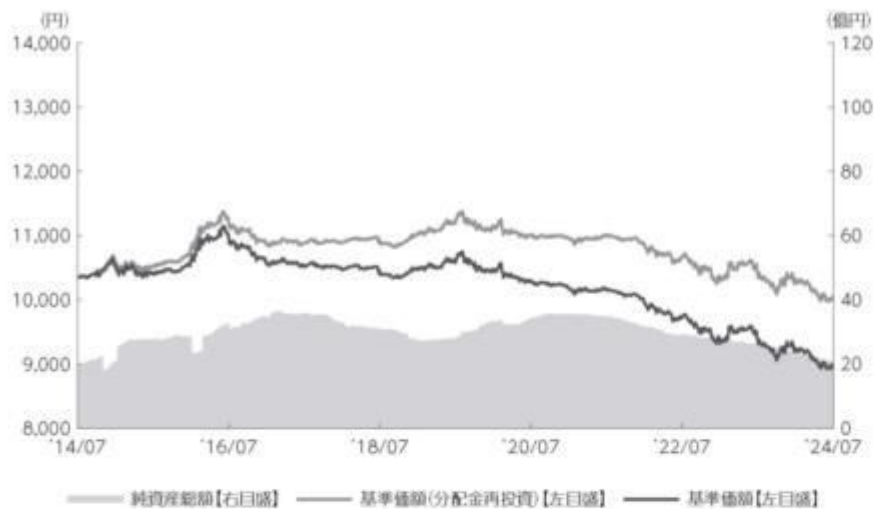
#### 参考情報



## 運用実績

2024年7月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2014年7月31日～2024年7月31日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

### ■基準価額・純資産

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 8,928円 |
| 純資産総額 | 20.9億円 |

•純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|           |        |
|-----------|--------|
| 2024年 7月  | 15円    |
| 2024年 4月  | 15円    |
| 2024年 1月  | 15円    |
| 2023年 10月 | 30円    |
| 2023年 7月  | 30円    |
| 2023年 4月  | 30円    |
| 直近1年間累計   | 75円    |
| 設定来累計     | 1,785円 |

•分配金は1万円当たり、税引前

### ■主要な資産の状況

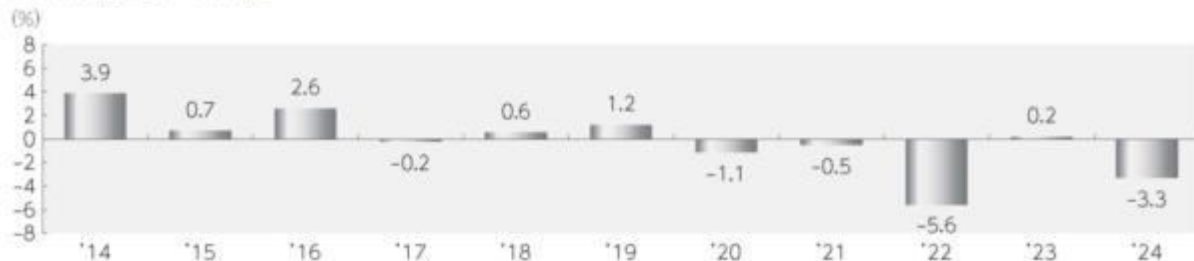
| 種別構成               | 比率     |
|--------------------|--------|
| 国債                 | 83.2%  |
| 地方債                | 5.2%   |
| 特殊債                | 4.1%   |
| 社債                 | 6.2%   |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 1.3%   |
| 合計                 | 100.0% |

| 組入上位銘柄            | 種別 | 比率   |
|-------------------|----|------|
| 1 第149回利付国債(5年)   | 国債 | 1.3% |
| 2 第359回利付国債(10年)  | 国債 | 1.1% |
| 3 第365回利付国債(10年)  | 国債 | 1.1% |
| 4 第368回利付国債(10年)  | 国債 | 1.0% |
| 5 第370回利付国債(10年)  | 国債 | 1.0% |
| 6 第373回利付国債(10年)  | 国債 | 1.0% |
| 7 第356回利付国債(10年)  | 国債 | 1.0% |
| 8 第163回利付国債(5年)   | 国債 | 1.0% |
| 9 第363回利付国債(10年)  | 国債 | 1.0% |
| 10 第371回利付国債(10年) | 国債 | 0.9% |

| その他資産の状況   | 比率   |
|------------|------|
| 債券先物取引(買建) | 0.3% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2024年は年初から7月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。



## 第3【ファンドの経理状況】

1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2 四半期決算ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2024年1月27日から2024年7月26日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【三菱UFJ 国内債券インデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 前期<br>[ 2024年 1月26日現在 ] | 当期<br>[ 2024年 7月26日現在 ] |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 3,598,602               | 2,175,809               |
| 親投資信託受益証券       | 2,329,776,214           | 2,090,740,074           |
| 未収入金            | 21,474,326              | 4,231,789               |
| 未収利息            | -                       | 3                       |
| 流動資産合計          | 2,354,849,142           | 2,097,147,675           |
| 資産合計            | 2,354,849,142           | 2,097,147,675           |
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 3,798,367               | 3,508,939               |
| 未払解約金           | 18,680,722              | 639,073                 |
| 未払受託者報酬         | 336,925                 | 292,742                 |
| 未払委託者報酬         | 2,021,507               | 1,756,417               |
| その他未払費用         | 18,839                  | 16,367                  |
| 流動負債合計          | 24,856,360              | 6,213,538               |
| 負債合計            | 24,856,360              | 6,213,538               |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 2,532,245,001           | 2,339,293,289           |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 202,252,219             | 248,359,152             |
| （分配準備積立金）       | 186,410                 | -                       |
| 元本等合計           | 2,329,992,782           | 2,090,934,137           |
| 純資産合計           | 2,329,992,782           | 2,090,934,137           |
| 負債純資産合計         | 2,354,849,142           | 2,097,147,675           |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

|   | 前期   |             | 当期   |             |
|---|--|-------------|--|-------------|
|   | 自<br>2023年<br>7月27日<br>至<br>2024年<br>1月26日 |             | 自<br>2024年<br>1月27日<br>至<br>2024年<br>7月26日 |             |
| <b>営業収益</b>                               |  |             |  |             |
| 受取利息                                      |  | 16          |  | 757         |
| 有価証券売買等損益                                 |  | 63,820,266  |  | 52,246,263  |
| 営業収益合計                                    |  | 63,820,250  |  | 52,245,506  |
| <b>営業費用</b>                               |  |             |  |             |
| 支払利息                                      |  | 436         |  | 14          |
| 受託者報酬                                     |  | 689,775     |  | 604,474     |
| 委託者報酬                                     |  | 4,138,570   |  | 3,626,766   |
| その他費用                                     |  | 38,566      |  | 33,795      |
| 営業費用合計                                    |  | 4,867,347   |  | 4,265,049   |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |  | 68,687,597  |  | 56,510,555  |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |  | 68,687,597  |  | 56,510,555  |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |  | 68,687,597  |  | 56,510,555  |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） |  | 1,694,069   |  | 1,370,592   |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |  | 138,814,987 |  | 202,252,219 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |  | 30,750,236  |  | 32,071,366  |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |  | 30,750,236  |  | 32,071,366  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |  | 11,810,130  |  | 15,908,806  |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |  | 11,810,130  |  | 15,908,806  |
| 分配金                                       |  | 11,995,672  |  | 7,129,530   |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |  | 202,252,219 |  | 248,359,152 |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                    |   |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
|--------------------|---|

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

|   | 前期<br>[2024年 1月26日現在] | 当期<br>[2024年 7月26日現在] |
|---|-----------------------|-----------------------|
| 1. 期首元本額                                | 2,756,955,200円        | 2,532,245,001円        |
| 期中追加設定元本額                               | 158,385,375円          | 185,779,792円          |
| 期中一部解約元本額                               | 383,095,574円          | 378,731,504円          |
| 2. 元本の欠損<br>純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 202,252,219円          | 248,359,152円          |
| 3. 受益権の総数                               | 2,532,245,001口        | 2,339,293,289口        |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期<br>自 2023年 7月27日<br>至 2024年 1月26日              |           |                | 当期<br>自 2024年 1月27日<br>至 2024年 7月26日              |           |                |
|---|-----------|----------------|---|-----------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程<br>第58期<br>2023年 7月27日<br>2023年10月26日 |           |                | 1. 分配金の計算過程<br>第60期<br>2024年 1月27日<br>2024年 4月26日 |           |                |
| 項目  |           |                | 項目  |           |                |
| 費用控除後の配当等収益額                                      | A         | 2,103,435円     | 費用控除後の配当等収益額                                      | A         | 1,832,770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              | 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         | 131,476,408円   | 収益調整金額  | C         | 110,813,279円   |
| 分配準備積立金額  | D         | 円              | 分配準備積立金額  | D         | 168,113円       |
| 当ファンドの分配対象収益額                                     | E=A+B+C+D | 133,579,843円   | 当ファンドの分配対象収益額                                     | E=A+B+C+D | 112,814,162円   |
| 当ファンドの期末残存口数                                      | F         | 2,732,435,266口 | 当ファンドの期末残存口数                                      | F         | 2,413,727,920口 |

| 前期<br>自 2023年 7月27日<br>至 2024年 1月26日 |                |                | 当期<br>自 2024年 1月27日<br>至 2024年 7月26日 |                |                |
|--------------------------------------|----------------|----------------|--------------------------------------|----------------|----------------|
| 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 488円           | 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 467円           |
| 1万口当たり分配金額                           | H              | 30円            | 1万口当たり分配金額                           | H              | 15円            |
| 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 8,197,305円     | 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 3,620,591円     |
| 第59期<br>2023年10月27日<br>2024年 1月26日   |                |                | 第61期<br>2024年 4月27日<br>2024年 7月26日   |                |                |
| 項目                                   |                |                | 項目                                   |                |                |
| 費用控除後の配当等収益額                         | A              | 3,984,777円     | 費用控除後の配当等収益額                         | A              | 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            | B              | 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              | 116,219,278円   | 収益調整金額                               | C              | 105,836,297円   |
| 分配準備積立金額                             | D              | 円              | 分配準備積立金額                             | D              | 円              |
| 当ファンドの分配対象収益額                        | $E=A+B+C+D$    | 120,204,055円   | 当ファンドの分配対象収益額                        | $E=A+B+C+D$    | 107,620,341円   |
| 当ファンドの期末残存口数                         | F              | 2,532,245,001口 | 当ファンドの期末残存口数                         | F              | 2,339,293,289口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 474円           | 1万口当たり収益分配対象額                        | $G=E/F*10,000$ | 460円           |
| 1万口当たり分配金額                           | H              | 15円            | 1万口当たり分配金額                           | H              | 15円            |
| 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 3,798,367円     | 収益分配金金額                              | $I=F*H/10,000$ | 3,508,939円     |

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                      | 前期<br>自 2023年 7月27日<br>至 2024年 1月26日   | 当期<br>自 2024年 1月27日<br>至 2024年 7月26日 |
|-------------------------|--|--------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                   |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。  | 同左                                   |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 | 同左                                   |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 前期<br>[ 2024年 1月26日現在 ]  | 当期<br>[ 2024年 7月26日現在 ]                                     |
|---------------------------|--|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。   | 同左  |
| 2.時価の算定方法                 | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | (1) 有価証券<br>同左<br>(2) デリバティブ取引<br>同左<br>(3) 上記以外の金融商品<br>同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左  |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 前期<br>[ 2024年 1月26日現在 ]   | 当期<br>[ 2024年 7月26日現在 ]   |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 33,264,239                | 19,306,920                |
| 合計        | 33,264,239                | 19,306,920                |

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

|              | 前期<br>[ 2024年 1月26日現在 ] | 当期<br>[ 2024年 7月26日現在 ] |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.9201円                 | 0.8938円                 |
| (1万口当たり純資産額) | (9,201円)                | (8,938円)                |

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類        | 銘柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|-----------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド | 1,679,579,109 | 2,090,740,074 |    |
| 合計        |                   | 1,679,579,109 | 2,090,740,074 |    |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[ 2024年 7月26日現在 ]

| 資産の部    |                 |
|---------|-----------------|
| 流動資産    |                 |
| コール・ローン | 5,663,968,144   |
| 国債証券    | 800,586,951,440 |
| 地方債証券   | 49,697,647,040  |
| 特殊債証券   | 39,499,997,602  |
| 社債券     | 59,009,483,000  |
| 未収入金    | 3,035,924,000   |

[ 2024年 7月26日現在 ]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 未収利息        | 1,642,465,948   |
| 前払金         | 15,760,000      |
| 前払費用        | 100,328,008     |
| 差入委託証拠金     | 34,226,646      |
| 流動資産合計      | 959,286,751,828 |
| 資産合計        | 959,286,751,828 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 13,941,505      |
| 未払金         | 1,290,557,000   |
| 未払解約金       | 1,351,380,419   |
| 流動負債合計      | 2,655,878,924   |
| 負債合計        | 2,655,878,924   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 768,502,608,869 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 188,128,264,035 |
| 元本等合計       | 956,630,872,904 |
| 純資産合計       | 956,630,872,904 |
| 負債純資産合計     | 959,286,751,828 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |   |
|-----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。                       |

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

|                                  | [2024年 7月26日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 2024年 1月27日      |
| 期首元本額                            | 608,533,464,538円 |
| 期中追加設定元本額                        | 200,687,788,854円 |
| 期中一部解約元本額                        | 40,718,644,523円  |
| 元本の内訳                            |                  |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）           | 8,112,589,418円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）         | 12,843,684,803円  |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）           | 3,616,867,627円   |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）      | 59,660,204,015円  |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）    | 115,190,396,348円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）      | 39,611,166,477円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）        | 223,700,644円     |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）           | 212,210,476円     |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド             | 1,679,579,109円   |
| eMAXIS 国内債券インデックス                | 6,148,661,704円   |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 4,947,233,289円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 94,565,296円      |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 20,058,461,598円  |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）     | 42,913,042,699円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 12,211,995,410円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 6,100,528,283円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 2,872,206,485円   |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス           | 19,022,703,775円  |

|  | [2024年 7月26日現在]  |
|--|------------------|
| 国内債券セレクション(ラップ向け)                              | 5,608,998,231円   |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)                       | 27,323,106,124円  |
| つみたて8資産均等バランス                                  | 13,736,620,772円  |
| つみたて4資産均等バランス                                  | 5,479,716,370円   |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                          | 22,316,531円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                          | 16,384,194円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                          | 541,682円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)               | 7,218,991,651円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)               | 3,365,316,628円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)               | 1,368,669,715円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式15)                           | 7,835,672,623円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40)                           | 8,232,779,300円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65)                           | 5,599,049,335円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)               | 1,064,248,025円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式25)                           | 1,471,915,639円   |
| 国内債券インデックスファンド(ラップ向け)                          | 934,440,964円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)               | 524,387,742円     |
| ラップ向けインデックスf 国内債券                              | 6,812,013,292円   |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)                      | 2,344,764,362円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式80)                           | 14,595,052円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070(確定拠出年金)               | 8,917,049円       |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス(為替リスク軽減型)コンサバティブコース | 6,027,635円       |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)                         | 56,719,654円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)                       | 91,833,237円      |
| eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)                          | 78,063,593円      |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)                            | 2,245,105,987円   |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)                      | 2,265,951,217円   |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)                      | 1,346,683,181円   |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)                     | 2,542,521,377円   |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)                        | 159,100,660円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)                       | 68,125,914円      |
| 三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)                    | 5,572,978,877円   |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)                  | 28,850,401円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)                  | 9,202,447,087円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)                | 609,779,981円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)                | 4,674,595,732円   |
| MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)                 | 183,461,651,089円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)                | 475,934,550円     |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)                  | 1,673,192円       |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)                | 320,173円         |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)                  | 4,452,127,567円   |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)                  | 2,486,108,246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)          | 2,373,014,600円   |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)                     | 659,139,418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)               | 31,261,308,084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)            | 1,680,407,460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       |
| 日本債券インデックスファンドS                                | 6,103,935,191円   |
| グローバルバランスオープンV(適格機関投資家限定)                      | 12,971,101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)                     | 9,088,555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  |

|   | [2024年 7月26日現在]  |
|---|------------------|
| 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) | 554,334,205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) | 546,840,063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) | 547,010,780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) | 543,756,712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) | 546,757,835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) | 548,694,334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) | 539,198,394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) | 536,900,992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) | 545,804,051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) | 559,816,343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) | 587,761,901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) | 606,830,601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) | 622,785,795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) | 627,454,324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) | 628,202,232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) | 628,183,105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) | 628,165,479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) | 628,207,051円     |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA              | 19,691,951円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA            | 23,549,907円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA              | 3,620,358円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA              | 10,249,957円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)              | 19,156,054円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)              | 50,128,541円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)              | 9,801,149円       |
| 三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)              | 32,954,991円      |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド                | 4,230,893,174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)     | 2,323,320,110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)   | 4,942,244,229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)     | 3,173,006,368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)     | 2,302,165,879円   |
| 合計                                      | 768,502,608,869円 |
| 2. 受益権の総数                               | 768,502,608,869口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

| 区分             | 自 2024年 1月27日<br>至 2024年 7月26日  |
|----------------|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |

|                          |   |
|--------------------------|---|
| 区分                       | 自 2024年 1月27日<br>至 2024年 7月26日  |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。  |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 区分                         | [ 2024年 7月26日現在 ]  |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法                 | ( 1 ) 有価証券<br>売買目的有価証券は、( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ) に記載しております。<br>( 2 ) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、( デリバティブ取引に関する注記 ) に記載しております。<br>( 3 ) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品( コールローン等 ) は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   |

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

|       |                      |
|-------|----------------------|
| 種類    | [ 2024年 7月26日現在 ]    |
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額( 円 ) |
| 国債証券  | 7,766,065,680        |
| 地方債証券 | 145,012,438          |
| 特殊債券  | 192,388,969          |
| 社債券   | 120,805,000          |
| 合計    | 8,224,272,087        |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

## 取引の時価等に関する事項

## 債券関連

[ 2024年 7月26日現在 ]

| 区分   | 種類     | 契約額等( 円 )     | 時価( 円 )       | 評価損益( 円 )  |
|------|--------|---------------|---------------|------------|
|      |        |               | うち1年超         |            |
| 市場取引 | 債券先物取引 | 3,298,780,000 | 3,284,860,000 | 13,920,000 |
|      | 買建     |               |               |            |
| 合計   |        | 3,298,780,000 | 3,284,860,000 | 13,920,000 |

## ( 注 ) 時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。



（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

|              |  | [ 2024年 7月26日現在 ] |
|--------------|--|-------------------|
| 1口当たり純資産額    |  | 1,2448円           |
| (1万口当たり純資産額) |  | (12,448円)         |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種 類           | 銘 柄           | 券面総額           | 評価額            | 備考 |
|---------------|---------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券          | 第451回利付国債（2年） | 5,800,000,000  | 5,789,444,000  |    |
|               | 第452回利付国債（2年） | 3,100,000,000  | 3,093,397,000  |    |
|               | 第453回利付国債（2年） | 4,600,000,000  | 4,588,638,000  |    |
|               | 第454回利付国債（2年） | 3,550,000,000  | 3,543,965,000  |    |
|               | 第455回利付国債（2年） | 1,550,000,000  | 1,544,807,500  |    |
|               | 第456回利付国債（2年） | 4,100,000,000  | 4,089,504,000  |    |
|               | 第457回利付国債（2年） | 5,710,000,000  | 5,692,356,100  |    |
|               | 第458回利付国債（2年） | 6,400,000,000  | 6,387,328,000  |    |
|               | 第460回利付国債（2年） | 6,700,000,000  | 6,692,965,000  |    |
|               | 第461回利付国債（2年） | 1,600,000,000  | 1,600,720,000  |    |
|               | 第145回利付国債（5年） | 6,410,000,000  | 6,401,154,200  |    |
|               | 第146回利付国債（5年） | 4,450,000,000  | 4,440,388,000  |    |
|               | 第147回利付国債（5年） | 5,830,000,000  | 5,800,441,900  |    |
|               | 第148回利付国債（5年） | 7,200,000,000  | 7,149,240,000  |    |
|               | 第149回利付国債（5年） | 12,670,000,000 | 12,564,839,000 |    |
|               | 第150回利付国債（5年） | 7,430,000,000  | 7,358,597,700  |    |
|               | 第151回利付国債（5年） | 50,000,000     | 49,457,500     |    |
|               | 第152回利付国債（5年） | 6,180,000,000  | 6,128,335,200  |    |
|               | 第153回利付国債（5年） | 7,220,000,000  | 7,131,266,200  |    |
|               | 第154回利付国債（5年） | 4,930,000,000  | 4,875,720,700  |    |
|               | 第155回利付国債（5年） | 2,850,000,000  | 2,833,327,500  |    |
|               | 第156回利付国債（5年） | 8,050,000,000  | 7,976,020,500  |    |
|               | 第157回利付国債（5年） | 2,020,000,000  | 1,998,325,400  |    |
|               | 第158回利付国債（5年） | 9,040,000,000  | 8,910,637,600  |    |
|               | 第159回利付国債（5年） | 1,980,000,000  | 1,947,884,400  |    |
|               | 第160回利付国債（5年） | 2,850,000,000  | 2,814,660,000  |    |
|               | 第161回利付国債（5年） | 4,720,000,000  | 4,679,455,200  |    |
|               | 第162回利付国債（5年） | 190,000,000    | 188,073,400    |    |
|               | 第163回利付国債（5年） | 9,330,000,000  | 9,273,273,600  |    |
|               | 第164回利付国債（5年） | 1,900,000,000  | 1,869,448,000  |    |
| 第165回利付国債（5年） | 6,100,000,000 | 6,028,081,000  |                |    |

|                |                |                |  |
|----------------|----------------|----------------|--|
| 第166回利付国債(5年)  | 4,910,000,000  | 4,873,125,900  |  |
| 第167回利付国債(5年)  | 350,000,000    | 346,916,500    |  |
| 第168回利付国債(5年)  | 8,300,000,000  | 8,303,735,000  |  |
| 第169回利付国債(5年)  | 3,000,000,000  | 2,987,100,000  |  |
| 第1回利付国債(40年)   | 2,105,000,000  | 2,269,274,200  |  |
| 第2回利付国債(40年)   | 1,335,000,000  | 1,381,351,200  |  |
| 第3回利付国債(40年)   | 1,668,000,000  | 1,715,804,880  |  |
| 第4回利付国債(40年)   | 1,838,000,000  | 1,879,024,160  |  |
| 第5回利付国債(40年)   | 1,525,000,000  | 1,487,912,000  |  |
| 第6回利付国債(40年)   | 1,230,000,000  | 1,166,187,600  |  |
| 第7回利付国債(40年)   | 1,540,000,000  | 1,388,140,600  |  |
| 第8回利付国債(40年)   | 2,110,000,000  | 1,752,903,600  |  |
| 第9回利付国債(40年)   | 3,830,000,000  | 2,280,152,200  |  |
| 第10回利付国債(40年)  | 3,000,000,000  | 2,099,490,000  |  |
| 第11回利付国債(40年)  | 3,080,000,000  | 2,051,957,600  |  |
| 第12回利付国債(40年)  | 2,670,000,000  | 1,558,585,800  |  |
| 第13回利付国債(40年)  | 3,920,000,000  | 2,241,652,000  |  |
| 第14回利付国債(40年)  | 3,590,000,000  | 2,186,920,300  |  |
| 第15回利付国債(40年)  | 4,200,000,000  | 2,822,274,000  |  |
| 第16回利付国債(40年)  | 4,000,000,000  | 2,946,520,000  |  |
| 第17回利付国債(40年)  | 700,000,000    | 670,873,000    |  |
| 第340回利付国債(10年) | 3,470,000,000  | 3,476,905,300  |  |
| 第341回利付国債(10年) | 3,320,000,000  | 3,322,058,400  |  |
| 第342回利付国債(10年) | 2,570,000,000  | 2,560,953,600  |  |
| 第343回利付国債(10年) | 4,870,000,000  | 4,844,335,100  |  |
| 第344回利付国債(10年) | 4,620,000,000  | 4,590,986,400  |  |
| 第345回利付国債(10年) | 6,340,000,000  | 6,293,337,600  |  |
| 第346回利付国債(10年) | 6,130,000,000  | 6,078,753,200  |  |
| 第347回利付国債(10年) | 5,700,000,000  | 5,645,394,000  |  |
| 第348回利付国債(10年) | 4,970,000,000  | 4,915,280,300  |  |
| 第349回利付国債(10年) | 6,090,000,000  | 6,013,692,300  |  |
| 第350回利付国債(10年) | 6,530,000,000  | 6,436,555,700  |  |
| 第351回利付国債(10年) | 4,870,000,000  | 4,791,008,600  |  |
| 第352回利付国債(10年) | 4,110,000,000  | 4,036,677,600  |  |
| 第353回利付国債(10年) | 4,630,000,000  | 4,536,705,500  |  |
| 第354回利付国債(10年) | 6,320,000,000  | 6,178,684,800  |  |
| 第355回利付国債(10年) | 4,840,000,000  | 4,719,338,800  |  |
| 第356回利付国債(10年) | 9,580,000,000  | 9,324,597,200  |  |
| 第357回利付国債(10年) | 4,150,000,000  | 4,032,057,000  |  |
| 第358回利付国債(10年) | 9,240,000,000  | 8,958,549,600  |  |
| 第359回利付国債(10年) | 11,290,000,000 | 10,922,058,900 |  |
| 第360回利付国債(10年) | 6,640,000,000  | 6,405,209,600  |  |
| 第361回利付国債(10年) | 10,610,000,000 | 10,204,698,000 |  |

|                |                |                |  |
|----------------|----------------|----------------|--|
| 第362回利付国債(10年) | 7,440,000,000  | 7,134,067,200  |  |
| 第363回利付国債(10年) | 9,520,000,000  | 9,099,501,600  |  |
| 第364回利付国債(10年) | 6,840,000,000  | 6,516,331,200  |  |
| 第365回利付国債(10年) | 10,970,000,000 | 10,412,065,800 |  |
| 第366回利付国債(10年) | 7,210,000,000  | 6,873,725,600  |  |
| 第367回利付国債(10年) | 8,390,000,000  | 7,971,842,400  |  |
| 第368回利付国債(10年) | 10,130,000,000 | 9,591,793,100  |  |
| 第369回利付国債(10年) | 10,000,000,000 | 9,676,400,000  |  |
| 第370回利付国債(10年) | 9,860,000,000  | 9,513,223,800  |  |
| 第371回利付国債(10年) | 9,510,000,000  | 9,066,168,300  |  |
| 第372回利付国債(10年) | 8,570,000,000  | 8,440,507,300  |  |
| 第373回利付国債(10年) | 9,780,000,000  | 9,427,822,200  |  |
| 第374回利付国債(10年) | 3,150,000,000  | 3,083,724,000  |  |
| 第1回利付国債(30年)   | 196,000,000    | 217,520,800    |  |
| 第2回利付国債(30年)   | 268,000,000    | 293,658,320    |  |
| 第3回利付国債(30年)   | 307,000,000    | 335,630,820    |  |
| 第4回利付国債(30年)   | 252,000,000    | 286,118,280    |  |
| 第5回利付国債(30年)   | 238,000,000    | 260,859,900    |  |
| 第6回利付国債(30年)   | 339,000,000    | 377,510,400    |  |
| 第7回利付国債(30年)   | 339,000,000    | 376,228,980    |  |
| 第8回利付国債(30年)   | 302,000,000    | 323,910,100    |  |
| 第9回利付国債(30年)   | 206,000,000    | 214,289,440    |  |
| 第10回利付国債(30年)  | 398,000,000    | 403,894,380    |  |
| 第11回利付国債(30年)  | 237,000,000    | 252,196,440    |  |
| 第12回利付国債(30年)  | 325,000,000    | 357,048,250    |  |
| 第13回利付国債(30年)  | 595,000,000    | 648,044,250    |  |
| 第14回利付国債(30年)  | 683,000,000    | 768,771,140    |  |
| 第15回利付国債(30年)  | 686,000,000    | 778,980,440    |  |
| 第16回利付国債(30年)  | 547,000,000    | 621,424,820    |  |
| 第17回利付国債(30年)  | 577,000,000    | 649,996,270    |  |
| 第18回利付国債(30年)  | 687,000,000    | 766,987,410    |  |
| 第19回利付国債(30年)  | 593,000,000    | 662,220,890    |  |
| 第20回利付国債(30年)  | 655,000,000    | 744,924,950    |  |
| 第21回利付国債(30年)  | 529,000,000    | 590,284,650    |  |
| 第22回利付国債(30年)  | 1,975,000,000  | 2,245,259,000  |  |
| 第23回利付国債(30年)  | 194,000,000    | 220,591,580    |  |
| 第24回利付国債(30年)  | 981,000,000    | 1,114,994,790  |  |
| 第25回利付国債(30年)  | 1,287,000,000  | 1,432,791,360  |  |
| 第26回利付国債(30年)  | 1,014,000,000  | 1,140,668,880  |  |
| 第27回利付国債(30年)  | 760,000,000    | 862,866,000    |  |
| 第28回利付国債(30年)  | 2,926,000,000  | 3,321,273,340  |  |
| 第29回利付国債(30年)  | 1,630,000,000  | 1,826,757,300  |  |
| 第30回利付国債(30年)  | 1,721,000,000  | 1,903,408,790  |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| 第3 1 回利付国債(30年) | 2,223,000,000 | 2,422,514,250 |  |
| 第3 2 回利付国債(30年) | 1,989,000,000 | 2,190,585,150 |  |
| 第3 3 回利付国債(30年) | 1,227,000,000 | 1,295,785,620 |  |
| 第3 4 回利付国債(30年) | 2,231,000,000 | 2,411,666,380 |  |
| 第3 5 回利付国債(30年) | 3,179,000,000 | 3,332,132,430 |  |
| 第3 6 回利付国債(30年) | 2,579,000,000 | 2,693,120,750 |  |
| 第3 7 回利付国債(30年) | 2,717,000,000 | 2,786,555,200 |  |
| 第3 8 回利付国債(30年) | 1,590,000,000 | 1,598,919,900 |  |
| 第3 9 回利付国債(30年) | 1,360,000,000 | 1,386,003,200 |  |
| 第4 0 回利付国債(30年) | 1,720,000,000 | 1,722,442,400 |  |
| 第4 1 回利付国債(30年) | 1,210,000,000 | 1,188,328,900 |  |
| 第4 2 回利付国債(30年) | 1,820,000,000 | 1,783,236,000 |  |
| 第4 3 回利付国債(30年) | 2,020,000,000 | 1,975,923,600 |  |
| 第4 4 回利付国債(30年) | 2,230,000,000 | 2,176,100,900 |  |
| 第4 5 回利付国債(30年) | 2,190,000,000 | 2,058,205,800 |  |
| 第4 6 回利付国債(30年) | 2,530,000,000 | 2,371,166,600 |  |
| 第4 7 回利付国債(30年) | 2,890,000,000 | 2,752,089,200 |  |
| 第4 8 回利付国債(30年) | 2,570,000,000 | 2,351,318,700 |  |
| 第4 9 回利付国債(30年) | 2,510,000,000 | 2,289,496,500 |  |
| 第5 0 回利付国債(30年) | 2,810,000,000 | 2,258,059,800 |  |
| 第5 1 回利付国債(30年) | 2,760,000,000 | 1,963,353,600 |  |
| 第5 2 回利付国債(30年) | 2,990,000,000 | 2,223,154,700 |  |
| 第5 3 回利付国債(30年) | 2,490,000,000 | 1,886,623,200 |  |
| 第5 4 回利付国債(30年) | 2,240,000,000 | 1,771,392,000 |  |
| 第5 5 回利付国債(30年) | 2,760,000,000 | 2,173,334,400 |  |
| 第5 6 回利付国債(30年) | 2,310,000,000 | 1,811,247,900 |  |
| 第5 7 回利付国債(30年) | 2,340,000,000 | 1,826,955,000 |  |
| 第5 8 回利付国債(30年) | 2,140,000,000 | 1,663,700,200 |  |
| 第5 9 回利付国債(30年) | 2,410,000,000 | 1,819,622,300 |  |
| 第6 0 回利付国債(30年) | 2,100,000,000 | 1,659,042,000 |  |
| 第6 1 回利付国債(30年) | 1,940,000,000 | 1,451,527,400 |  |
| 第6 2 回利付国債(30年) | 2,070,000,000 | 1,461,006,000 |  |
| 第6 3 回利付国債(30年) | 2,620,000,000 | 1,789,486,200 |  |
| 第6 4 回利付国債(30年) | 2,330,000,000 | 1,581,860,300 |  |
| 第6 5 回利付国債(30年) | 2,360,000,000 | 1,593,873,200 |  |
| 第6 6 回利付国債(30年) | 1,760,000,000 | 1,181,558,400 |  |
| 第6 7 回利付国債(30年) | 2,640,000,000 | 1,867,694,400 |  |
| 第6 8 回利付国債(30年) | 2,940,000,000 | 2,068,231,200 |  |
| 第6 9 回利付国債(30年) | 2,670,000,000 | 1,922,560,200 |  |
| 第7 0 回利付国債(30年) | 2,340,000,000 | 1,677,195,000 |  |
| 第7 1 回利付国債(30年) | 2,760,000,000 | 1,968,984,000 |  |
| 第7 2 回利付国債(30年) | 2,510,000,000 | 1,782,250,600 |  |
| 第7 3 回利付国債(30年) | 2,910,000,000 | 2,058,330,300 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第74回利付国債(30年)  | 3,080,000,000 | 2,361,466,800 |  |
| 第75回利付国債(30年)  | 2,670,000,000 | 2,206,915,200 |  |
| 第76回利付国債(30年)  | 2,640,000,000 | 2,232,146,400 |  |
| 第77回利付国債(30年)  | 2,790,000,000 | 2,471,493,600 |  |
| 第78回利付国債(30年)  | 3,560,000,000 | 2,996,416,400 |  |
| 第79回利付国債(30年)  | 2,030,000,000 | 1,618,498,700 |  |
| 第80回利付国債(30年)  | 2,710,000,000 | 2,506,343,500 |  |
| 第81回利付国債(30年)  | 2,580,000,000 | 2,271,225,600 |  |
| 第82回利付国債(30年)  | 3,360,000,000 | 3,102,153,600 |  |
| 第81回利付国債(20年)  | 250,000,000   | 255,082,500   |  |
| 第82回利付国債(20年)  | 1,082,000,000 | 1,105,230,540 |  |
| 第83回利付国債(20年)  | 395,000,000   | 405,123,850   |  |
| 第84回利付国債(20年)  | 880,000,000   | 901,331,200   |  |
| 第85回利付国債(20年)  | 520,000,000   | 535,194,400   |  |
| 第86回利付国債(20年)  | 1,047,000,000 | 1,081,017,030 |  |
| 第87回利付国債(20年)  | 420,000,000   | 432,957,000   |  |
| 第88回利付国債(20年)  | 1,264,000,000 | 1,309,731,520 |  |
| 第89回利付国債(20年)  | 340,000,000   | 351,662,000   |  |
| 第90回利付国債(20年)  | 1,270,000,000 | 1,318,895,000 |  |
| 第91回利付国債(20年)  | 548,000,000   | 570,265,240   |  |
| 第92回利付国債(20年)  | 1,282,000,000 | 1,333,523,580 |  |
| 第93回利付国債(20年)  | 190,000,000   | 197,892,600   |  |
| 第94回利付国債(20年)  | 875,000,000   | 913,631,250   |  |
| 第95回利付国債(20年)  | 1,107,000,000 | 1,166,313,060 |  |
| 第96回利付国債(20年)  | 340,000,000   | 356,275,800   |  |
| 第97回利付国債(20年)  | 573,000,000   | 604,188,390   |  |
| 第98回利付国債(20年)  | 610,000,000   | 641,311,300   |  |
| 第99回利付国債(20年)  | 1,480,000,000 | 1,560,852,400 |  |
| 第100回利付国債(20年) | 1,030,000,000 | 1,093,200,800 |  |
| 第101回利付国債(20年) | 723,000,000   | 772,532,730   |  |
| 第102回利付国債(20年) | 520,000,000   | 557,512,800   |  |
| 第103回利付国債(20年) | 760,000,000   | 811,930,800   |  |
| 第104回利付国債(20年) | 610,000,000   | 647,020,900   |  |
| 第105回利付国債(20年) | 920,000,000   | 978,383,200   |  |
| 第106回利付国債(20年) | 571,000,000   | 609,553,920   |  |
| 第107回利付国債(20年) | 607,000,000   | 647,092,350   |  |
| 第108回利付国債(20年) | 1,000,000,000 | 1,057,470,000 |  |
| 第109回利付国債(20年) | 560,000,000   | 593,538,400   |  |
| 第110回利付国債(20年) | 876,000,000   | 936,382,680   |  |
| 第111回利付国債(20年) | 861,000,000   | 926,263,800   |  |
| 第112回利付国債(20年) | 1,050,000,000 | 1,124,592,000 |  |
| 第113回利付国債(20年) | 922,000,000   | 990,532,260   |  |
| 第114回利付国債(20年) | 1,600,000,000 | 1,724,048,000 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第115回利付国債(20年) | 944,000,000   | 1,022,116,000 |  |
| 第116回利付国債(20年) | 461,000,000   | 500,424,720   |  |
| 第117回利付国債(20年) | 1,320,000,000 | 1,425,692,400 |  |
| 第118回利付国債(20年) | 520,000,000   | 559,998,400   |  |
| 第119回利付国債(20年) | 400,000,000   | 426,228,000   |  |
| 第120回利付国債(20年) | 780,000,000   | 822,049,800   |  |
| 第121回利付国債(20年) | 1,299,000,000 | 1,393,294,410 |  |
| 第122回利付国債(20年) | 100,000,000   | 106,669,000   |  |
| 第123回利付国債(20年) | 1,318,000,000 | 1,432,244,240 |  |
| 第124回利付国債(20年) | 1,240,000,000 | 1,339,882,000 |  |
| 第125回利付国債(20年) | 1,844,000,000 | 2,018,884,960 |  |
| 第126回利付国債(20年) | 200,000,000   | 216,362,000   |  |
| 第127回利付国債(20年) | 440,000,000   | 473,206,800   |  |
| 第128回利付国債(20年) | 1,974,000,000 | 2,124,872,820 |  |
| 第129回利付国債(20年) | 280,000,000   | 299,563,600   |  |
| 第130回利付国債(20年) | 1,862,000,000 | 1,993,233,760 |  |
| 第131回利付国債(20年) | 420,000,000   | 446,754,000   |  |
| 第132回利付国債(20年) | 187,000,000   | 198,956,780   |  |
| 第133回利付国債(20年) | 2,320,000,000 | 2,484,557,600 |  |
| 第134回利付国債(20年) | 4,545,000,000 | 4,870,512,900 |  |
| 第135回利付国債(20年) | 50,000,000    | 53,221,000    |  |
| 第136回利付国債(20年) | 190,000,000   | 200,799,600   |  |
| 第137回利付国債(20年) | 4,342,000,000 | 4,621,798,480 |  |
| 第138回利付国債(20年) | 160,000,000   | 167,878,400   |  |
| 第139回利付国債(20年) | 310,000,000   | 327,558,400   |  |
| 第140回利付国債(20年) | 2,817,000,000 | 2,998,245,780 |  |
| 第141回利付国債(20年) | 1,120,000,000 | 1,192,251,200 |  |
| 第142回利付国債(20年) | 3,090,000,000 | 3,313,499,700 |  |
| 第143回利付国債(20年) | 1,740,000,000 | 1,837,648,800 |  |
| 第144回利付国債(20年) | 1,520,000,000 | 1,592,473,600 |  |
| 第145回利付国債(20年) | 3,100,000,000 | 3,298,772,000 |  |
| 第146回利付国債(20年) | 3,420,000,000 | 3,637,341,000 |  |
| 第147回利付国債(20年) | 3,450,000,000 | 3,633,988,500 |  |
| 第148回利付国債(20年) | 3,360,000,000 | 3,504,614,400 |  |
| 第149回利付国債(20年) | 3,780,000,000 | 3,937,739,400 |  |
| 第150回利付国債(20年) | 5,050,000,000 | 5,204,883,500 |  |
| 第151回利付国債(20年) | 5,380,000,000 | 5,427,613,000 |  |
| 第152回利付国債(20年) | 4,140,000,000 | 4,167,489,600 |  |
| 第153回利付国債(20年) | 4,540,000,000 | 4,605,920,800 |  |
| 第154回利付国債(20年) | 4,760,000,000 | 4,769,329,600 |  |
| 第155回利付国債(20年) | 4,720,000,000 | 4,616,112,800 |  |
| 第156回利付国債(20年) | 3,100,000,000 | 2,820,752,000 |  |
| 第157回利付国債(20年) | 4,980,000,000 | 4,399,830,000 |  |

|                  |                 |                 |  |
|------------------|-----------------|-----------------|--|
| 第158回利付国債(20年)   | 4,010,000,000   | 3,658,122,500   |  |
| 第159回利付国債(20年)   | 4,350,000,000   | 3,999,303,000   |  |
| 第160回利付国債(20年)   | 4,430,000,000   | 4,107,939,000   |  |
| 第161回利付国債(20年)   | 3,970,000,000   | 3,619,171,100   |  |
| 第162回利付国債(20年)   | 5,130,000,000   | 4,656,244,500   |  |
| 第163回利付国債(20年)   | 3,900,000,000   | 3,524,196,000   |  |
| 第164回利付国債(20年)   | 3,890,000,000   | 3,451,441,400   |  |
| 第165回利付国債(20年)   | 3,810,000,000   | 3,364,191,900   |  |
| 第166回利付国債(20年)   | 4,660,000,000   | 4,212,640,000   |  |
| 第167回利付国債(20年)   | 3,710,000,000   | 3,241,983,500   |  |
| 第168回利付国債(20年)   | 4,300,000,000   | 3,683,509,000   |  |
| 第169回利付国債(20年)   | 3,940,000,000   | 3,304,084,000   |  |
| 第170回利付国債(20年)   | 3,720,000,000   | 3,102,070,800   |  |
| 第171回利付国債(20年)   | 3,070,000,000   | 2,545,582,600   |  |
| 第172回利付国債(20年)   | 4,090,000,000   | 3,428,769,700   |  |
| 第173回利付国債(20年)   | 3,550,000,000   | 2,959,564,000   |  |
| 第174回利付国債(20年)   | 6,120,000,000   | 5,073,541,200   |  |
| 第175回利付国債(20年)   | 3,620,000,000   | 3,035,768,200   |  |
| 第176回利付国債(20年)   | 4,500,000,000   | 3,753,270,000   |  |
| 第177回利付国債(20年)   | 3,790,000,000   | 3,088,622,600   |  |
| 第178回利付国債(20年)   | 4,170,000,000   | 3,441,709,500   |  |
| 第179回利付国債(20年)   | 3,980,000,000   | 3,266,465,600   |  |
| 第180回利付国債(20年)   | 4,280,000,000   | 3,689,616,800   |  |
| 第181回利付国債(20年)   | 3,800,000,000   | 3,319,148,000   |  |
| 第182回利付国債(20年)   | 4,160,000,000   | 3,748,867,200   |  |
| 第183回利付国債(20年)   | 3,820,000,000   | 3,608,830,400   |  |
| 第184回利付国債(20年)   | 4,190,000,000   | 3,749,212,000   |  |
| 第185回利付国債(20年)   | 4,990,000,000   | 4,447,337,500   |  |
| 第186回利付国債(20年)   | 4,060,000,000   | 3,867,271,800   |  |
| 第187回利付国債(20年)   | 3,270,000,000   | 2,998,295,700   |  |
| 第188回利付国債(20年)   | 2,580,000,000   | 2,485,288,200   |  |
| 第1回大韓民国          | 100,000,000     | 99,899,000      |  |
| 第2回大韓民国          | 100,000,000     | 100,128,000     |  |
| 国債証券 合計          | 847,239,000,000 | 800,586,951,440 |  |
| 地方債証券            |                 |                 |  |
| 第7回東京都公募公債(20年)  | 100,000,000     | 102,138,000     |  |
| 第7回東京都公募公債(30年)  | 80,000,000      | 89,664,000      |  |
| 第10回東京都公募公債(30年) | 100,000,000     | 109,006,000     |  |
| 第12回東京都公募公債(20年) | 100,000,000     | 105,572,000     |  |
| 第20回東京都公募公債(20年) | 80,000,000      | 85,616,000      |  |
| 第21回東京都公募公債(20年) | 80,000,000      | 86,249,600      |  |
| 第28回東京都公募公債(20年) | 100,000,000     | 104,895,000     |  |
| 第33回東京都公募公債(20年) | 100,000,000     | 87,285,000      |  |
| 第747回東京都公募公債     | 500,000,000     | 501,030,000     |  |

|                      |             |             |  |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 第750回東京都公募公債         | 200,000,000 | 200,316,000 |  |
| 第751回東京都公募公債         | 500,000,000 | 500,275,000 |  |
| 第757回東京都公募公債         | 150,000,000 | 148,827,000 |  |
| 第758回東京都公募公債         | 150,000,000 | 148,827,000 |  |
| 第782回東京都公募公債         | 100,000,000 | 98,608,000  |  |
| 第783回東京都公募公債         | 400,000,000 | 394,280,000 |  |
| 第807回東京都公募公債         | 200,000,000 | 192,654,000 |  |
| 第809回東京都公募公債         | 100,000,000 | 96,065,000  |  |
| 第853回東京都公募公債         | 300,000,000 | 299,022,000 |  |
| 平成30年度第14回北海道公募公債    | 100,000,000 | 98,044,000  |  |
| 令和3年度第14回北海道公募公債（5年） | 400,000,000 | 395,116,000 |  |
| 第32回1号宮城県公募公債        | 200,000,000 | 198,576,000 |  |
| 第36回2号宮城県公募公債        | 342,000,000 | 328,733,820 |  |
| 第2回神奈川県公募公債（30年）     | 180,000,000 | 209,946,600 |  |
| 第4回神奈川県公募公債（30年）     | 100,000,000 | 113,618,000 |  |
| 第19回神奈川県公募公債（20年）    | 100,000,000 | 106,737,000 |  |
| 第20回神奈川県公募公債（20年）    | 500,000,000 | 529,470,000 |  |
| 第27回神奈川県公募公債（20年）    | 100,000,000 | 102,158,000 |  |
| 第96回神奈川県公募公債（5年）     | 300,000,000 | 299,388,000 |  |
| 第226回神奈川県公募公債        | 100,000,000 | 99,229,000  |  |
| 第234回神奈川県公募公債        | 400,000,000 | 394,796,000 |  |
| 第243回神奈川県公募公債        | 100,000,000 | 96,646,000  |  |
| 第256回神奈川県公募公債        | 350,000,000 | 333,585,000 |  |
| 第263回神奈川県公募公債        | 400,000,000 | 401,440,000 |  |
| 第7回大阪府公募公債（20年）      | 220,000,000 | 234,861,000 |  |
| 第11回大阪府公募公債（20年）     | 100,000,000 | 105,505,000 |  |
| 第179回大阪府公募公債（5年）     | 100,000,000 | 99,448,000  |  |
| 第184回大阪府公募公債（5年）     | 120,000,000 | 118,958,400 |  |
| 第186回大阪府公募公債（5年）     | 300,000,000 | 297,093,000 |  |
| 第191回大阪府公募公債（5年）     | 160,000,000 | 158,046,400 |  |
| 第400回大阪府公募公債         | 136,000,000 | 136,352,240 |  |
| 第407回大阪府公募公債         | 200,000,000 | 198,848,000 |  |
| 第410回大阪府公募公債         | 200,000,000 | 198,166,000 |  |
| 第415回大阪府公募公債         | 100,000,000 | 99,167,000  |  |
| 第417回大阪府公募公債         | 300,000,000 | 298,092,000 |  |
| 第418回大阪府公募公債         | 800,000,000 | 794,080,000 |  |
| 第420回大阪府公募公債         | 100,000,000 | 99,048,000  |  |
| 第426回大阪府公募公債         | 100,000,000 | 98,758,000  |  |
| 第435回大阪府公募公債         | 130,000,000 | 127,869,300 |  |
| 第439回大阪府公募公債         | 100,000,000 | 98,036,000  |  |
| 第455回大阪府公募公債         | 148,000,000 | 142,827,400 |  |
| 第460回大阪府公募公債         | 194,000,000 | 186,292,380 |  |
| 第464回大阪府公募公債         | 800,000,000 | 762,760,000 |  |



|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第465回大阪府公募公債           | 500,000,000 | 477,825,000 |  |
| 第467回大阪府公募公債           | 200,000,000 | 191,296,000 |  |
| 第471回大阪府公募公債           | 97,000,000  | 91,828,930  |  |
| 第483回大阪府公募公債           | 200,000,000 | 196,838,000 |  |
| 平成26年度第2回京都府公募公債（15年）  | 200,000,000 | 203,732,000 |  |
| 平成26年度第5回京都府公募公債（20年）  | 100,000,000 | 102,770,000 |  |
| 令和6年度第1回京都府公募公債（5年）    | 200,000,000 | 198,268,000 |  |
| 第1回兵庫県公募公債（15年）        | 400,000,000 | 409,492,000 |  |
| 第2回兵庫県公募公債（20年）        | 300,000,000 | 317,175,000 |  |
| 第2回兵庫県公募公債（30年）        | 90,000,000  | 98,462,700  |  |
| 第4回兵庫県公募公債（12年）        | 300,000,000 | 301,611,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債（12年）        | 400,000,000 | 401,996,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債（15年）        | 200,000,000 | 205,434,000 |  |
| 第6回兵庫県公募公債（15年）        | 100,000,000 | 102,926,000 |  |
| 第9回兵庫県公募公債（15年）        | 800,000,000 | 812,248,000 |  |
| 第9回兵庫県公募公債（20年）        | 200,000,000 | 215,948,000 |  |
| 第27回兵庫県公募公債（20年）       | 200,000,000 | 179,484,000 |  |
| 平成28年度第29回兵庫県公募公債      | 100,000,000 | 99,342,000  |  |
| 令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）  | 100,000,000 | 96,868,000  |  |
| 令和5年度第5回兵庫県公募公債        | 100,000,000 | 97,868,000  |  |
| 令和6年度第1回兵庫県公募公債（5年）    | 100,000,000 | 99,357,000  |  |
| 令和6年度第2回兵庫県公募公債        | 200,000,000 | 196,640,000 |  |
| 令和6年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）  | 300,000,000 | 300,174,000 |  |
| 第1回静岡県公募公債（15年）        | 100,000,000 | 102,702,000 |  |
| 第6回静岡県公募公債（15年）        | 300,000,000 | 305,364,000 |  |
| 第11回静岡県公募公債（20年）       | 550,000,000 | 585,700,500 |  |
| 第14回静岡県公募公債（20年）       | 100,000,000 | 106,154,000 |  |
| 平成27年度第10回静岡県公募公債      | 400,000,000 | 400,760,000 |  |
| 令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）   | 120,000,000 | 119,251,200 |  |
| 令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）   | 120,000,000 | 119,251,200 |  |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）  | 200,000,000 | 212,170,000 |  |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）  | 700,000,000 | 753,445,000 |  |
| 平成23年度第13回愛知県公募公債      | 500,000,000 | 512,045,000 |  |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債（15年） | 300,000,000 | 307,764,000 |  |
| 平成27年度第16回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 100,175,000 |  |
| 平成29年度第5回愛知県公募公債       | 600,000,000 | 594,720,000 |  |
| 平成30年度第5回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 98,465,000  |  |
| 平成30年度第8回愛知県公募公債       | 200,000,000 | 197,238,000 |  |
| 令和3年度第18回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 95,298,000  |  |
| 令和5年度第8回愛知県公募公債        | 100,000,000 | 97,592,000  |  |
| 令和6年度第1回愛知県公募公債（5年）    | 100,000,000 | 99,114,000  |  |
| 平成23年度第1回広島県公募公債（20年）  | 100,000,000 | 106,750,000 |  |
| 平成28年度第1回広島県公募公債       | 100,000,000 | 99,363,000  |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成28年度第4回広島県公募公債          | 100,000,000 | 99,040,000  |  |
| 平成28年度第1回広島県公募公債（20年）     | 100,000,000 | 89,326,000  |  |
| 平成30年度第4回広島県公募公債          | 200,000,000 | 196,916,000 |  |
| 令和3年度第7回広島県公募公債           | 100,000,000 | 95,089,000  |  |
| 第2回埼玉県公募公債（サステナビリティ）      | 100,000,000 | 97,771,000  |  |
| 第3回埼玉県公募公債                | 200,000,000 | 196,802,000 |  |
| 第4回埼玉県公募公債                | 200,000,000 | 197,710,000 |  |
| 第9回埼玉県公募公債（20年）           | 200,000,000 | 216,114,000 |  |
| 第10回埼玉県公募公債（20年）          | 100,000,000 | 107,153,000 |  |
| 第14回埼玉県公募公債（20年）          | 200,000,000 | 207,976,000 |  |
| 第16回埼玉県公募公債（20年）          | 100,000,000 | 99,479,000  |  |
| 平成29年度第1回埼玉県公募公債          | 100,000,000 | 99,218,000  |  |
| 平成29年度第3回埼玉県公募公債          | 200,000,000 | 198,186,000 |  |
| 平成30年度第4回埼玉県公募公債          | 200,000,000 | 197,012,000 |  |
| 令和2年度第1回埼玉県公募公債           | 100,000,000 | 96,658,000  |  |
| 令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）       | 110,000,000 | 109,255,300 |  |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）     | 70,000,000  | 79,643,200  |  |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）     | 80,000,000  | 87,309,600  |  |
| 平成21年度第2回福岡県公募公債（20年）     | 200,000,000 | 216,484,000 |  |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債（20年）     | 800,000,000 | 867,096,000 |  |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）     | 800,000,000 | 818,792,000 |  |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債          | 100,000,000 | 100,189,000 |  |
| 令和2年度第4回福岡県公募公債           | 200,000,000 | 192,542,000 |  |
| 令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン）     | 100,000,000 | 97,167,000  |  |
| 令和5年度第3回福岡県公募公債           | 100,000,000 | 96,913,000  |  |
| 令和6年度第1回福岡県公募公債（グリーン）     | 300,000,000 | 296,664,000 |  |
| 令和6年度第3回福岡県公募公債           | 100,000,000 | 99,657,000  |  |
| 令和6年度第4回福岡県公募公債           | 100,000,000 | 100,416,000 |  |
| 第9回千葉県公募公債（20年）           | 80,000,000  | 85,198,400  |  |
| 第13回千葉県公募公債（20年）          | 300,000,000 | 317,643,000 |  |
| 第14回千葉県公募公債（20年）          | 100,000,000 | 101,093,000 |  |
| 平成27年度第6回千葉県公募公債          | 500,000,000 | 500,980,000 |  |
| 平成27年度第9回千葉県公募公債          | 200,000,000 | 199,020,000 |  |
| 平成28年度第3回千葉県公募公債          | 400,000,000 | 396,820,000 |  |
| 平成30年度第6回千葉県公募公債          | 100,000,000 | 97,798,000  |  |
| 令和元年度第6回千葉県公募公債           | 100,000,000 | 96,879,000  |  |
| 令和5年度第7回千葉県公募公債（サステナビリティ） | 100,000,000 | 97,383,000  |  |
| 令和5年度第8回千葉県公募公債           | 100,000,000 | 98,399,000  |  |
| 令和6年度第1回千葉県公募公債           | 300,000,000 | 293,292,000 |  |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債          | 100,000,000 | 99,728,000  |  |
| 令和4年度第1回長野県公募公債           | 300,000,000 | 286,248,000 |  |
| 令和5年度第2回長野県公募公債           | 100,000,000 | 97,549,000  |  |
| 令和6年度第1回長野県公募公債           | 200,000,000 | 198,556,000 |  |

|                      |             |             |  |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 第2回群馬県公募公債（20年）      | 100,000,000 | 107,993,000 |  |
| 第7回群馬県公募公債（20年）      | 100,000,000 | 88,743,000  |  |
| 第24回群馬県公募公債          | 200,000,000 | 189,522,000 |  |
| 第30回群馬県公募公債          | 300,000,000 | 298,968,000 |  |
| 平成27年度第1回岐阜県公募公債     | 300,000,000 | 300,759,000 |  |
| 令和2年度第2回岐阜県公募公債（5年）  | 100,000,000 | 99,599,000  |  |
| 平成27年度第1回大分県公募公債     | 203,400,000 | 203,816,970 |  |
| 第2回共同発行市場公募地方債（グリーン） | 200,000,000 | 196,136,000 |  |
| 第150回共同発行市場公募地方債     | 200,000,000 | 200,500,000 |  |
| 第151回共同発行市場公募地方債     | 200,000,000 | 200,392,000 |  |
| 第152回共同発行市場公募地方債     | 700,000,000 | 701,617,000 |  |
| 第153回共同発行市場公募地方債     | 200,000,000 | 200,378,000 |  |
| 第157回共同発行市場公募地方債     | 500,000,000 | 497,135,000 |  |
| 第158回共同発行市場公募地方債     | 200,000,000 | 198,726,000 |  |
| 第159回共同発行市場公募地方債     | 500,000,000 | 496,435,000 |  |
| 第172回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 99,160,000  |  |
| 第173回共同発行市場公募地方債     | 400,000,000 | 396,296,000 |  |
| 第185回共同発行市場公募地方債     | 300,000,000 | 295,755,000 |  |
| 第193回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 97,328,000  |  |
| 第198回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 96,710,000  |  |
| 第205回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 96,665,000  |  |
| 第206回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 96,571,000  |  |
| 第207回共同発行市場公募地方債     | 100,000,000 | 96,602,000  |  |
| 第232回共同発行市場公募地方債     | 450,000,000 | 430,236,000 |  |
| 令和元年度第3回堺市公募公債       | 100,000,000 | 96,830,000  |  |
| 平成27年度第1回長崎県公募公債     | 300,000,000 | 300,759,000 |  |
| 平成27年度第1回佐賀県公募公債     | 500,000,000 | 501,030,000 |  |
| 平成29年度第1回佐賀県公募公債     | 100,000,000 | 98,848,000  |  |
| 令和3年度第1回佐賀県公募公債      | 100,000,000 | 94,725,000  |  |
| 平成30年度第1回福島県公募公債     | 100,000,000 | 98,451,000  |  |
| 第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ） | 100,000,000 | 97,780,000  |  |
| 令和元年度第2回栃木県公募公債      | 100,000,000 | 96,757,000  |  |
| 令和2年度第2回栃木県公募公債      | 100,000,000 | 96,013,000  |  |
| 令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）  | 200,000,000 | 198,216,000 |  |
| 令和5年度第2回奈良県公募公債      | 200,000,000 | 195,378,000 |  |
| 令和6年度第1回奈良県公募公債（5年）  | 100,000,000 | 99,612,000  |  |
| 第5回大阪市公募公債（20年）      | 100,000,000 | 107,670,000 |  |
| 第15回大阪市公募公債（20年）     | 100,000,000 | 108,350,000 |  |
| 令和2年度第3回大阪市公募公債（5年）  | 500,000,000 | 498,485,000 |  |
| 令和6年度第1回大阪市公募公債（5年）  | 600,000,000 | 597,030,000 |  |
| 令和6年度第2回大阪市公募公債      | 200,000,000 | 197,622,000 |  |
| 第1回名古屋市公募公債（30年）     | 100,000,000 | 112,974,000 |  |
| 第9回名古屋市公募公債（20年）     | 100,000,000 | 106,237,000 |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第9回名古屋市公募公債(30年)          | 90,000,000  | 93,482,100  |  |
| 第28回名古屋市公募公債(5年)          | 500,000,000 | 497,765,000 |  |
| 第33回名古屋市公募公債(5年)          | 300,000,000 | 298,587,000 |  |
| 第511回名古屋市公募公債             | 100,000,000 | 96,382,000  |  |
| 第1回京都市公募公債(15年)           | 100,000,000 | 99,970,000  |  |
| 第3回京都市公募公債(20年)           | 100,000,000 | 102,452,000 |  |
| 第5回京都市公募公債(20年)           | 50,000,000  | 52,239,000  |  |
| 令和5年度第7回京都市公募公債(5年)       | 100,000,000 | 99,192,000  |  |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)     | 110,000,000 | 114,359,300 |  |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)    | 200,000,000 | 212,560,000 |  |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債          | 100,000,000 | 106,777,000 |  |
| 平成23年度第4回神戸市公募公債(20年)     | 150,000,000 | 160,977,000 |  |
| 令和6年度第1回神戸市公募公債(5年)       | 300,000,000 | 297,330,000 |  |
| 第7回横浜市公募公債(20年)           | 450,000,000 | 460,845,000 |  |
| 第19回横浜市公募公債(20年)          | 200,000,000 | 215,030,000 |  |
| 平成27年度第3回横浜市公募公債          | 400,000,000 | 401,048,000 |  |
| 平成27年度第4回横浜市公募公債          | 300,000,000 | 300,672,000 |  |
| 第27回横浜市公募公債(20年)          | 100,000,000 | 104,931,000 |  |
| 第33回横浜市公募公債(20年)          | 100,000,000 | 89,125,000  |  |
| 第35回横浜市公募公債(20年)          | 500,000,000 | 447,585,000 |  |
| 第54回横浜市公募公債(5年)           | 300,000,000 | 298,797,000 |  |
| 第64回横浜市公募公債(5年)           | 800,000,000 | 792,912,000 |  |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)     | 80,000,000  | 86,357,600  |  |
| 平成23年度第3回札幌市公募公債          | 100,000,000 | 107,496,000 |  |
| 平成23年度第9回札幌市公募公債          | 600,000,000 | 615,276,000 |  |
| 令和2年度第7回札幌市公募公債           | 200,000,000 | 191,644,000 |  |
| 令和3年度第2回札幌市公募公債(5年)       | 100,000,000 | 99,180,000  |  |
| 令和3年度第9回札幌市公募公債(5年)       | 500,000,000 | 494,840,000 |  |
| 第7回川崎市公募公債(20年)           | 100,000,000 | 106,759,000 |  |
| 第12回川崎市公募公債(20年)          | 100,000,000 | 108,045,000 |  |
| 第62回川崎市公募公債(5年)           | 490,000,000 | 485,629,200 |  |
| 第3回北九州市公募公債(サステナビリティ)     | 100,000,000 | 97,383,000  |  |
| 第17回北九州市公募公債(20年)         | 100,000,000 | 103,740,000 |  |
| 令和3年度第1回北九州市公募公債(5年)      | 200,000,000 | 198,016,000 |  |
| 2020年度第9回福岡市公募公債(5年)      | 200,000,000 | 199,084,000 |  |
| 2023年度第8回福岡市公募公債          | 100,000,000 | 97,533,000  |  |
| 2024年度第1回福岡市公募公債(5年)      | 200,000,000 | 198,268,000 |  |
| 令和3年度第4回千葉市公募公債           | 100,000,000 | 94,678,000  |  |
| 令和5年度第4回千葉市公募公債(サステナビリティ) | 100,000,000 | 97,973,000  |  |
| 第21回さいたま市公募公債             | 170,000,000 | 166,754,700 |  |
| 令和5年度第2回鹿児島県公募公債(5年)      | 100,000,000 | 99,193,000  |  |
| 令和6年度第1回福井県公募公債(5年)       | 100,000,000 | 99,842,000  |  |
| 令和2年度第2回徳島県公募公債           | 100,000,000 | 96,013,000  |  |

|                               |                               |                |                |  |
|-------------------------------|-------------------------------|----------------|----------------|--|
|                               | 平成28年度第1回山梨県公募公債              | 200,000,000    | 198,160,000    |  |
|                               | 平成30年度第1回山梨県公募公債              | 100,000,000    | 98,625,000     |  |
|                               | 令和2年度第1回山梨県公募公債               | 700,000,000    | 672,826,000    |  |
|                               | 第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券     | 100,000,000    | 106,413,000    |  |
| 地方債証券 合計                      |                               | 49,580,400,000 | 49,697,647,040 |  |
| 特殊債券                          | 第19回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券     | 500,000,000    | 496,260,000    |  |
|                               | 第6回神奈川県住宅供給公社債券               | 100,000,000    | 96,858,000     |  |
|                               | 第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)         | 30,000,000     | 31,399,500     |  |
|                               | 第41回政府保証日本政策投資銀行              | 600,000,000    | 592,302,000    |  |
|                               | 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)   | 100,000,000    | 115,712,000    |  |
|                               | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)   | 140,000,000    | 144,573,800    |  |
|                               | 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 300,000,000    | 311,628,000    |  |
|                               | 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 30,000,000     | 33,983,700     |  |
|                               | 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 200,000,000    | 222,206,000    |  |
|                               | 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 200,000,000    | 209,320,000    |  |
|                               | 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 110,000,000    | 120,664,500    |  |
|                               | 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 300,000,000    | 316,062,000    |  |
|                               | 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 200,000,000    | 211,146,000    |  |
|                               | 第28回道路債券(財投機関債)               | 100,000,000    | 114,496,000    |  |
|                               | 第33回道路債券(財投機関債)               | 300,000,000    | 345,855,000    |  |
|                               | 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 150,000,000    | 160,090,500    |  |
|                               | 第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 100,000,000    | 105,775,000    |  |
|                               | 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000    | 109,174,000    |  |
|                               | 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000    | 107,673,000    |  |
|                               | 第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000    | 101,868,000    |  |
|                               | 第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000    | 106,886,000    |  |
|                               | 第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 100,000,000    | 91,768,000     |  |
|                               | 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000    | 106,639,000    |  |
| 第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 300,000,000                   | 295,449,000    |                |  |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 100,000,000                   | 92,482,000     |                |  |

|                                   |               |               |  |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| 第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 103,539,000   |  |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>(財投機関債) | 100,000,000   | 99,456,000    |  |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 106,236,000   |  |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 100,749,000   |  |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 102,390,000   |  |
| 第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 100,311,000   |  |
| 第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 100,117,000   |  |
| 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000   | 200,180,000   |  |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 99,972,000    |  |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000   | 199,328,000   |  |
| 第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 300,000,000   | 298,026,000   |  |
| 第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 300,000,000   | 297,858,000   |  |
| 第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 500,000,000   | 494,465,000   |  |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000   | 98,400,000    |  |
| 第437回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 1,000,000,000 | 988,630,000   |  |
| 第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 300,000,000   | 295,101,000   |  |
| 第467回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 1,000,000,000 | 982,900,000   |  |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)       | 50,000,000    | 53,660,000    |  |
| 第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)             | 100,000,000   | 116,153,000   |  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 100,000,000   | 106,228,000   |  |
| 第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 100,000,000   | 108,103,000   |  |
| 第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 80,000,000    | 86,888,800    |  |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 80,000,000    | 85,060,800    |  |
| 第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)            | 150,000,000   | 154,804,500   |  |
| 第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)            | 1,000,000,000 | 1,050,600,000 |  |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 100,000,000   | 105,150,000   |  |
| 第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)            | 300,000,000   | 318,408,000   |  |
| 第24回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)      | 200,000,000   | 210,596,000   |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 50,000,000    | 52,970,500    |  |
| 第29回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)  | 500,000,000   | 495,015,000   |  |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 100,000,000   | 99,845,000    |  |
| 第76回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 400,000,000   | 400,700,000   |  |
| 第77回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000   | 100,124,000   |  |
| 第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 300,000,000   | 300,462,000   |  |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 150,000,000   | 150,165,000   |  |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000   | 99,685,000    |  |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 674,000,000   | 670,212,120   |  |
| 第83回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 102,000,000   | 101,359,440   |  |
| F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000   | 103,468,000   |  |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 1,500,000,000 | 1,486,680,000 |  |
| 第94回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000   | 99,153,000    |  |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 325,000,000   | 320,823,750   |  |
| 第101回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 100,000,000   | 98,922,000    |  |
| 第102回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 131,000,000   | 129,486,950   |  |
| 第108回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 223,000,000   | 219,501,130   |  |
| 第115回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 200,000,000   | 196,110,000   |  |
| F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 70,000,000    | 72,990,400    |  |
| F134回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 300,000,000   | 307,830,000   |  |
| F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000   | 102,471,000   |  |
| F203回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 200,000,000   | 203,186,000   |  |
| F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000   | 103,072,000   |  |
| 第27回首都高速道路                   | 100,000,000   | 99,498,000    |  |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債)          | 80,000,000    | 86,070,400    |  |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債)          | 80,000,000    | 85,194,400    |  |
| 第48回福祉医療機構債券(財投機関債)          | 400,000,000   | 396,440,000   |  |
| 第54回福祉医療機構債券(財投機関債)          | 100,000,000   | 98,326,000    |  |
| 第4回中部国際空港(財投機関債)             | 200,000,000   | 198,416,000   |  |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 27,671,000    | 27,302,145    |  |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 28,935,000    | 28,596,749    |  |
| 第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 33,430,000    | 32,923,869    |  |
| 第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 47,893,000    | 46,901,135    |  |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 17,596,000    | 18,221,009    |  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 17,484,000    | 18,072,861    |  |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 17,915,000    | 18,508,344    |  |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 17,341,000    | 17,923,657    |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 32,908,000    | 33,896,885    |  |

|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 34,176,000  | 35,144,547  |  |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 18,702,000  | 19,195,358  |  |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 36,170,000  | 36,818,889  |  |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 21,415,000  | 21,996,203  |  |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 81,384,000  | 84,054,209  |  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 50,703,000  | 52,194,682  |  |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 14,592,000  | 15,003,932  |  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 31,320,000  | 32,259,600  |  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 32,026,000  | 32,906,074  |  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 33,158,000  | 34,006,513  |  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 35,090,000  | 35,995,672  |  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 37,520,000  | 38,372,079  |  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 39,740,000  | 40,620,241  |  |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 22,236,000  | 22,691,170  |  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 22,407,000  | 22,882,252  |  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 47,560,000  | 48,563,040  |  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 47,958,000  | 48,736,837  |  |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 48,806,000  | 49,422,907  |  |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 27,568,000  | 27,811,149  |  |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 26,939,000  | 27,062,650  |  |
| 第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 188,424,000 | 189,040,146 |  |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 90,393,000  | 90,604,519  |  |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 28,350,000  | 28,637,185  |  |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 31,842,000  | 32,197,993  |  |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 26,773,000  | 27,013,689  |  |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)  | 30,000,000  | 30,699,900  |  |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 27,913,000  | 27,988,365  |  |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 31,458,000  | 31,435,664  |  |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 34,015,000  | 33,860,231  |  |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 132,640,000 | 131,940,987 |  |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 69,104,000  | 68,687,993  |  |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)  | 100,000,000 | 106,419,000 |  |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 37,185,000  | 36,728,740  |  |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 114,885,000 | 113,018,118 |  |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 40,651,000  | 39,581,065  |  |
| 第93回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)  | 200,000,000 | 204,784,000 |  |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 51,496,000  | 50,140,110  |  |
| 第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 49,054,000  | 47,517,628  |  |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 50,441,000  | 49,217,301  |  |
| 第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 200,000,000 | 213,332,000 |  |



|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 102,324,000 |  |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 53,638,000  | 52,022,423  |  |
| 第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 112,730,000 | 106,820,693 |  |
| 第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 116,364,000 | 109,592,778 |  |
| 第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 246,552,000 | 231,068,534 |  |
| 第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 313,060,000 | 290,932,919 |  |
| 第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 508,616,000 | 470,958,071 |  |
| 第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 131,986,000 | 123,813,426 |  |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 457,996,000 | 430,319,301 |  |
| 第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 330,595,000 | 308,484,806 |  |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 130,000,000 | 136,905,600 |  |
| 第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 203,913,000 | 190,483,289 |  |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 105,985,000 |  |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 67,574,000  | 62,946,532  |  |
| 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 69,886,000  | 64,873,776  |  |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 68,422,000  | 63,679,671  |  |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 140,556,000 | 130,933,536 |  |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 140,672,000 | 130,719,456 |  |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 69,856,000  | 64,713,201  |  |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 69,227,000  | 64,159,583  |  |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 211,425,000 | 196,122,058 |  |
| 第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 71,293,000  | 65,896,832  |  |
| 第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 72,055,000  | 66,801,469  |  |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 289,948,000 | 269,364,591 |  |
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 143,556,000 | 133,723,849 |  |
| 第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 102,128,000 |  |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 152,902,000 | 138,413,006 |  |
| 第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 231,594,000 | 208,406,808 |  |
| 第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 235,842,000 | 213,255,411 |  |
| 第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 160,170,000 | 145,237,350 |  |
| 第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 79,487,000  | 72,523,143  |  |
| 第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 159,626,000 | 145,614,029 |  |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 82,327,000  | 75,120,917  |  |
| 第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 100,407,000 |  |
| 第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 167,242,000 | 152,335,720 |  |
| 第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 100,178,000 |  |
| 第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 84,396,000  | 76,852,685  |  |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 253,761,000 | 231,597,514 |  |
| 第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 172,252,000 | 156,935,352 |  |
| 第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 172,180,000 | 156,718,236 |  |

|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 174,378,000 | 157,834,759 |  |
| 第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 86,790,000  | 78,542,346  |  |
| 第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 180,000,000 | 175,834,800 |  |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 88,937,000  | 80,780,587  |  |
| 第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 176,840,000 | 159,842,139 |  |
| 第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 177,662,000 | 161,711,505 |  |
| 第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 88,583,000  | 81,298,819  |  |
| 第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 178,414,000 | 163,148,898 |  |
| 第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 89,312,000  | 82,121,490  |  |
| 第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 89,996,000  | 82,647,826  |  |
| 第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 181,656,000 | 166,665,746 |  |
| 第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 181,508,000 | 166,813,112 |  |
| 第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 183,596,000 | 168,234,522 |  |
| 第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 92,610,000  | 86,904,297  |  |
| 第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 185,142,000 | 177,925,164 |  |
| 第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 93,061,000  | 89,956,485  |  |
| 第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 93,900,000  | 90,267,009  |  |
| 第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 374,428,000 | 362,700,915 |  |
| 第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 94,207,000  | 90,554,594  |  |
| 第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 94,866,000  | 91,006,851  |  |
| 第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 98,971,000  |  |
| 第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 192,618,000 | 184,449,070 |  |
| 第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 289,242,000 | 279,454,050 |  |
| 第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 193,540,000 | 187,822,828 |  |
| 第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 193,436,000 | 189,418,334 |  |
| 第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 387,636,000 | 377,344,264 |  |
| 第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 292,776,000 | 283,799,487 |  |
| 第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 293,583,000 | 283,234,199 |  |
| 第202回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 98,196,000  | 95,731,280  |  |
| 第203回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 395,620,000 | 387,181,425 |  |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 99,165,000  |  |
| 第204回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 297,924,000 | 294,053,967 |  |
| 第205回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 199,632,000 | 198,553,987 |  |
| 第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 200,000,000 | 198,690,000 |  |
| 第207回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 300,000,000 | 300,207,000 |  |
| 第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)     | 50,000,000  | 50,775,500  |  |
| い第843号商工債券                 | 200,000,000 | 199,430,000 |  |
| い第848号商工債券                 | 100,000,000 | 99,411,000  |  |
| い第850号商工債券                 | 300,000,000 | 297,837,000 |  |
| い第852号商工債券                 | 100,000,000 | 99,073,000  |  |
| い第854号商工債券                 | 500,000,000 | 494,345,000 |  |
| い第857号商工債券                 | 100,000,000 | 98,677,000  |  |

|         |                              |                |                |  |
|---------|------------------------------|----------------|----------------|--|
|         | い第871号商工債券                   | 200,000,000    | 197,002,000    |  |
|         | い第872号商工債券                   | 400,000,000    | 395,156,000    |  |
|         | い第885号商工債券                   | 400,000,000    | 395,296,000    |  |
|         | 第376回信金中金債                   | 100,000,000    | 99,278,000     |  |
|         | 第32号商工債券(10年)                | 200,000,000    | 192,312,000    |  |
|         | 第280号商工債券(3年)                | 200,000,000    | 198,618,000    |  |
|         | 第2回信金中金債(10年)                | 100,000,000    | 100,151,000    |  |
|         | 第7回国際協力機構債券(財投機関債)           | 70,000,000     | 75,095,300     |  |
|         | 第83回東日本高速道路                  | 400,000,000    | 396,352,000    |  |
|         | 第111回東日本高速道路                 | 200,000,000    | 198,452,000    |  |
|         | 第29回西日本高速道路                  | 200,000,000    | 199,544,000    |  |
|         | 第56回西日本高速道路                  | 900,000,000    | 896,643,000    |  |
|         | 第61回西日本高速道路                  | 700,000,000    | 693,483,000    |  |
|         | 第87回西日本高速道路                  | 500,000,000    | 498,465,000    |  |
|         | 第88回西日本高速道路                  | 200,000,000    | 199,012,000    |  |
|         | 第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000    | 100,666,000    |  |
| 特殊債券 合計 |                              | 39,922,055,000 | 39,499,997,602 |  |
| 社債券     | 第19回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000    | 100,345,000    |  |
|         | 第29回フランス相互信用連合銀行             | 200,000,000    | 199,912,000    |  |
|         | 第35回フランス相互信用連合銀行             | 500,000,000    | 493,795,000    |  |
|         | 第38回フランス相互信用連合銀行             | 300,000,000    | 300,324,000    |  |
|         | 第25回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 100,000,000    | 98,453,000     |  |
|         | 第32回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 200,000,000    | 199,226,000    |  |
|         | 第33回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 200,000,000    | 198,024,000    |  |
|         | 第36回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 400,000,000    | 399,456,000    |  |
|         | 第1回サントナール銀行(2019)            | 500,000,000    | 499,570,000    |  |
|         | 第12回新関西国際空港                  | 100,000,000    | 101,046,000    |  |
|         | 第27回新関西国際空港                  | 100,000,000    | 99,263,000     |  |
|         | 第38回新関西国際空港                  | 200,000,000    | 199,830,000    |  |
|         | 第32回成田国際空港                   | 100,000,000    | 97,524,000     |  |
|         | 第1回国際石油開発帝石                  | 100,000,000    | 99,188,000     |  |
|         | 第27回大林組(サステナビリティ)            | 100,000,000    | 99,655,000     |  |
|         | 第48回鹿島建設(サステナビリティ)           | 100,000,000    | 99,252,000     |  |
|         | 第10回明治ホールディングス(サステナビリティ)     | 200,000,000    | 198,224,000    |  |
|         | 第16回アサヒグループホールディングス          | 100,000,000    | 99,272,000     |  |
|         | 第19回アサヒグループホールディングス          | 400,000,000    | 398,432,000    |  |
|         | 第22回キリンホールディングス(ソーシャル)       | 100,000,000    | 99,258,000     |  |
|         | 第9回サントリーホールディングス             | 500,000,000    | 494,975,000    |  |
|         | 第22回味の素                      | 100,000,000    | 99,679,000     |  |
|         | 第3回 キューピー                    | 100,000,000    | 99,568,000     |  |
|         | 第13回日本たばこ産業                  | 400,000,000    | 392,036,000    |  |
|         | 第16回日本たばこ産業                  | 300,000,000    | 291,162,000    |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第6回ヒューリック                 | 400,000,000 | 391,952,000 |  |
| 第14回ヒューリック                | 300,000,000 | 298,410,000 |  |
| 第18回野村不動産ホールディングス(グリーン)   | 200,000,000 | 199,768,000 |  |
| 第24回森ヒルズリート投資法人(グリーン)     | 300,000,000 | 297,465,000 |  |
| 第27回森ビル(グリーン)             | 100,000,000 | 99,907,000  |  |
| 第9回クラレ                    | 100,000,000 | 99,032,000  |  |
| 第56回住友化学                  | 200,000,000 | 196,164,000 |  |
| 第59回住友化学                  | 200,000,000 | 194,772,000 |  |
| 第3回三菱ケミカルグループ             | 500,000,000 | 495,800,000 |  |
| 第4回野村総合研究所                | 100,000,000 | 98,278,000  |  |
| 第12回野村総合研究所               | 200,000,000 | 197,816,000 |  |
| 第6回花王                     | 200,000,000 | 199,216,000 |  |
| 第1回アステラス製薬                | 400,000,000 | 398,828,000 |  |
| 第17回Zホールディングス             | 100,000,000 | 98,896,000  |  |
| 第22回Zホールディングス             | 200,000,000 | 197,210,000 |  |
| 第7回住友三井オートサービス(サステナビリティ)  | 100,000,000 | 98,681,000  |  |
| 第8回住友三井オートサービス(サステナビリティ)  | 100,000,000 | 99,628,000  |  |
| 第20回富士フイルムホールディングス(ソーシャル) | 200,000,000 | 199,686,000 |  |
| 第12回日本電気硝子                | 100,000,000 | 98,168,000  |  |
| 第38回JFEホールディングス           | 400,000,000 | 399,532,000 |  |
| 第1回住友生命2023基金             | 400,000,000 | 393,376,000 |  |
| 第14回LIXIL                 | 200,000,000 | 197,556,000 |  |
| 第1回日本郵政(グリーン)             | 100,000,000 | 98,480,000  |  |
| 第4回日本郵政                   | 500,000,000 | 495,875,000 |  |
| 第17回小松製作所                 | 100,000,000 | 99,848,000  |  |
| 第9回住友重機械工業                | 200,000,000 | 198,936,000 |  |
| 第30回ダイキン工業                | 200,000,000 | 195,056,000 |  |
| 第32回ダイキン工業                | 300,000,000 | 299,643,000 |  |
| 第22回パナソニック                | 100,000,000 | 97,977,000  |  |
| 第24回パナソニックホールディングス        | 300,000,000 | 297,075,000 |  |
| 第25回パナソニックホールディングス        | 800,000,000 | 795,704,000 |  |
| 第40回ソニーグループ               | 600,000,000 | 593,490,000 |  |
| 第15回デンソー                  | 300,000,000 | 296,334,000 |  |
| 第18回デンソー                  | 300,000,000 | 295,164,000 |  |
| 第40回三菱重工業                 | 300,000,000 | 295,929,000 |  |
| 第29回JA三井リース               | 400,000,000 | 399,952,000 |  |
| 第32回いすゞ自動車                | 200,000,000 | 197,474,000 |  |
| 第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 800,000,000 | 793,336,000 |  |
| 第27回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 600,000,000 | 569,568,000 |  |
| 第31回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 200,000,000 | 191,786,000 |  |
| 第1回明治安田生命2019基金           | 200,000,000 | 199,988,000 |  |
| 第7回アシックス                  | 100,000,000 | 99,278,000  |  |

|                           |               |               |  |
|---------------------------|---------------|---------------|--|
| 第63回三井物産                  | 400,000,000   | 418,200,000   |  |
| 第40回住友商事                  | 200,000,000   | 214,548,000   |  |
| 第51回住友商事                  | 100,000,000   | 101,514,000   |  |
| 第53回住友商事                  | 300,000,000   | 296,418,000   |  |
| 第55回住友商事                  | 500,000,000   | 491,345,000   |  |
| 第61回住友商事                  | 100,000,000   | 99,523,000    |  |
| 第44回丸井グループ                | 100,000,000   | 98,453,000    |  |
| 第101回クレディセゾン              | 500,000,000   | 497,725,000   |  |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ      | 300,000,000   | 299,889,000   |  |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ     | 500,000,000   | 486,710,000   |  |
| 第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 200,000,000   | 215,332,000   |  |
| 第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 200,000,000   | 202,586,000   |  |
| 第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 200,000,000   | 203,478,000   |  |
| 第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)      | 100,000,000   | 105,641,000   |  |
| 第88回三菱東京UFJ銀行             | 100,000,000   | 104,260,000   |  |
| 第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付   | 100,000,000   | 97,160,000    |  |
| 第18回みずほ銀行(劣後特約付)          | 100,000,000   | 102,113,000   |  |
| 第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ)     | 400,000,000   | 398,268,000   |  |
| 第40回芙蓉総合リース(サステナビリティ)     | 100,000,000   | 98,895,000    |  |
| 第7回みずほリース                 | 500,000,000   | 491,265,000   |  |
| 第9回みずほリース                 | 300,000,000   | 292,062,000   |  |
| 第12回みずほリース                | 200,000,000   | 195,036,000   |  |
| 第21回みずほリース                | 300,000,000   | 296,487,000   |  |
| 第22回みずほリース(サステナビリティ)      | 300,000,000   | 297,291,000   |  |
| 第23回みずほリース                | 200,000,000   | 197,752,000   |  |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 1,200,000,000 | 1,193,976,000 |  |
| 第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 300,000,000   | 295,167,000   |  |
| 第18回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 1,500,000,000 | 1,445,295,000 |  |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000   | 294,525,000   |  |
| 第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 500,000,000   | 479,230,000   |  |
| 第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000   | 297,471,000   |  |
| 第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000   | 297,657,000   |  |
| 第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 200,000,000   | 197,508,000   |  |
| 第32回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 400,000,000   | 400,644,000   |  |
| 第34回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 300,000,000   | 301,665,000   |  |
| 第53回日産フィナンシャルサービス         | 300,000,000   | 296,547,000   |  |
| 第56回日産フィナンシャルサービス         | 500,000,000   | 495,075,000   |  |
| 第57回日産フィナンシャルサービス         | 400,000,000   | 392,796,000   |  |
| 第58回日産フィナンシャルサービス         | 100,000,000   | 99,220,000    |  |
| 第30回東京センチュリー              | 100,000,000   | 98,091,000    |  |

|                     |             |             |  |
|---------------------|-------------|-------------|--|
| 第34回東京センチュリー        | 300,000,000 | 292,215,000 |  |
| 第41回東京センチュリー        | 300,000,000 | 299,922,000 |  |
| 第102回トヨタファイナンス      | 700,000,000 | 696,346,000 |  |
| 第103回トヨタファイナンス      | 300,000,000 | 297,156,000 |  |
| 第22回ポケットカード         | 100,000,000 | 99,455,000  |  |
| 第23回ポケットカード         | 200,000,000 | 196,642,000 |  |
| 第24回ポケットカード         | 300,000,000 | 297,147,000 |  |
| 第209回オリックス          | 500,000,000 | 493,920,000 |  |
| 第220回オリックス          | 400,000,000 | 396,896,000 |  |
| 第222回オリックス          | 500,000,000 | 494,115,000 |  |
| 第34回三井住友ファイナンス&リース  | 300,000,000 | 299,364,000 |  |
| 第2回三菱HCキャピタル        | 500,000,000 | 492,710,000 |  |
| 第40回大和証券グループ本社      | 500,000,000 | 497,265,000 |  |
| 第3回野村ホールディングス       | 200,000,000 | 197,214,000 |  |
| 第24回野村ホールディングス      | 100,000,000 | 101,448,000 |  |
| 第27回野村ホールディングス      | 100,000,000 | 101,529,000 |  |
| 第83回三井不動産(グリーン)     | 200,000,000 | 191,204,000 |  |
| 第142回三菱地所(サステナビリティ) | 200,000,000 | 197,440,000 |  |
| 第143回三菱地所           | 100,000,000 | 96,537,000  |  |
| 第111回住友不動産(グリーン)    | 100,000,000 | 98,907,000  |  |
| 第76回東京急行電鉄          | 200,000,000 | 204,980,000 |  |
| 第36回京王電鉄            | 200,000,000 | 197,714,000 |  |
| 第53回東日本旅客鉄道         | 300,000,000 | 317,562,000 |  |
| 第71回東日本旅客鉄道         | 400,000,000 | 422,268,000 |  |
| 第100回東日本旅客鉄道        | 200,000,000 | 196,844,000 |  |
| 第163回東日本旅客鉄道        | 600,000,000 | 594,828,000 |  |
| 第199回東日本旅客鉄道        | 300,000,000 | 299,514,000 |  |
| 第73回西日本旅客鉄道         | 400,000,000 | 396,480,000 |  |
| 第42回東海旅客鉄道          | 100,000,000 | 106,639,000 |  |
| 第53回東海旅客鉄道          | 100,000,000 | 104,932,000 |  |
| 第28回東京地下鉄           | 300,000,000 | 294,198,000 |  |
| 第50回阪急阪神ホールディングス    | 200,000,000 | 196,562,000 |  |
| 第58回阪急阪神ホールディングス    | 200,000,000 | 198,612,000 |  |
| 第68回名古屋鉄道(サステナビリティ) | 200,000,000 | 196,588,000 |  |
| 第1回横浜高速鉄道           | 300,000,000 | 299,691,000 |  |
| 第20回三菱倉庫            | 100,000,000 | 98,294,000  |  |
| 第31回KDDI(サステナビリティ)  | 200,000,000 | 197,676,000 |  |
| 第32回KDDI            | 300,000,000 | 299,619,000 |  |
| 第9回ソフトバンク           | 600,000,000 | 587,184,000 |  |
| 第13回ソフトバンク          | 500,000,000 | 463,560,000 |  |
| 第14回ソフトバンク          | 500,000,000 | 492,455,000 |  |
| 第16回ソフトバンク          | 500,000,000 | 460,715,000 |  |
| 第21回ソフトバンク          | 700,000,000 | 689,962,000 |  |

|                 |             |             |  |
|-----------------|-------------|-------------|--|
| 第22回ソフトバンク      | 300,000,000 | 291,558,000 |  |
| 第25回ソフトバンク      | 600,000,000 | 598,938,000 |  |
| 第26回ソフトバンク      | 500,000,000 | 498,435,000 |  |
| 第548回東京電力       | 100,000,000 | 102,066,000 |  |
| 第567回東京電力       | 100,000,000 | 99,615,000  |  |
| 第566回中部電力       | 300,000,000 | 289,566,000 |  |
| 第508回関西電力       | 200,000,000 | 198,334,000 |  |
| 第510回関西電力       | 500,000,000 | 495,615,000 |  |
| 第511回関西電力       | 100,000,000 | 98,788,000  |  |
| 第518回関西電力       | 200,000,000 | 196,642,000 |  |
| 第524回関西電力       | 200,000,000 | 196,758,000 |  |
| 第400回中国電力       | 200,000,000 | 197,312,000 |  |
| 第409回中国電力       | 200,000,000 | 196,298,000 |  |
| 第446回中国電力       | 100,000,000 | 96,737,000  |  |
| 第448回中国電力       | 200,000,000 | 191,472,000 |  |
| 第459回中国電力       | 300,000,000 | 299,703,000 |  |
| 第460回中国電力       | 400,000,000 | 400,940,000 |  |
| 第492回東北電力       | 300,000,000 | 297,258,000 |  |
| 第494回東北電力       | 200,000,000 | 198,116,000 |  |
| 第527回東北電力       | 400,000,000 | 377,704,000 |  |
| 第552回東北電力       | 400,000,000 | 398,968,000 |  |
| 第449回九州電力       | 300,000,000 | 297,378,000 |  |
| 第451回九州電力       | 300,000,000 | 297,423,000 |  |
| 第468回九州電力       | 100,000,000 | 98,188,000  |  |
| 第471回九州電力       | 300,000,000 | 294,066,000 |  |
| 第484回九州電力       | 400,000,000 | 386,480,000 |  |
| 第503回九州電力       | 600,000,000 | 593,628,000 |  |
| 第524回九州電力       | 300,000,000 | 289,890,000 |  |
| 第57回電源開発        | 100,000,000 | 98,020,000  |  |
| 第59回電源開発        | 300,000,000 | 294,351,000 |  |
| 第64回電源開発        | 600,000,000 | 584,844,000 |  |
| 第67回電源開発        | 200,000,000 | 192,250,000 |  |
| 第86回電源開発        | 100,000,000 | 95,925,000  |  |
| 第87回電源開発（グリーン）  | 200,000,000 | 192,914,000 |  |
| 第89回電源開発（グリーン）  | 200,000,000 | 192,742,000 |  |
| 第6回東京電力パワーグリッド  | 100,000,000 | 99,754,000  |  |
| 第13回東京電力パワーグリッド | 300,000,000 | 296,985,000 |  |
| 第15回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 97,424,000  |  |
| 第25回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 99,380,000  |  |
| 第28回東京電力パワーグリッド | 400,000,000 | 396,212,000 |  |
| 第31回東京電力パワーグリッド | 300,000,000 | 296,160,000 |  |
| 第33回東京電力パワーグリッド | 700,000,000 | 696,689,000 |  |
| 第35回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 99,384,000  |  |

|                         |                 |                 |  |
|-------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 第39回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 394,144,000     |  |
| 第47回東京電力パワーグリッド         | 200,000,000     | 188,970,000     |  |
| 第49回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 396,808,000     |  |
| 第16回JERA                | 200,000,000     | 197,972,000     |  |
| 第17回JERA                | 400,000,000     | 393,752,000     |  |
| 第21回JERA                | 200,000,000     | 197,592,000     |  |
| 第22回JERA                | 1,000,000,000   | 993,460,000     |  |
| 第23回JERA                | 100,000,000     | 96,488,000      |  |
| 第25回JERA                | 400,000,000     | 393,688,000     |  |
| 第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン） | 400,000,000     | 398,640,000     |  |
| 第51回大阪ガス                | 100,000,000     | 96,137,000      |  |
| 第53回大阪ガス                | 300,000,000     | 297,177,000     |  |
| 第13回広島ガス                | 200,000,000     | 195,594,000     |  |
| 第7回ファーストリテイリング          | 100,000,000     | 98,521,000      |  |
| 社債券 合計                  | 59,700,000,000  | 59,009,483,000  |  |
| 合計                      | 996,441,455,000 | 948,794,079,082 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

### 【三菱UFJ 国内債券インデックスファンド】

#### 【純資産額計算書】

2024年 7月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 2,093,403,542  |
| 負債総額            | 1,912,241      |
| 純資産総額（ - ）      | 2,091,491,301  |
| 発行済口数           | 2,342,675,640口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 0.8928         |
| （10,000口当たり）    | （8,928）        |

（参考）

### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

2024年 7月31日現在

（単位：円）

|            |                  |
|------------|------------------|
| 資産総額       | 963,209,864,827  |
| 負債総額       | 6,876,083,743    |
| 純資産総額（ - ） | 956,333,781,084  |
| 発行済口数      | 769,145,686,189口 |



|                 |          |
|-----------------|----------|
| 1口当たり純資産価額( / ) | 1.2434   |
| (10,000口当たり)    | (12,434) |

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

###### (1) 資本金の額等

2024年7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### (2) 委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

###### 管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、(a)運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b)リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、(a)についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b)についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

###### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2024年7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本数<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 829       | 35,602,157     |
| 追加型公社債投資信託 | 16        | 1,535,876      |
| 単位型株式投資信託  | 94        | 419,510        |
| 単位型公社債投資信託 | 48        | 101,839        |
| 合計         | 987       | 37,659,382     |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

## 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

### (1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（自2023年4月1日至2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|        | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| (資産の部) |                        |                        |
| 流動資産   |                        |                        |
| 現金及び預金 | 2 51,733,041           | 2 58,206,340           |

|            |   |             |   |             |
|------------|---|-------------|---|-------------|
| 有価証券       |   | 1,579,691   |   | 15,283      |
| 前払費用       |   | 770,747     |   | 679,199     |
| 未収入金       |   | 81,854      |   | 138,388     |
| 未収委託者報酬    |   | 16,753,855  |   | 21,064,747  |
| 未収収益       | 2 | 688,142     | 2 | 1,485,701   |
| 金銭の信託      |   | 10,400,000  |   | 10,500,500  |
| その他        |   | 745,576     |   | 371,400     |
| 流動資産合計     |   | 82,752,908  |   | 92,461,561  |
| 固定資産       |   |             |   |             |
| 有形固定資産     |   |             |   |             |
| 建物         | 1 | 181,551     | 1 | 2,936,036   |
| 器具備品       | 1 | 730,357     | 1 | 1,531,857   |
| 土地         |   | 628,433     |   | 628,433     |
| 建設仮勘定      |   | 1,111,177   |   | 45,140      |
| 有形固定資産合計   |   | 2,651,520   |   | 5,141,467   |
| 無形固定資産     |   |             |   |             |
| 電話加入権      |   | 15,822      |   | 15,822      |
| ソフトウェア     |   | 4,183,644   |   | 5,008,987   |
| ソフトウェア仮勘定  |   | 1,907,739   |   | 1,587,548   |
| 無形固定資産合計   |   | 6,107,206   |   | 6,612,357   |
| 投資その他の資産   |   |             |   |             |
| 投資有価証券     |   | 12,022,365  |   | 13,788,071  |
| 関係会社株式     |   | 159,536     |   | 159,536     |
| 投資不動産      | 1 | 807,066     | 1 | 1,788,120   |
| 長期差入保証金    |   | 689,492     |   | 689,867     |
| 前払年金費用     |   | 118,832     |   | 47,573      |
| 繰延税金資産     |   | 1,675,132   |   | 1,088,836   |
| その他        |   | 45,230      |   | 45,230      |
| 貸倒引当金      |   | 23,600      |   | 23,600      |
| 投資その他の資産合計 |   | 15,494,056  |   | 17,583,636  |
| 固定資産合計     |   | 24,252,782  |   | 29,337,461  |
| 資産合計       |   | 107,005,691 |   | 121,799,022 |

(単位：千円)

|         | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部)  |                        |                        |
| 流動負債    |                        |                        |
| 預り金     | 507,559                | 807,451                |
| 未払金     |                        |                        |
| 未払収益分配金 | 114,094                | 105,550                |
| 未払償還金   | 7,418                  | 43,553                 |
| 未払手数料   | 2 6,139,595            | 2 7,523,485            |
| その他未払金  | 2 955,697              | 2 885,002              |
| 未払費用    | 2 5,778,896            | 2 8,611,140            |
| 未払消費税等  | 439,657                | 623,219                |
| 未払法人税等  | 2,375,281              | 2,235,007              |
| 賞与引当金   | 849,840                | 1,182,242              |
| 役員賞与引当金 | 154,872                | 175,992                |
| その他     | 5,517                  | 12,303                 |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 流動負債合計    | 17,328,431 | 22,204,949 |
| 固定負債      |            |            |
| 退職給付引当金   | 1,333,882  | 1,608,101  |
| 役員退職慰労引当金 | 75,667     | 30,105     |
| 時効後支払損引当金 | 254,296    | 250,350    |
| 資産除去債務    | -          | 1,428,586  |
| その他       | -          | 29,109     |
| 固定負債合計    | 1,663,846  | 3,346,253  |
| 負債合計      | 18,992,277 | 25,551,202 |
| (純資産の部)   |            |            |
| 株主資本      |            |            |
| 資本金       | 2,000,131  | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |            |            |
| 資本準備金     | 3,572,096  | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |            |            |
| 利益準備金     | 342,589    | 342,589    |
| その他利益剰余金  |            |            |
| 別途積立金     | 6,998,000  | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   | 33,267,700 | 40,236,787 |
| 利益剰余金合計   | 40,608,289 | 47,577,377 |
| 株主資本合計    | 87,341,133 | 94,310,221 |

(単位：千円)

|              | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等     |                        |                        |
| その他有価証券評価差額金 | 672,279                | 1,937,598              |
| 評価・換算差額等合計   | 672,279                | 1,937,598              |
| 純資産合計        | 88,013,413             | 96,247,820             |
| 負債純資産合計      | 107,005,691            | 121,799,022            |

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益    |                                       |                                       |
| 委託者報酬   | 84,121,445                            | 98,635,342                            |
| 投資顧問料   | 2,750,601                             | 3,117,320                             |
| その他営業収益 | 10,412                                | 148,442                               |
| 営業収益合計  | 86,882,459                            | 101,901,104                           |
| 営業費用    |                                       |                                       |
| 支払手数料   | 4 31,461,274                          | 4 34,494,219                          |
| 広告宣伝費   | 798,894                               | 593,586                               |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 公告費       | 375        | 1,017      |
| 調査費       |            |            |
| 調査費       | 2,849,042  | 3,537,103  |
| 委託調査費     | 19,236,505 | 27,296,058 |
| 事務委託費     | 1,751,807  | 1,861,577  |
| 営業雑経費     |            |            |
| 通信費       | 113,480    | 137,737    |
| 印刷費       | 367,379    | 390,143    |
| 協会費       | 58,128     | 68,869     |
| 諸会費       | 18,447     | 20,108     |
| 事務機器関連費   | 2,238,382  | 2,531,009  |
| その他営業雑経費  | -          | 139,012    |
| 営業費用合計    | 58,893,717 | 71,070,444 |
| 一般管理費     |            |            |
| 給料        |            |            |
| 役員報酬      | 416,461    | 400,592    |
| 給料・手当     | 6,565,766  | 7,202,711  |
| 賞与引当金繰入   | 849,840    | 1,182,242  |
| 役員賞与引当金繰入 | 154,872    | 175,992    |
| 福利厚生費     | 1,279,885  | 1,424,215  |
| 交際費       | 8,942      | 10,054     |
| 旅費交通費     | 75,274     | 108,782    |
| 租税公課      | 403,955    | 397,138    |
| 不動産賃借料    | 719,707    | 728,550    |
| 退職給付費用    | 388,176    | 381,449    |
| 固定資産減価償却費 | 2,418,341  | 2,469,755  |
| 諸経費       | 444,313    | 490,104    |
| 一般管理費合計   | 13,725,534 | 14,971,590 |
| 営業利益      | 14,263,207 | 15,859,070 |

(単位：千円)

|             | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業外収益       |                                       |                                       |
| 受取配当金       | 47,353                                | 54,618                                |
| 受取利息        | 4 10,279                              | 4 12,836                              |
| 投資有価証券償還益   | 609,102                               | 204,527                               |
| 収益分配金等時効完成分 | 94,351                                | 17,722                                |
| 受取賃貸料       | 4 65,808                              | 4 162,111                             |
| その他         | 36,894                                | 44,734                                |
| 営業外収益合計     | 863,788                               | 496,550                               |
| 営業外費用       |                                       |                                       |
| 投資有価証券償還損   | 32,995                                | 234,700                               |
| 時効後支払損引当金繰入 | 31,951                                | -                                     |
| 事務過誤費       | 2,680                                 | 10,822                                |
| 賃貸関連費用      | 14,262                                | 108,773                               |
| その他         | 32,394                                | 25,903                                |
| 営業外費用合計     | 114,284                               | 380,199                               |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 経常利益         |   | 15,012,711 |   | 15,975,421 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却益    |   | 387,113    |   | 464,927    |
| 固定資産売却益      |   | -          | 1 | 16,229     |
| 資産除去債務履行差額   |   | -          |   | 87,050     |
| 特別利益合計       |   | 387,113    |   | 568,207    |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 15,828     |   | 57,011     |
| 投資有価証券評価損    |   | 104,554    |   | 31,651     |
| 固定資産除却損      | 3 | 32,791     | 3 | 20,246     |
| 固定資産売却損      |   | -          | 2 | 65,427     |
| 減損損失         | 5 | 315,350    |   | -          |
| 企業結合関連費用     |   | -          | 6 | 1,187,136  |
| 特別損失合計       |   | 468,524    |   | 1,361,473  |
| 税引前当期純利益     |   | 14,931,300 |   | 15,182,154 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 4 | 4,860,444  | 4 | 4,542,085  |
| 法人税等調整額      |   | 271,471    |   | 102,468    |
| 法人税等合計       |   | 4,588,973  |   | 4,644,553  |
| 当期純利益        |   | 10,342,327 |   | 10,537,601 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

|                     | 株主資本      |           |            |            |
|---------------------|-----------|-----------|------------|------------|
|                     | 資本金       | 資本剰余金     |            |            |
|                     |           | 資本準備金     | その他資本剰余金   | 資本剰余金合計    |
| 当期首残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 |
| 当期変動額               |           |           |            |            |
| 剰余金の配当              |           |           |            |            |
| 当期純利益               |           |           |            |            |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) |           |           |            |            |
| 当期変動額合計             |           |           |            |            |
| 当期末残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 |

|                     | 利益剰余金   |           |            |            | 株主資本合計     |
|---------------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
|                     | 利益準備金   | その他利益剰余金  |            | 利益剰余金合計    |            |
|                     |         | 別途積立金     | 繰越利益剰余金    |            |            |
| 当期首残高               | 342,589 | 6,998,000 | 29,000,498 | 36,341,088 | 83,073,932 |
| 当期変動額               |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当              |         |           | 6,075,125  | 6,075,125  | 6,075,125  |
| 当期純利益               |         |           | 10,342,327 | 10,342,327 | 10,342,327 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) |         |           |            |            |            |

|         |         |           |            |            |            |
|---------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 当期変動額合計 |         |           | 4,267,201  | 4,267,201  | 4,267,201  |
| 当期末残高   | 342,589 | 6,998,000 | 33,267,700 | 40,608,289 | 87,341,133 |

|                         | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                   | 1,626,775            | 1,626,775      | 84,700,707 |
| 当期変動額                   |                      |                |            |
| 剰余金の配当                  |                      |                | 6,075,125  |
| 当期純利益                   |                      |                | 10,342,327 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | 954,495              | 954,495        | 954,495    |
| 当期変動額合計                 | 954,495              | 954,495        | 3,312,705  |
| 当期末残高                   | 672,279              | 672,279        | 88,013,413 |

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

|                         | 株主資本      |           |              |             |
|-------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|
|                         | 資本金       | 資本剰余金     |              |             |
|                         |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |
| 当期首残高                   | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  |
| 当期変動額                   |           |           |              |             |
| 企業結合による増加               |           |           |              |             |
| 剰余金の配当                  |           |           |              |             |
| 当期純利益                   |           |           |              |             |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |           |           |              |             |
| 当期変動額合計                 |           |           |              |             |
| 当期末残高                   | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  |

|                         | 利益剰余金     |           |             |             | 株主資本合計     |
|-------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                         |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                   | 342,589   | 6,998,000 | 33,267,700  | 40,608,289  | 87,341,133 |
| 当期変動額                   |           |           |             |             |            |
| 企業結合による増加               |           |           | 1,602,526   | 1,602,526   | 1,602,526  |
| 剰余金の配当                  |           |           | 5,171,039   | 5,171,039   | 5,171,039  |
| 当期純利益                   |           |           | 10,537,601  | 10,537,601  | 10,537,601 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |           |           |             |             |            |
| 当期変動額合計                 |           |           | 6,969,087   | 6,969,087   | 6,969,087  |
| 当期末残高                   | 342,589   | 6,998,000 | 40,236,787  | 47,577,377  | 94,310,221 |

|  |          |
|--|----------|
|  | 評価・換算差額等 |
|--|----------|



|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 | 純資産合計      |
|-------------------------|----------------------|----------------|------------|
| 当期首残高                   | 672,279              | 672,279        | 88,013,413 |
| 当期変動額                   |                      |                |            |
| 企業結合による増加               |                      |                | 1,602,526  |
| 剰余金の配当                  |                      |                | 5,171,039  |
| 当期純利益                   |                      |                | 10,537,601 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 1,265,319            | 1,265,319      | 1,265,319  |
| 当期変動額合計                 | 1,265,319            | 1,265,319      | 8,234,406  |
| 当期末残高                   | 1,937,598            | 1,937,598      | 96,247,820 |

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

|       |        |
|-------|--------|
| 建物    | 5年～50年 |
| 器具備品  | 2年～20年 |
| 投資不動産 | 3年～50年 |

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 5. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づ

き計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

|       | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 建物    | 1,006,606千円            | 498,805千円              |
| 器具備品  | 1,985,072千円            | 1,643,689千円            |
| 投資不動産 | 163,978千円              | 211,090千円              |

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|        | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 預金     | 40,165,058千円           | 39,776,992千円           |
| 未収収益   | 15,046千円               | 12,312千円               |
| 未払手数料  | 790,279千円              | 886,173千円              |
| その他未払金 | 77,007千円               | 105,407千円              |
| 未払費用   | 277,358千円              | 599,493千円              |

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳

|      | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 器具備品 | -                                     | 16,229千円                              |
| 計    | -                                     | 16,229千円                              |

## 2. 固定資産売却損の内訳

|      | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 器具備品 | -                                     | 65,427千円                              |
| 計    | -                                     | 65,427千円                              |

## 3. 固定資産除却損の内訳

|        | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 建物     | 1,047千円                               | 15,825千円                              |
| 器具備品   | 29,762千円                              | 3,986千円                               |
| ソフトウェア | 1,981千円                               | 434千円                                 |
| 計      | 32,791千円                              | 20,246千円                              |

## 4. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|              | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 支払手数料        | 4,893,312千円                           | 5,006,309千円                           |
| 受取利息         | 10,236千円                              | 12,747千円                              |
| 受取賃貸料        | 68,168千円                              | 152,876千円                             |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,947,200千円                           | 132,303千円                             |

## 5. 減損損失

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

| 場所          | 用途     | 種類     | 金額        |
|-------------|--------|--------|-----------|
| 東京都千代田区（本社） | ホームページ | ソフトウェア | 315,350千円 |

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループとしております。

ホームページのリニューアルに伴い、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度については、該当事項はありません。

## 6. 企業結合関連費用

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などでありませぬ。

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 |                   |                   |                   |                  |
| 普通株式  | 211,581           | -                 | -                 | 211,581          |
| 合計    | 211,581           | -                 | -                 | 211,581          |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 6,075,125千円 |
| 1株当たり配当額 | 28,713円     |
| 基準日      | 2022年3月31日  |
| 効力発生日    | 2022年6月29日  |

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 5,171,039千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金       |
| 1株当たり配当額 | 24,440円     |
| 基準日      | 2023年3月31日  |
| 効力発生日    | 2023年6月29日  |

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 |                   |                   |                   |                  |
| 普通株式  | 211,581           | -                 | -                 | 211,581          |
| 合計    | 211,581           | -                 | -                 | 211,581          |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 5,171,039千円 |
| 1株当たり配当額 | 24,440円     |
| 基準日      | 2023年3月31日  |
| 効力発生日    | 2023年6月29日  |

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2024年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 45,747,620千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 216,218円     |
| 基準日      | 2024年3月31日   |
| 効力発生日    | 2024年6月27日   |

## (リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

|     | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 962,809千円              | 681,212千円              |

|     |             |             |
|-----|-------------|-------------|
| 1年超 | 1,532,728千円 | 851,515千円   |
| 合計  | 2,495,537千円 | 1,532,728千円 |

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

## 第38期(2023年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 1,579,691        | 1,579,691  | -      |
| (2) 金銭の信託  | 10,400,000       | 10,400,000 | -      |
| (3) 投資有価証券 | 12,022,365       | 12,022,365 | -      |
| 資産計        | 24,002,056       | 24,002,056 | -      |

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額 159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第38期(2023年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金            | 51,733,041 | -           | -            | -    |
| 金銭の信託             | 10,400,000 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬           | 16,753,855 | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |      |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |      |
| 投資信託              | 1,579,691  | 4,859,714   | 1,433,213    | -    |
| 合計                | 80,466,587 | 4,859,714   | 1,433,213    | -    |

## 第39期(2024年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 15,283           | 15,283     | -      |
| (2) 金銭の信託  | 10,500,500       | 10,500,500 | -      |
| (3) 投資有価証券 | 13,788,071       | 13,788,071 | -      |
| 資産計        | 24,303,855       | 24,303,855 | -      |

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第39期(2024年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 58,206,340 | -           | -            | -      |
| 金銭の信託             | 10,500,500 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 21,064,747 | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 15,283     | 5,351,373   | 347,505      | 11,696 |
| 合計                | 89,786,871 | 5,351,373   | 347,505      | 11,696 |

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価  
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

第38期(2023年3月31日現在)

| 区分     | 時価（千円）    |            |      |            |
|--------|-----------|------------|------|------------|
|        | レベル1      | レベル2       | レベル3 | 合計         |
| 有価証券   | -         | 1,579,691  | -    | 1,579,691  |
| 金銭の信託  | -         | 10,400,000 | -    | 10,400,000 |
| 投資有価証券 | 1,794,704 | 10,227,661 | -    | 12,022,365 |
| 資産計    | 1,794,704 | 22,207,352 | -    | 24,002,056 |

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

第39期(2024年3月31日現在)

| 区分 | 時価（千円） |      |      |    |
|----|--------|------|------|----|
|    | レベル1   | レベル2 | レベル3 | 合計 |

|        |           |            |   |            |
|--------|-----------|------------|---|------------|
| 有価証券   | -         | 15,283     | - | 15,283     |
| 金銭の信託  | -         | 10,500,500 | - | 10,500,500 |
| 投資有価証券 | 2,014,968 | 11,773,103 | - | 13,788,071 |
| 資産計    | 2,014,968 | 22,288,887 | - | 24,303,855 |

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類していません。

（有価証券関係）

### 1. 子会社株式及び関連会社株式

第38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024年3月31日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

### 2. その他有価証券

第38期(2023年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 8,983,713        | 7,558,314    | 1,425,399 |
|                          | 小計  | 8,983,713        | 7,558,314    | 1,425,399 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 15,018,343       | 15,474,760   | 456,417   |
|                          | 小計  | 15,018,343       | 15,474,760   | 456,417   |
| 合計                       |     | 24,002,056       | 23,033,074   | 968,982   |

（注）「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円）を含めております。

第39期(2024年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 17,364,277       | 14,269,984   | 3,094,293 |
|                          | 小計  | 17,364,277       | 14,269,984   | 3,094,293 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                          | 債券  | -                | -            | -         |
|                          | その他 | 6,939,577        | 7,241,136    | 301,559   |
|                          | 小計  | 6,939,577        | 7,241,136    | 301,559   |
| 合計                       |     | 24,303,855       | 21,511,121   | 2,792,733 |

（注）「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

### 3. 売却したその他有価証券

## 第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 種類  | 売却額（千円）   | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | 17,240    | -           | 14,120      |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 1,551,405 | 387,113     | 1,708       |
| 合計  | 1,568,645 | 387,113     | 15,828      |

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

| 種類  | 売却額（千円）   | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | -         | -           | -           |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 3,750,272 | 464,927     | 57,011      |
| 合計  | 3,750,272 | 464,927     | 57,011      |

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について104,554千円（その他有価証券のその他104,554千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第38期<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） | 第39期<br>（自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日） |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高  | 3,723,521 千円                          | 3,582,778 千円                          |
| 勤務費用         | 196,190                               | 182,947                               |
| 利息費用         | 25,925                                | 39,626                                |
| 数理計算上の差異の発生額 | 186,130                               | 79,379                                |
| 退職給付の支払額     | 176,727                               | 300,286                               |
| 過去勤務費用の発生額   | -                                     | -                                     |
| 企業結合による影響額   | -                                     | 226,499                               |
| 退職給付債務の期末残高  | 3,582,778                             | 3,652,185                             |

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第38期<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） | 第39期<br>（自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日） |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 年金資産の期首残高    | 2,583,927 千円                          | 2,425,752 千円                          |
| 期待運用収益       | 46,453                                | 43,626                                |
| 数理計算上の差異の発生額 | 103,934                               | 227,699                               |
| 事業主からの拠出額    | -                                     | -                                     |
| 退職給付の支払額     | 100,694                               | 204,536                               |
| 年金資産の期末残高    | 2,425,752                             | 2,492,542                             |



## (3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

|                     | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|---------------------|------------------------|------------------------|
| 積立型制度の<br>退職給付債務    | 2,468,195 千円           | 2,250,427 千円           |
| 年金資産                | 2,425,752              | 2,492,542              |
|                     | 42,442                 | 242,114                |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 1,114,583              | 1,401,758              |
| 未積立退職給付債務           | 1,157,025              | 1,159,643              |
| 未認識数理計算上の差異         | 281,343                | 558,841                |
| 未認識過去勤務費用           | 223,319                | 157,957                |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,215,049              | 1,560,527              |
| 退職給付引当金             | 1,333,882              | 1,608,101              |
| 前払年金費用              | 118,832                | 47,573                 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 1,215,049              | 1,560,527              |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                     | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 勤務費用                | 196,190 千円                            | 182,947 千円                            |
| 利息費用                | 25,925                                | 39,626                                |
| 期待運用収益              | 46,453                                | 43,626                                |
| 数理計算上の差異の<br>費用処理額  | 6,532                                 | 29,581                                |
| 過去勤務費用の費用処理額        | 65,361                                | 65,361                                |
| 退職給付制度の統合に係る<br>調整額 | -                                     | 34,505                                |
| その他                 | 1,600                                 | 2,196                                 |
| 確定給付制度に係る<br>退職給付費用 | 236,091                               | 251,429                               |

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券  | 63.6 %                 | 62.0 %                 |
| 株式  | 34.2                   | 35.9                   |
| その他 | 2.2                    | 2.1                    |
| 合計  | 100                    | 100                    |

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数値計算上の計算基礎

|           | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率       | 0.066～1.13%            | 1.39～1.41%             |
| 長期期待運用収益率 | 1.5～1.8%               | 1.5～1.8%               |

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

|              | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産       |                        |                        |
| 減損損失         | 499,742千円              | 389,750千円              |
| 投資有価証券評価損    | 47,876                 | 30,021                 |
| 未払事業税        | 169,997                | 126,161                |
| 賞与引当金        | 260,221                | 362,002                |
| 役員賞与引当金      | 29,828                 | 33,564                 |
| 役員退職慰労引当金    | 23,169                 | 9,218                  |
| 退職給付引当金      | 408,434                | 492,400                |
| 減価償却超過額      | 227,100                | 199,986                |
| 差入保証金        | 52,869                 | -                      |
| 資産除去債務       | -                      | 16,900                 |
| 時効後支払損引当金    | 77,865                 | 76,657                 |
| その他          | 212,315                | 227,182                |
| 繰延税金資産 小計    | 2,009,420              | 1,963,847              |
| 評価性引当額       | -                      | -                      |
| 繰延税金資産 合計    | 2,009,420              | 1,963,847              |
| 繰延税金負債       |                        |                        |
| 前払年金費用       | 36,386                 | 14,567                 |
| その他有価証券評価差額金 | 296,702                | 855,135                |
| その他          | 1,199                  | 5,308                  |
| 繰延税金負債 合計    | 334,288                | 875,010                |
| 繰延税金資産の純額    | 1,675,132              | 1,088,836              |

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024年3月31日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## 3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(企業結合等関係)

当社は、2023年7月31日開催の取締役会において、三菱UFJ不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を2023年10月1日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱UFJ不動産投

資顧問株式会社は、2023年10月1日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023年10月1日付で当社は「三菱UFJアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

## 1. 取引の概要

### (1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

### (2) 企業結合日

2023年10月1日

### (3) 企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱UFJ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

### (4) 結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJアセットマネジメント株式会社

### (5) 企業結合を行った主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

## 2. 会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第21号2019年1月16日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第10号2019年1月16日）」に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

### （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

|                | 第38期<br>(2023年3月31日現在) | 第39期<br>(2024年3月31日現在) |
|----------------|------------------------|------------------------|
| 期首残高           | -                      | -                      |
| 有形固定資産の取得に伴う増加 | -                      | 1,420,750千円            |
| 時の経過による調整額     | -                      | 7,835千円                |
| 期末残高           | -                      | 1,428,586千円            |

### （収益認識関係）

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の6.収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

### （セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第38期(自2022年4月1日 至 2023年3月31日)及び第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

| 種類  | 会社等の名称               | 所在地     | 資本金          | 事業の内容       | 議決権等の所有(被所有)割合      | 関連当事者との関係                                     | 取引の内容                                 | 取引金額(注5)        | 科目     | 期末残高(注5)      |
|-----|----------------------|---------|--------------|-------------|---------------------|---|---------------------------------------|-----------------|--------|---------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513百万円 | 銀行持株会社業     | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税等   | 連結納税等に<br>伴う支払<br>(注1)                | 3,947,200<br>千円 | その他未払金 | 77,007<br>千円  |
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株)         | 東京都千代田区 | 324,279百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0% | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 4,893,312<br>千円 | 未払手数料  | 790,279<br>千円 |
|     |                      |         |              |             |                     | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 463,416<br>千円   | 未払費用   | 253,093<br>千円 |

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

| 種類  | 会社等の名称               | 所在地     | 資本金          | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合      | 関連当事者との関係 | 取引の内容                             | 取引金額(注5)      | 科目     | 期末残高(注5)      |
|-----|----------------------|---------|--------------|---------|---------------------|-----------|-----------------------------------|---------------|--------|---------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513百万円 | 銀行持株会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0% | グループ通算制度  | グループ通算<br>制度に伴う通<br>算税効果額<br>(注4) | 132,303<br>千円 | その他未払金 | 105,407<br>千円 |

|     |                  |                 |                |             |                     |   |                                       |                 |       |               |
|-----|------------------|-----------------|----------------|-------------|---------------------|---|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円 | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0% | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,006,309<br>千円 | 未払手数料 | 886,173<br>千円 |
|     |                  |                 |                |             |                     | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 463,831<br>千円   | 未払費用  | 260,800<br>千円 |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
4. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。
5. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

| 種類          | 会社等の<br>名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|----------------------------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|---|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ<br>銀行                   | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,052,979<br>千円 | 未払手数料 | 868,785<br>千円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円    | 証券業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 6,661,991<br>千円 | 未払手数料 | 1,218,051<br>千円 |

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

| 種類          | 会社等の<br>名称     | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|----------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|---|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ<br>銀行 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,354,007<br>千円 | 未払手数料 | 1,028,586<br>千円 |

|             |                                |                 |               |     |    |   |                                       |                 |       |                 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 7,493,449<br>千円 | 未払手数料 | 1,449,414<br>千円 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

## (1株当たり情報)

|              | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 415,979.76円                           | 454,898.22円                           |
| 1株当たり当期純利益金額 | 48,881.17円                            | 49,804.10円                            |

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                     | 第38期<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 第39期<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円)        | 10,342,327                            | 10,537,601                            |
| 普通株主に帰属しない金額 (千円)   | -                                     | -                                     |
| 普通株式に係る当期純利益金額 (千円) | 10,342,327                            | 10,537,601                            |
| 普通株式の期中平均株式数 (株)    | 211,581                               | 211,581                               |

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

## (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2024年3月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額<br>(2024年3月末現在) | 事業の内容 |
|----|-----------------------|-------|
|    |                       |       |

|               |         |     |                               |
|---------------|---------|-----|-------------------------------|
| 株式会社八十二銀行     | 52,243  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279 | 百万円 | 銀行業務および信託業務を営んでいます。           |
| 八十二証券株式会社     | 3,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| auカブコム証券株式会社  | 7,196   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社SBI証券     | 54,323  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社      | 19,495  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| SMB C日興証券株式会社 | 135,000 | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| マネックス証券株式会社   | 13,195  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 松井証券株式会社      | 11,945  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

### 3【資本関係】

<訂正前>

該当ありません。(2024年4月1日現在)

(注)関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

<訂正後>

該当ありません。(2024年7月末現在)

(注)関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

独立監査人の監査報告書

2024年10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ国内債券インデックスファンドの2024年1月27日から2024年7月26日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国内債券インデックスファンドの2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。



### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

### 利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2024年6月7日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田 信之

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。