

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	日本債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	日本債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日本債券インデックスe	外貨建資産への投資は行いません。株式への投資は転換社債を転換したものと、新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。以下同じ。)を行使したものに限り、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	日本債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと、新株予約権を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

日本債券インデックスe

運用報告書(全体版)

第10期(決算日 2020年1月22日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入率	債券先比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%		百万円
第6期(2016年1月22日)	11,155	0	1.2	370.303	1.6	99.0	0.5		2,639
第7期(2017年1月23日)	11,362	0	1.9	378.843	2.3	99.3	0.2		2,280
第8期(2018年1月22日)	11,343	0	△0.2	379.795	0.3	99.4	0.2		2,083
第9期(2019年1月22日)	11,451	0	1.0	384.988	1.4	99.3	0.3		1,970
第10期(2020年1月22日)	11,536	0	0.7	389.521	1.2	99.7	—		1,931

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2019年1月22日	11,451	—	384.988	—	99.3	0.3
1月末	11,468	0.1	385.580	0.2	99.2	0.4
2月末	11,488	0.3	386.427	0.4	99.2	0.4
3月末	11,565	1.0	389.143	1.1	99.4	0.3
4月末	11,524	0.6	387.945	0.8	99.5	0.3
5月末	11,592	1.2	390.322	1.4	99.4	0.1
6月末	11,658	1.8	392.695	2.0	99.6	0.1
7月末	11,667	1.9	393.155	2.1	99.6	—
8月末	11,820	3.2	398.496	3.5	99.6	—
9月末	11,690	2.1	394.271	2.4	99.6	0.1
10月末	11,639	1.6	392.608	2.0	99.7	—
11月末	11,594	1.2	391.325	1.6	99.5	0.1
12月末	11,556	0.9	390.136	1.3	108.1	0.0
(当期末)						
2020年1月22日	11,536	0.7	389.521	1.2	99.7	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

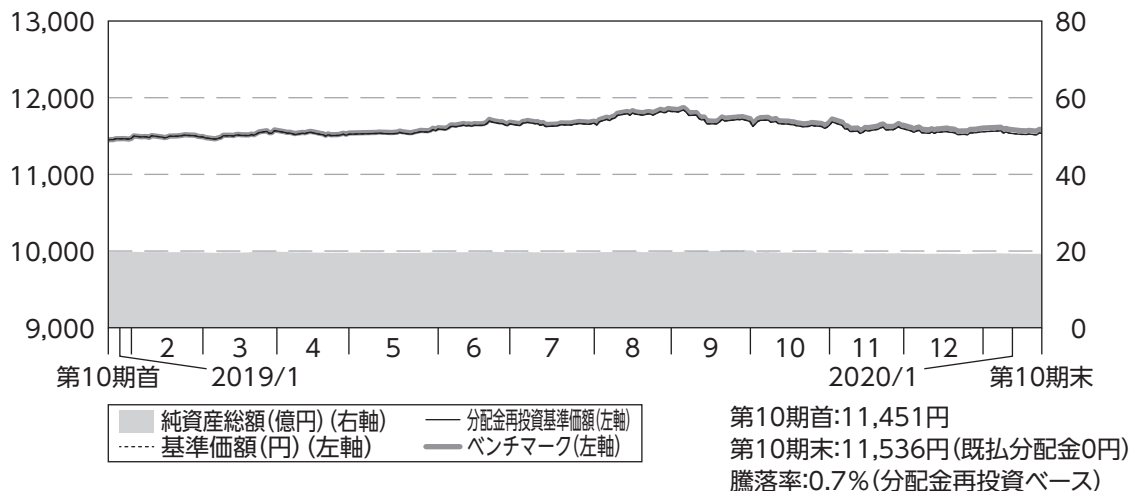
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村証券株式会社公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2019年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額(分配金再投資ベース)は、上昇しました。

期初から2019年9月上旬にかけて、米国の利下げ観測が高まった影響に加え、6月に日銀総裁が長期金利の変動幅について「ある程度弾力的に対応していくことが適当」と発言したこと、さらに8月には米中貿易摩擦の激化により、国内金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇しました。9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利が、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから国内金利の上昇が抑えられ、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境



期初から2019年9月上旬にかけて、米国の利下げ観測が高まった影響に加え、6月に日銀総裁が長期金利の変動幅について「ある程度弾力的に対応していくことが適当」と発言したこと、さらに8月には米中貿易摩擦の激化により、国内金利は低下が続き、9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利は、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから利回りの上昇が抑えられ、国内金利はレンジ内推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「日本債券マザーファンド」への投資を通じて、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「日本債券マザーファンド」の運用経過】

(1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

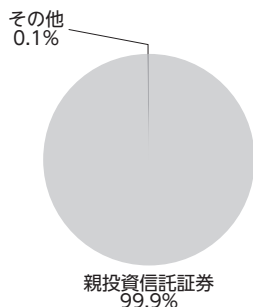
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

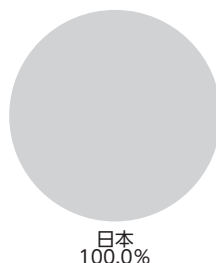
	当期末
	2020年1月22日
日本債券マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

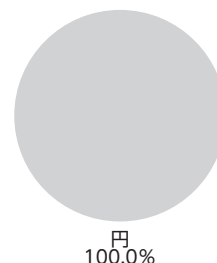
○資産別配分



○国別配分



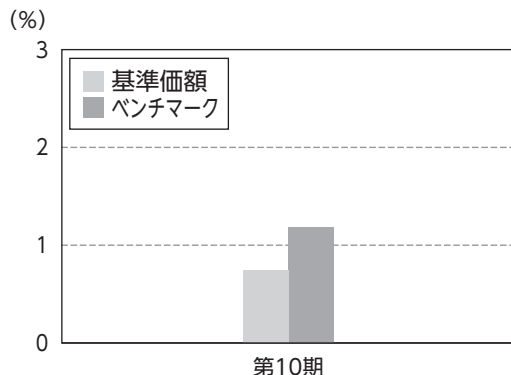
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離の主な要因は、信託報酬によるものです。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第10期	
	2019年1月23日～2020年1月22日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	1,536	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

公社債への実質投資は、わが国で発行された公社債に分散投資を行い、NOMURA－BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年1月23日～2020年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	47円	0.407%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{期中の平均基準価額}}{\text{期中の平均基準価額}} \times \text{信託報酬率}$ 期中の平均基準価額は11,605円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(18)	(0.154)	
(販売会社)	(24)	(0.209)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	48	0.412	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

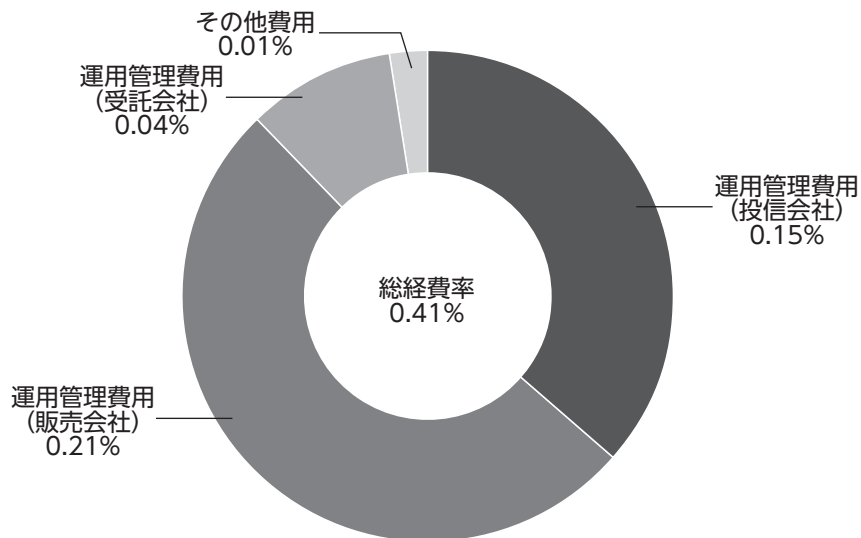
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.41%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 349,797	千円 487,307	千口 394,953	千円 548,801

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 7	百万円 7	% 100.0	百万円 7	百万円 7	% 100.0
コール・ローン	1,230	201	16.3	1,229	201	16.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本債券マザーファンド>

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 2,324	百万円 2,324	% 100.0	百万円 2,361	百万円 2,361	% 100.0
コール・ローン	301,528	41,076	13.6	302,147	41,076	13.6

<平均保有割合 0.6%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 1,438,171	千口 1,393,015	千円 1,930,718

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、263,895,892千口です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 1,930,718	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,645	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	1,942,363	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年1月22日現在
(A) 資 産	1,942,363,828円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,657,921
日本債券マザーファンド(評価額)	1,930,718,881
未 収 入 金	3,987,026
(B) 負 債	10,678,899
未 払 解 約 金	6,632,867
未 払 信 託 報 酬	3,992,137
未 払 利 息	4
そ の 他 未 払 費 用	53,891
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,931,684,929
元 本	1,674,479,068
次 期 繰 越 損 益 金	257,205,861
(D) 受 益 権 総 口 数	1,674,479,068口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,536円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年1月23日 至 2020年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	△2,768円
受 取 利 息	3
支 払 利 息	△2,771
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,263,094
売 買 益	23,356,061
売 買 損	△9,092,967
(C) 信 託 報 酬 等	△7,993,503
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,266,823
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	27,275,656
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	223,663,382
(配 当 等 相 当 額)	(119,715,416)
(売 買 損 益 相 当 額)	(103,947,966)
(G) 計 (D+E+F)	257,205,861
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	257,205,861
追 加 信 託 差 損 益 金	223,663,382
(配 当 等 相 当 額)	(120,071,188)
(売 買 損 益 相 当 額)	(103,592,194)
分 配 準 備 積 立 金	38,388,686
繰 越 損 益 金	△4,846,207

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,721,260,903円、期中追加設定元本額は577,359,463円、期中一部解約元本額は624,141,298円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	8,397,584円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	218,817,175円
(D) 分配準備積立金額	29,991,102円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	257,205,861円
(F) 期末残存口数	1,674,479,068口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	1,536円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

日本債券マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2020年1月22日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年1月23日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	%			
第15期(2016年1月22日)	13,170	1.7	370.303	1.6	99.0	0.5	315,515
第16期(2017年1月23日)	13,474	2.3	378.843	2.3	99.3	0.2	318,745
第17期(2018年1月22日)	13,510	0.3	379.795	0.3	99.4	0.2	312,259
第18期(2019年1月22日)	13,698	1.4	384.988	1.4	99.4	0.3	302,423
第19期(2020年1月22日)	13,860	1.2	389.521	1.2	99.8	—	365,754

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率	騰落率	%		
(当期首) 2019年1月22日	13,698	—	384.988	—	99.4	0.3
1月末	13,720	0.2	385.580	0.2	99.2	0.4
2月末	13,749	0.4	386.427	0.4	99.2	0.4
3月末	13,845	1.1	389.143	1.1	99.5	0.3
4月末	13,801	0.8	387.945	0.8	99.5	0.3
5月末	13,888	1.4	390.322	1.4	99.5	0.1
6月末	13,972	2.0	392.695	2.0	99.6	0.1
7月末	13,988	2.1	393.155	2.1	99.7	—
8月末	14,176	3.5	398.496	3.5	99.7	—
9月末	14,026	2.4	394.271	2.4	99.7	0.1
10月末	13,970	2.0	392.608	2.0	99.7	—
11月末	13,921	1.6	391.325	1.6	99.5	0.1
12月末	13,880	1.3	390.136	1.3	108.1	0.0
(当期末) 2020年1月22日	13,860	1.2	389.521	1.2	99.8	—

(注1)騰落率は期首比です。

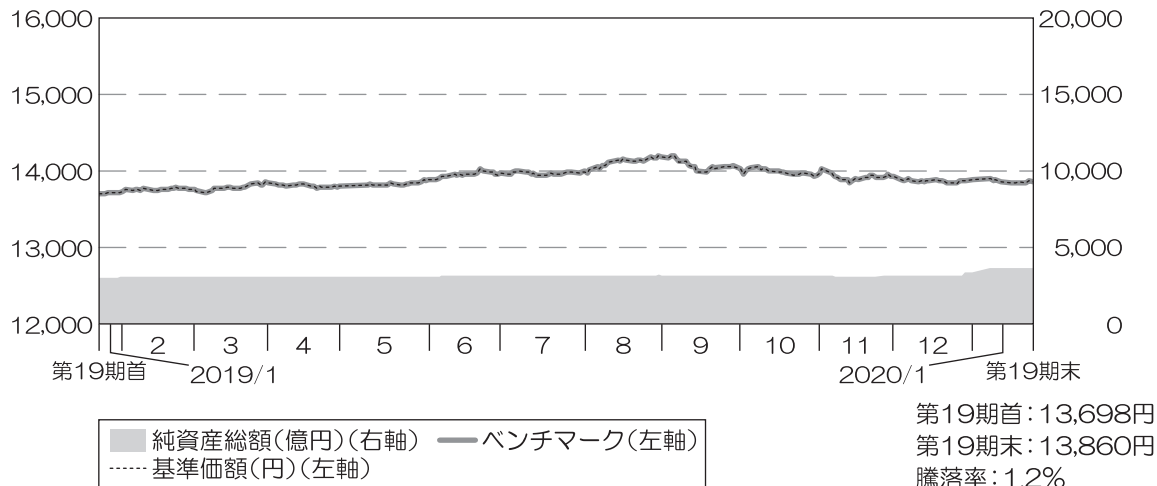
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



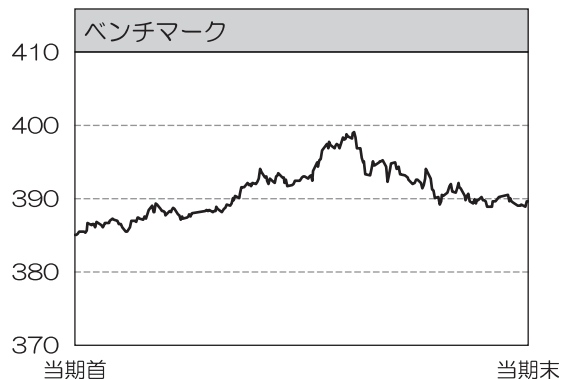
(注)ベンチマークは、2019年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、上昇しました。

期初から2019年9月上旬にかけて、米国の利下げ観測が高まった影響に加え、6月に日銀総裁が長期金利の変動幅について「ある程度弾力的に対応していくことが適当」と発言したこと、さらに8月には米中貿易摩擦の激化により、国内金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇しました。9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利が、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから国内金利の上昇が抑えられ、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境



期初から2019年9月上旬にかけて、米国の利下げ観測が高まった影響に加え、6月に日銀総裁が長期金利の変動幅について「ある程度弾力的に対応していくことが適当」と発言したこと、さらに8月には米中貿易摩擦の激化により、国内金利は低下が続きましました。9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利は、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから利回りの上昇が抑えられ、国内金利はレンジ内推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

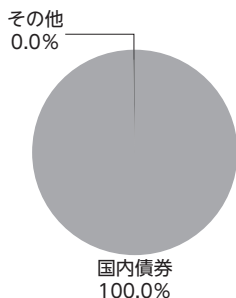
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第138回利付国債(5年)	日本	2.2%
2	第141回利付国債(5年)	日本	2.0%
3	第407回利付国債(2年)	日本	1.2%
4	第340回利付国債(10年)	日本	1.1%
5	第353回利付国債(10年)	日本	1.1%
6	第356回利付国債(10年)	日本	1.1%

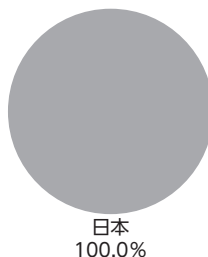
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第348回利付国債(10年)	日本	1.1%
8	第338回利付国債(10年)	日本	1.1%
9	第127回利付国債(5年)	日本	1.0%
10	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%
組入銘柄数			754

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

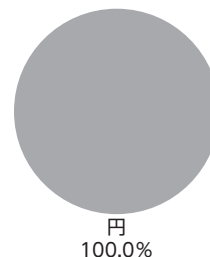
○資産別配分



○国別配分



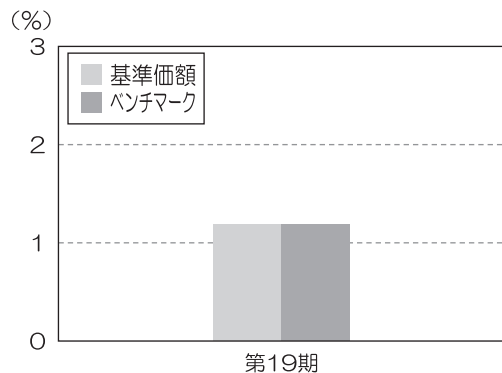
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年1月23日～2020年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(13,911円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 101,249,840	千円 47,198,529
	地 方 債 証 券	3,997,566	1,015,851
	特 殊 債 券	5,617,614	1,022,685 (343,378)
	社 債 券	4,395,037	2,122,896

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 15,790	百万円 16,707	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人*との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 2,324	百万円 2,324	100.0	百万円 2,361	百万円 2,361	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	301,528	41,076	13.6	302,147	41,076	13.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

* 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

〈国内(邦貨建)公社債〉

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBBB格以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国 債 証 券	278,615,000 (1,950,000)	304,794,630 (1,964,196)	83.3 (0.5)	— (—)	55.4 (—)	19.1 (0.5)	8.8 (—)	
地 方 債 証 券	18,620,230 (18,420,230)	19,628,127 (19,386,258)	5.4 (5.3)	— (—)	2.9 (2.9)	1.9 (1.9)	0.6 (0.6)	
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	22,027,570 (21,827,570)	23,672,581 (23,436,119)	6.5 (6.4)	— (—)	4.4 (4.4)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)	
金 融 債 証 券	1,700,000 (1,700,000)	1,702,004 (1,702,004)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.2 (0.2)	
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	14,700,000 (14,700,000)	15,161,949 (15,161,949)	4.1 (4.1)	— (—)	1.7 (1.7)	1.8 (1.8)	0.6 (0.6)	
合 計	335,662,800 (58,597,800)	364,959,292 (61,650,526)	99.8 (16.9)	— (—)	64.5 (8.9)	24.6 (6.1)	10.7 (1.8)	

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

当 期 末					当 期 末				
銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
国債証券					第139回利付国債(5年)	0.1	2,860,000	2,886,855	2024/3/20
第397回利付国債(2年)	0.1	1,290,000	1,293,031	2021/2/1	第140回利付国債(5年)	0.1	1,470,000	1,484,317	2024/6/20
第398回利付国債(2年)	0.1	3,260,000	3,268,247	2021/3/1	第141回利付国債(5年)	0.1	7,060,000	7,131,023	2024/9/20
第399回利付国債(2年)	0.1	1,440,000	1,443,931	2021/4/1	第142回利付国債(5年)	0.1	140,000	141,450	2024/12/20
第400回利付国債(2年)	0.1	400,000	401,168	2021/5/1	第1回利付国債(40年)	2.4	230,000	351,285	2048/3/20
第401回利付国債(2年)	0.1	1,010,000	1,013,141	2021/6/1	第2回利付国債(40年)	2.2	350,000	519,914	2049/3/20
第402回利付国債(2年)	0.1	490,000	491,617	2021/7/1	第3回利付国債(40年)	2.2	380,000	568,639	2050/3/20
第403回利付国債(2年)	0.1	670,000	672,345	2021/8/1	第4回利付国債(40年)	2.2	595,000	899,152	2051/3/20
第405回利付国債(2年)	0.1	130,000	130,505	2021/10/1	第5回利付国債(40年)	2.0	415,000	608,502	2052/3/20
第406回利付国債(2年)	0.1	740,000	743,019	2021/11/1	第6回利付国債(40年)	1.9	610,000	882,999	2053/3/20
第407回利付国債(2年)	0.1	4,470,000	4,488,684	2021/12/1	第7回利付国債(40年)	1.7	1,480,000	2,064,333	2054/3/20
第408回利付国債(2年)	0.1	480,000	482,097	2022/1/1	第8回利付国債(40年)	1.4	960,000	1,253,932	2055/3/20
第127回利付国債(5年)	0.1	3,650,000	3,659,672	2021/3/20	第9回利付国債(40年)	0.4	780,000	764,306	2056/3/20
第128回利付国債(5年)	0.1	2,330,000	2,337,525	2021/6/20	第10回利付国債(40年)	0.9	970,000	1,114,258	2057/3/20
第129回利付国債(5年)	0.1	1,980,000	1,987,563	2021/9/20	第11回利付国債(40年)	0.8	1,260,000	1,405,882	2058/3/20
第130回利付国債(5年)	0.1	1,880,000	1,888,084	2021/12/20	第12回利付国債(40年)	0.5	310,000	313,075	2059/3/20
第131回利付国債(5年)	0.1	1,910,000	1,919,473	2022/3/20	第313回利付国債(10年)	1.3	910,000	924,978	2021/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	1,125,000	1,131,232	2022/6/20	第314回利付国債(10年)	1.1	250,000	253,535	2021/3/20
第133回利付国債(5年)	0.1	1,670,000	1,680,454	2022/9/20	第315回利付国債(10年)	1.2	1,020,000	1,039,023	2021/6/20
第134回利付国債(5年)	0.1	3,330,000	3,352,810	2022/12/20	第316回利付国債(10年)	1.1	360,000	366,206	2021/6/20
第135回利付国債(5年)	0.1	1,950,000	1,964,196	2023/3/20	第317回利付国債(10年)	1.1	280,000	285,695	2021/9/20
第136回利付国債(5年)	0.1	2,070,000	2,086,270	2023/6/20	第318回利付国債(10年)	1.0	1,050,000	1,069,614	2021/9/20
第137回利付国債(5年)	0.1	1,880,000	1,895,886	2023/9/20	第319回利付国債(10年)	1.1	560,000	573,053	2021/12/20
第138回利付国債(5年)	0.1	7,930,000	8,000,021	2023/12/20					

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円	千円	
第320回利付国債(10年)	1.0	1,270,000	1,297,178	2021/12/20	
第321回利付国債(10年)	1.0	1,540,000	1,577,406	2022/3/20	
第322回利付国債(10年)	0.9	860,000	879,031	2022/3/20	
第323回利付国債(10年)	0.9	690,000	707,063	2022/6/20	
第324回利付国債(10年)	0.8	1,660,000	1,697,034	2022/6/20	
第325回利付国債(10年)	0.8	2,245,000	2,300,361	2022/9/20	
第326回利付国債(10年)	0.7	560,000	573,473	2022/12/20	
第327回利付国債(10年)	0.8	1,010,000	1,037,249	2022/12/20	
第328回利付国債(10年)	0.6	1,930,000	1,974,293	2023/3/20	
第329回利付国債(10年)	0.8	2,035,000	2,099,367	2023/6/20	
第330回利付国債(10年)	0.8	1,650,000	1,706,067	2023/9/20	
第331回利付国債(10年)	0.6	830,000	852,102	2023/9/20	
第332回利付国債(10年)	0.6	2,270,000	2,334,604	2023/12/20	
第333回利付国債(10年)	0.6	2,290,000	2,358,814	2024/3/20	
第334回利付国債(10年)	0.6	2,420,000	2,497,149	2024/6/20	
第335回利付国債(10年)	0.5	2,295,000	2,361,623	2024/9/20	
第336回利付国債(10年)	0.5	270,000	278,262	2024/12/20	
第337回利付国債(10年)	0.3	1,870,000	1,908,765	2024/12/20	
第338回利付国債(10年)	0.4	3,780,000	3,881,908	2025/3/20	
第339回利付国債(10年)	0.4	3,415,000	3,511,610	2025/6/20	
第340回利付国債(10年)	0.4	3,990,000	4,108,183	2025/9/20	
第341回利付国債(10年)	0.3	2,150,000	2,203,707	2025/12/20	
第342回利付国債(10年)	0.1	3,190,000	3,232,490	2026/3/20	
第343回利付国債(10年)	0.1	2,055,000	2,082,824	2026/6/20	
第344回利付国債(10年)	0.1	2,320,000	2,352,665	2026/9/20	
第345回利付国債(10年)	0.1	2,580,000	2,617,693	2026/12/20	
第346回利付国債(10年)	0.1	2,255,000	2,288,306	2027/3/20	
第347回利付国債(10年)	0.1	2,315,000	2,349,539	2027/6/20	
第348回利付国債(10年)	0.1	3,950,000	4,007,867	2027/9/20	
第349回利付国債(10年)	0.1	2,605,000	2,642,303	2027/12/20	
第350回利付国債(10年)	0.1	2,590,000	2,626,104	2028/3/20	
第351回利付国債(10年)	0.1	2,080,000	2,108,100	2028/6/20	
第352回利付国債(10年)	0.1	1,770,000	1,793,080	2028/9/20	
第353回利付国債(10年)	0.1	4,020,000	4,070,290	2028/12/20	
第354回利付国債(10年)	0.1	2,630,000	2,661,375	2029/3/20	
第355回利付国債(10年)	0.1	2,890,000	2,922,657	2029/6/20	
第356回利付国債(10年)	0.1	4,020,000	4,064,702	2029/9/20	
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	63,551	2029/9/20	
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	124,184	2030/2/20	
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	173,052	2030/5/20	
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	249,103	2030/11/20	
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	223,941	2031/5/20	
第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	344,584	2031/11/20	
第7回利付国債(30年)	2.3	190,000	241,902	2032/5/20	
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	210,351	2032/12/20	
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	192,319	2033/3/20	
第11回利付国債(30年)	1.7	280,000	339,486	2033/6/20	
第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	469,703	2033/9/20	
第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	440,604	2033/12/20	
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	461,699	2034/3/20	
第15回利付国債(30年)	2.5	800,000	1,069,616	2034/6/20	
第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	335,462	2034/9/20	
第17回利付国債(30年)	2.4	420,000	559,419	2034/12/20	
第18回利付国債(30年)	2.3	340,000	448,973	2035/3/20	
第19回利付国債(30年)	2.3	300,000	397,419	2035/6/20	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円	千円	
第20回利付国債(30年)	2.5	290,000	393,953	2035/9/20	
第21回利付国債(30年)	2.3	360,000	479,131	2035/12/20	
第22回利付国債(30年)	2.5	380,000	519,197	2036/3/20	
第23回利付国債(30年)	2.5	370,000	507,188	2036/6/20	
第24回利付国債(30年)	2.5	335,000	460,692	2036/9/20	
第25回利付国債(30年)	2.3	335,000	450,786	2036/12/20	
第26回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,281,203	2037/3/20	
第27回利付国債(30年)	2.5	490,000	681,629	2037/9/20	
第28回利付国債(30年)	2.5	1,050,000	1,467,900	2038/3/20	
第29回利付国債(30年)	2.4	520,000	721,219	2038/9/20	
第30回利付国債(30年)	2.3	555,000	763,657	2039/3/20	
第31回利付国債(30年)	2.2	670,000	913,933	2039/9/20	
第32回利付国債(30年)	2.3	955,000	1,328,070	2040/3/20	
第33回利付国債(30年)	2.0	1,180,000	1,579,418	2040/9/20	
第34回利付国債(30年)	2.2	1,420,000	1,968,404	2041/3/20	
第35回利付国債(30年)	2.0	1,120,000	1,513,355	2041/9/20	
第36回利付国債(30年)	2.0	1,480,000	2,008,892	2042/3/20	
第37回利付国債(30年)	1.9	1,155,000	1,550,344	2042/9/20	
第38回利付国債(30年)	1.8	895,000	1,185,462	2043/3/20	
第39回利付国債(30年)	1.9	1,040,000	1,403,906	2043/6/20	
第40回利付国債(30年)	1.8	545,000	724,779	2043/9/20	
第41回利付国債(30年)	1.7	565,000	739,794	2043/12/20	
第42回利付国債(30年)	1.7	700,000	917,609	2044/3/20	
第43回利付国債(30年)	1.7	985,000	1,292,704	2044/6/20	
第44回利付国債(30年)	1.7	670,000	881,304	2044/9/20	
第45回利付国債(30年)	1.5	770,000	977,337	2044/12/20	
第46回利付国債(30年)	1.5	880,000	1,117,828	2045/3/20	
第47回利付国債(30年)	1.6	795,000	1,030,455	2045/6/20	
第48回利付国債(30年)	1.4	760,000	948,989	2045/9/20	
第49回利付国債(30年)	1.4	1,580,000	1,976,406	2045/12/20	
第50回利付国債(30年)	0.8	830,000	915,099	2046/3/20	
第51回利付国債(30年)	0.3	1,315,000	1,285,123	2046/6/20	
第52回利付国債(30年)	0.5	950,000	975,232	2046/9/20	
第53回利付国債(30年)	0.6	1,070,000	1,124,709	2046/12/20	
第54回利付国債(30年)	0.8	715,000	787,944	2047/3/20	
第55回利付国債(30年)	0.8	840,000	926,410	2047/6/20	
第56回利付国債(30年)	0.8	940,000	1,036,209	2047/9/20	
第57回利付国債(30年)	0.8	590,000	650,876	2047/12/20	
第58回利付国債(30年)	0.8	1,460,000	1,609,810	2048/3/20	
第59回利付国債(30年)	0.7	570,000	613,616	2048/6/20	
第60回利付国債(30年)	0.9	1,150,000	1,299,500	2048/9/20	
第61回利付国債(30年)	0.7	710,000	763,207	2048/12/20	
第62回利付国債(30年)	0.5	360,000	367,477	2049/3/20	
第63回利付国債(30年)	0.4	1,080,000	1,071,532	2049/6/20	
第64回利付国債(30年)	0.4	1,130,000	1,119,604	2049/9/20	
第49回利付国債(20年)	2.1	280,000	287,246	2021/3/22	
第50回利付国債(20年)	1.9	590,000	603,900	2021/3/22	
第51回利付国債(20年)	2.0	240,000	247,212	2021/6/21	
第52回利付国債(20年)	2.1	430,000	445,953	2021/9/21	
第53回利付国債(20年)	2.1	350,000	364,882	2021/12/20	
第54回利付国債(20年)	2.2	290,000	292,443	2021/12/20	
第55回利付国債(20年)	2.0	480,000	512,510	2022/3/21	
第56回利付国債(20年)	2.0	410,000	431,020	2022/6/20	
第57回利付国債(20年)	1.9	360,000	377,586	2022/6/20	
第58回利付国債(20年)	1.9	250,000	263,497	2022/9/20	

当期末					当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
第59回利付国債(20年)	1.7	440,000	463,425	2022/12/20	第114回利付国債(20年)	2.1	610,000	737,270	2029/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	570,000	595,359	2022/12/20	第115回利付国債(20年)	2.2	270,000	329,008	2029/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	390,000	403,887	2023/3/20	第116回利付国債(20年)	2.2	260,000	317,915	2030/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	250,000	257,907	2023/6/20	第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,309,608	2030/3/20
第63回利付国債(20年)	1.8	570,000	607,523	2023/6/20	第118回利付国債(20年)	2.0	450,000	543,082	2030/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	410,000	440,504	2023/9/20	第119回利付国債(20年)	1.8	320,000	379,539	2030/6/20
第65回利付国債(20年)	1.9	370,000	399,337	2023/12/20	第120回利付国債(20年)	1.6	1,330,000	1,549,809	2030/6/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	354,868	2023/12/20	第121回利付国債(20年)	1.9	750,000	899,947	2030/9/20
第67回利付国債(20年)	1.9	310,000	336,067	2024/3/20	第122回利付国債(20年)	1.8	490,000	582,757	2030/9/20
第68回利付国債(20年)	2.2	230,000	252,220	2024/3/20	第123回利付国債(20年)	2.1	480,000	588,336	2030/12/20
第69回利付国債(20年)	2.1	530,000	578,987	2024/3/20	第124回利付国債(20年)	2.0	320,000	388,742	2030/12/20
第70回利付国債(20年)	2.4	490,000	544,566	2024/6/20	第125回利付国債(20年)	2.2	500,000	620,265	2031/3/20
第71回利付国債(20年)	2.2	400,000	441,000	2024/6/20	第126回利付国債(20年)	2.0	450,000	548,239	2031/3/20
第72回利付国債(20年)	2.1	710,000	783,634	2024/9/20	第127回利付国債(20年)	1.9	400,000	482,880	2031/3/20
第73回利付国債(20年)	2.0	540,000	596,354	2024/12/20	第128回利付国債(20年)	1.9	680,000	823,595	2031/6/20
第74回利付国債(20年)	2.1	310,000	343,883	2024/12/20	第129回利付国債(20年)	1.8	260,000	311,953	2031/6/20
第75回利付国債(20年)	2.1	360,000	401,335	2025/3/20	第130回利付国債(20年)	1.8	680,000	817,917	2031/9/20
第76回利付国債(20年)	1.9	340,000	375,516	2025/3/20	第131回利付国債(20年)	1.7	1,120,000	1,334,177	2031/9/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	321,795	2025/3/20	第132回利付国債(20年)	1.7	600,000	716,754	2031/12/20
第78回利付国債(20年)	1.9	20,000	22,192	2025/6/20	第133回利付国債(20年)	1.8	620,000	747,980	2031/12/20
第79回利付国債(20年)	2.0	100,000	111,504	2025/6/20	第134回利付国債(20年)	1.8	1,420,000	1,718,100	2032/3/20
第80回利付国債(20年)	2.1	250,000	280,120	2025/6/20	第135回利付国債(20年)	1.7	375,000	449,201	2032/3/20
第81回利付国債(20年)	2.0	180,000	201,679	2025/9/20	第136回利付国債(20年)	1.6	450,000	533,610	2032/3/20
第82回利付国債(20年)	2.1	485,000	546,173	2025/9/20	第137回利付国債(20年)	1.7	460,000	552,211	2032/6/20
第83回利付国債(20年)	2.1	70,000	79,221	2025/12/20	第138回利付国債(20年)	1.5	450,000	529,141	2032/6/20
第84回利付国債(20年)	2.0	190,000	213,898	2025/12/20	第139回利付国債(20年)	1.6	530,000	629,724	2032/6/20
第85回利付国債(20年)	2.1	360,000	409,413	2026/3/20	第140回利付国債(20年)	1.7	1,195,000	1,438,481	2032/9/20
第86回利付国債(20年)	2.3	240,000	275,918	2026/3/20	第141回利付国債(20年)	1.7	780,000	941,421	2032/12/20
第87回利付国債(20年)	2.2	170,000	194,388	2026/3/20	第142回利付国債(20年)	1.8	540,000	658,648	2032/12/20
第88回利付国債(20年)	2.3	340,000	392,856	2026/6/20	第143回利付国債(20年)	1.6	1,200,000	1,435,548	2033/3/20
第89回利付国債(20年)	2.2	320,000	367,683	2026/6/20	第144回利付国債(20年)	1.5	1,400,000	1,656,606	2033/3/20
第90回利付国債(20年)	2.2	420,000	485,066	2026/9/20	第145回利付国債(20年)	1.7	1,210,000	1,467,064	2033/6/20
第91回利付国債(20年)	2.3	310,000	360,105	2026/9/20	第146回利付国債(20年)	1.7	1,130,000	1,373,594	2033/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	790,000	911,502	2026/12/20	第147回利付国債(20年)	1.6	1,010,000	1,216,120	2033/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	260,000	299,444	2027/3/20	第148回利付国債(20年)	1.5	1,360,000	1,622,316	2034/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	445,000	515,719	2027/3/20	第149回利付国債(20年)	1.5	1,380,000	1,648,506	2034/6/20
第95回利付国債(20年)	2.3	1,100,000	1,296,471	2027/6/20	第150回利付国債(20年)	1.4	2,390,000	2,824,549	2034/9/20
第96回利付国債(20年)	2.1	200,000	232,740	2027/6/20	第151回利付国債(20年)	1.2	1,190,000	1,374,188	2034/12/20
第97回利付国債(20年)	2.2	210,000	246,985	2027/9/20	第152回利付国債(20年)	1.2	1,300,000	1,502,241	2035/3/20
第98回利付国債(20年)	2.1	370,000	432,311	2027/9/20	第153回利付国債(20年)	1.3	2,710,000	3,176,851	2035/6/20
第99回利付国債(20年)	2.1	460,000	539,575	2027/12/20	第154回利付国債(20年)	1.2	1,350,000	1,563,259	2035/9/20
第100回利付国債(20年)	2.2	760,000	901,466	2028/3/20	第155回利付国債(20年)	1.0	1,280,000	1,443,417	2035/12/20
第101回利付国債(20年)	2.4	360,000	432,914	2028/3/20	第156回利付国債(20年)	0.4	1,130,000	1,167,188	2036/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,070,000	1,292,367	2028/6/20	第157回利付国債(20年)	0.2	1,330,000	1,330,000	2036/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	335,000	401,788	2028/6/20	第158回利付国債(20年)	0.5	1,940,000	2,032,169	2036/9/20
第104回利付国債(20年)	2.1	260,000	307,442	2028/6/20	第159回利付国債(20年)	0.6	1,340,000	1,425,317	2036/12/20
第105回利付国債(20年)	2.1	500,000	593,470	2028/9/20	第160回利付国債(20年)	0.7	1,110,000	1,199,055	2037/3/20
第106回利付国債(20年)	2.2	270,000	322,822	2028/9/20	第161回利付国債(20年)	0.6	955,000	1,014,983	2037/6/20
第107回利付国債(20年)	2.1	270,000	321,645	2028/12/20	第162回利付国債(20年)	0.6	1,250,000	1,328,475	2037/9/20
第108回利付国債(20年)	1.9	725,000	850,722	2028/12/20	第163回利付国債(20年)	0.6	955,000	1,014,019	2037/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	290,000	341,370	2029/3/20	第164回利付国債(20年)	0.5	960,000	1,001,673	2038/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	515,000	615,682	2029/3/20	第165回利付国債(20年)	0.5	1,720,000	1,794,080	2038/6/20
第111回利付国債(20年)	2.2	450,000	544,135	2029/6/20	第166回利付国債(20年)	0.7	1,240,000	1,337,079	2038/9/20
第112回利付国債(20年)	2.1	550,000	659,873	2029/6/20	第167回利付国債(20年)	0.5	1,100,000	1,145,507	2038/12/20
第113回利付国債(20年)	2.1	905,000	1,090,117	2029/9/20	第168回利付国債(20年)	0.4	1,490,000	1,522,496	2039/3/20

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第169回利付国債(20年)	0.3	840,000	842,310	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,560,000	2,564,736	2039/9/20
小計		278,615,000	304,794,630	
地方債証券				
第1回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.982	100,000	112,120	2047/9/20
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	109,394	2024/3/19
第7回東京都公募公債(30年)	2.51	200,000	278,594	2038/9/17
第11回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	231,348	2027/3/19
第13回東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	116,593	2027/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	117,785	2028/12/20
第18回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	238,682	2029/3/19
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	118,983	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	100,000	120,324	2029/12/20
第714回東京都公募公債	0.74	100,000	102,133	2022/12/20
第722回東京都公募公債	0.8	200,000	205,458	2023/6/20
第740回東京都公募公債	0.463	100,000	102,270	2024/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	102,095	2025/12/19
第786回東京都公募公債	0.16	200,000	201,462	2028/9/20
平成23年度第4回北海道公募公債	1.21	100,000	101,730	2021/6/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	300,000	303,375	2026/2/26
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	100,000	121,135	2031/1/24
第21回神奈川県公募公債(20年)	1.732	100,000	119,051	2032/9/17
第184回神奈川県公募公債	1.02	100,000	101,432	2021/6/18
第190回神奈川県公募公債	0.88	100,000	102,105	2022/6/20
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	102,136	2023/3/20
第356回大阪府公募公債(10年)	1.06	130,000	132,642	2021/12/27
第363回大阪府公募公債(10年)	0.77	114,000	116,266	2022/8/30
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	200,000	203,782	2023/4/26
第376回大阪府公募公債(10年)	0.82	100,000	103,014	2023/9/27
第403回大阪府公募公債(10年)	0.462	300,000	307,845	2025/12/25
第415回大阪府公募公債(10年)	0.142	108,000	108,834	2026/12/25
第417回大阪府公募公債(10年)	0.248	108,000	109,666	2027/2/26
第423回大阪府公募公債(10年)	0.185	300,000	303,207	2027/8/30
平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	1.05	100,000	108,141	2028/4/28
平成27年度第4回京都府公募公債	0.553	100,000	102,905	2025/6/19
平成27年度第13回京都府公募公債	0.11	105,860	106,444	2026/3/17
平成29年度第3回京都府公募公債	0.01	100,000	100,009	2022/6/21
令和元年度第3回京都府公募公債	0.01	100,000	100,039	2024/6/21
第3回兵庫県公募公債(20年)	2.31	100,000	117,300	2027/9/21
第4回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	109,898	2027/12/24
平成25年度第14回兵庫県公募公債	0.73	100,000	102,917	2024/1/22
平成26年度第2回兵庫県公募公債	0.63	100,000	102,720	2024/5/20
平成28年度第30回兵庫県公募公債	0.215	100,000	101,320	2027/3/19
平成212回静岡県公募公債(30年)	0.822	100,000	108,347	2048/3/19
平成23年度第1回静岡県公募公債	1.385	100,000	101,730	2021/4/21
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	101,662	2021/6/28
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	102,143	2023/3/22
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	101,883	2023/4/19
平成27年度第6回静岡県公募公債	0.494	100,000	102,588	2025/6/20
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	2.087	100,000	120,950	2030/12/13
平成24年度第2回愛知県公募公債(10年)	0.982	100,000	102,205	2022/4/27
平成25年度第16回愛知県公募公債(10年)	0.665	100,000	102,556	2023/11/28
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	0.38	200,000	204,324	2026/1/27
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	101,408	2027/7/28

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
平成29年度第16回愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	101,645	2028/2/14
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	0.185	200,000	202,054	2028/4/27
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	2.34	100,000	119,550	2028/9/21
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	272,000	276,360	2021/5/27
平成24年度第2回広島県公募公債	0.84	100,000	102,089	2022/7/25
平成27年度第2回広島県公募公債	0.602	162,000	167,226	2025/7/24
平成29年度第7回広島県公募公債	0.2	131,440	132,988	2028/3/23
第5回埼玉県公募公債(20年)	2.35	200,000	237,238	2028/3/17
第9回埼玉県公募公債(30年)	0.845	100,000	108,917	2048/3/19
第8回埼玉県公募公債(20年)	0.323	200,000	201,196	2036/5/20
平成23年度第9回埼玉県公募公債	0.99	100,000	101,981	2022/1/27
平成24年度第2回埼玉県公募公債	0.91	100,000	102,094	2022/5/18
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	102,192	2022/10/26
平成27年度第8回埼玉県公募公債	0.41	200,000	204,686	2026/1/28
平成29年度第5回埼玉県公募公債	0.22	100,000	101,408	2027/7/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	100,000	139,483	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	200,000	270,212	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	1.765	100,000	110,476	2026/1/26
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	1.491	100,000	110,058	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	100,000	102,166	2024/12/25
平成29年度第6回福岡県公募公債	0.205	170,000	172,145	2027/12/22
平成29年度第8回福岡県公募公債	0.23	200,000	202,820	2028/2/25
第8回千葉県公募公債(20年)	2.26	200,000	239,674	2029/4/20
第8回千葉県公募公債(20年)	2.18	100,000	120,919	2030/4/19
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	100,000	102,324	2025/3/25
平成28年度第1回千葉県公募公債	0.08	100,000	100,379	2026/5/25
平成29年度第5回千葉県公募公債	0.215	120,000	121,609	2027/12/24
平成27年度第3回新潟県公募公債	0.12	200,000	201,232	2026/3/25
平成24年度第1回岐阜県公募公債(10年)	0.82	139,630	142,679	2022/9/28
第9回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	101,577	2021/5/25
第9回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	101,671	2021/6/25
第10回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	101,813	2021/7/23
第10回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	101,669	2021/8/25
第10回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	101,719	2021/9/24
第10回共同発行市場公募地方債	1.0	177,400	180,506	2021/10/25
第10回共同発行市場公募地方債	1.07	200,000	204,086	2021/12/24
第11回共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	306,198	2022/5/25
第11回共同発行市場公募地方債	0.89	200,000	204,276	2022/6/24
第11回共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,255	2022/11/25
第11回共同発行市場公募地方債	0.72	500,000	510,400	2022/12/22
第11回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	205,028	2023/1/25
第12回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,155	2023/3/24
第12回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	205,886	2023/8/25
第13回共同発行市場公募地方債	0.76	350,000	360,654	2024/1/25
第13回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	102,931	2024/3/25
第13回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	102,921	2024/5/24
第13回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,593	2024/8/23
第13回共同発行市場公募地方債	0.544	200,000	205,166	2024/10/25
第14回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,442	2024/11/25
第14回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	102,053	2025/4/25
第15回共同発行市場公募地方債	0.469	300,000	308,058	2025/12/25
第16回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	300,789	2026/8/25
第16回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	101,557	2027/2/25
第17回共同発行市場公募地方債	0.215	150,000	152,029	2027/10/25
第18回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,985	2028/4/25

当 期 銘 柄	利率	末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	100,000	102,190	2022/10/26
平成29年度第1回熊本県公債(5年)	0.01	100,000	100,009	2022/7/28
平成23年度第1回静岡市公債(10年)	1.045	100,000	101,915	2021/11/25
平成7回大阪市公債(30年)	0.973	100,000	111,901	2047/9/20
平成29年度第1回大阪市公債(5年)	0.01	200,000	200,016	2022/5/25
第1回名古屋市公債(20年)	1.99	100,000	107,788	2023/12/20
第13回名古屋市公債(30年)	0.977	100,000	111,998	2047/9/20
第482回名古屋市公債(10年)	0.639	100,000	102,016	2023/3/20
第488回名古屋市公債(10年)	0.598	100,000	102,782	2024/9/20
第495回名古屋市公債(10年)	0.11	100,000	100,553	2026/3/19
第2回京都市公債(20年)	2.12	100,000	111,899	2025/9/19
第6回京都市公債(20年)	2.38	100,000	117,900	2027/9/17
平成27年度第5回京都市公債(10年)	0.205	200,000	202,250	2026/2/25
平成20年度第1回神戸市公債(20年)	2.38	100,000	119,255	2028/5/26
第5回横浜市公債(20年)	2.17	100,000	111,646	2025/6/20
平成23年度第1回横浜市公債(10年)	1.189	100,000	101,591	2021/5/24
平成25年度第6回横浜市公債(10年)	0.718	100,000	102,809	2023/12/22
第25回横浜市公債(20年)	1.72	100,000	118,723	2032/7/16
第26回横浜市公債(20年)	1.776	100,000	120,069	2033/1/28
平成23年度第4回札幌市公債(10年)	1.02	100,000	101,432	2021/6/18
平成24年度第7回札幌市公債(10年)	0.75	100,000	101,979	2022/9/20
第88回川崎市公債(10年)	0.464	100,000	102,649	2025/12/19
平成29年度第12回福岡市公債(10年)	0.2	130,000	131,534	2028/3/28
平成30年度第9回福岡市公債(10年)	0.289	100,000	101,820	2028/10/30
平成23年度第5回広島市公債(10年)	1.01	151,900	155,089	2022/2/25
平成27年度第2回広島市公債(10年)	0.464	100,000	102,657	2025/12/25
平成23年度第1回千葉市公債(10年)	1.37	100,000	101,705	2021/4/21
平成26年度第1回千葉市公債(10年)	0.679	200,000	205,780	2024/4/25
平成27年度第1回三重県公債(10年)	0.464	100,000	102,657	2025/12/25
平成24年度第1回福井県公債(10年)	0.8	100,000	102,190	2022/10/26
平成24年度第1回山梨県公債(10年)	0.8	100,000	102,194	2022/10/28
平成27年度第1回山梨県公債(10年)	0.495	100,000	102,767	2025/10/30
平成23年度第2回岡山県公債(10年)	1.01	100,000	102,191	2022/3/30
小 計		18,620,230	19,628,127	
特殊債券(除金融債)				
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	102,677	2021/4/16
第2回政府保証新聞西国際空港債券	0.882	200,000	206,256	2023/6/27
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	210,000	218,334	2021/12/22
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	117,910	2027/10/29
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	118,392	2029/7/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	239,148	2029/9/28
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	200,000	242,042	2030/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	137,539	2040/2/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	135,938	2040/5/31
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	119,674	2030/6/28
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	133,377	2040/11/30
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	101,745	2021/4/30
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	101,785	2021/7/30

当 期 銘 柄	利率	末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	101,898	2021/10/29
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	125,000	127,486	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	101,943	2022/2/28
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	102,267	2022/4/28
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	100,000	102,180	2022/5/31
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	102,174	2022/7/29
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	200,000	204,526	2022/10/31
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	400,000	409,480	2022/11/30
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	100,000	119,070	2032/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	205,212	2023/1/31
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	100,000	119,827	2033/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	209,000	213,593	2023/3/17
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	203,728	2023/4/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	100,000	102,131	2023/5/31
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	100,000	103,316	2023/7/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	102,111	2026/1/30
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	200,000	200,618	2026/3/31
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	100,313	2026/4/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	300,000	303,057	2027/1/29
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	243,000	246,637	2028/2/29
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	100,000	101,609	2028/10/31
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.001	100,000	100,060	2022/5/30
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.03	100,000	101,560	2021/3/12
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	101,740	2021/7/16
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,674	2021/8/13
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	101,857	2022/1/25
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	200,000	203,958	2022/3/14
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.977	100,000	102,251	2022/4/22
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	217,000	221,793	2022/6/17
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.819	100,000	102,237	2022/9/16
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.791	100,000	102,234	2022/10/18
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	100,000	102,200	2022/12/16
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.834	100,000	102,578	2023/1/20
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.882	100,000	103,101	2023/6/16
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	101,000	104,304	2023/7/14
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	193,000	198,992	2024/1/19
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	421,000	431,154	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	200,000	200,614	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,794	2026/12/14
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	202,982	2028/2/15

銘 柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
第1 0 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.12	100,000	100,862	2028/4/14
第1 1 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	150,000	151,333	2028/7/18
第1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	100,000	101,528	2028/8/15
第1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,601	2028/10/16
第1 8 回政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	102,208	2023/3/22
第6 9 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.06	300,000	299,805	2026/7/17
第7 5 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,868	2027/1/18
第1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	158,273	2045/9/20
第8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	150,000	171,820	2026/3/19
第1 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	500,000	575,320	2026/9/18
第2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	115,713	2027/4/20
第2 1 回道路債債券	2.75	100,000	132,347	2033/6/20
第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	306,008	2047/3/20
第2 7 回道路債債券	2.42	100,000	110,035	2024/3/20
第2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	117,122	2027/10/20
第2 8 回道路債債券	2.83	300,000	404,586	2033/12/20
第3 3 回道路債債券	2.91	100,000	136,993	2034/6/20
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	119,199	2028/6/20
第3 8 回道路債債券	2.26	100,000	110,507	2024/9/20
第3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	100,000	119,340	2028/9/20
第4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	120,866	2025/5/18
第8 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.893	500,000	510,750	2029/6/20
第1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	102,224	2023/3/20
第1 2 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	102,710	2024/6/20
第2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	119,823	2029/4/27
第4 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.12	100,000	119,330	2029/12/28
第5 回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	107,684	2023/9/20
第5 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.22	200,000	240,732	2030/1/28
第7 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	120,574	2030/4/26
第9 回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	110,780	2024/9/24
第1 1 回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	110,616	2025/3/24
第1 2 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	120,557	2030/12/27
第1 5 回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	111,812	2025/9/24
第1 5 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	361,536	2031/6/27
第1 7 回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	228,562	2026/3/24
第1 7 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	118,987	2031/9/26
第2 2 回公営企業債券(20年)	2.32	300,000	349,581	2027/6/18
第2 3 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	300,000	353,550	2032/7/28
第2 4 回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	117,933	2028/4/25
第4 3 回地方公共団体金融機構債券	0.72	100,000	102,096	2022/12/28
第4 6 回地方公共団体金融機構債券	0.205	100,000	100,875	2027/5/28
F 9 1 0 回地方公共団体金融機構債券	0.792	100,000	103,715	2024/10/24
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	0.227	200,000	202,110	2027/10/25
第1 9 回首都高速道路株式会社社債	0.07	200,000	200,228	2021/12/20
第2 1 回首都高速道路株式会社社債	0.09	300,000	300,693	2022/12/20
第8 1 回株式会社日本政策金融公社社債	0.001	100,000	99,987	2021/11/8
第1 5 9 回都市再生債券	0.43	100,000	90,588	2059/3/19
第1 6 1 回都市再生債券	0.687	100,000	99,753	2059/3/19
第3 8 1 回関西国際空港株式会社社債	1.112	100,000	102,104	2021/12/20
第1 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	11,768	11,953	2036/5/10
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	67,705	70,041	2042/5/10
第1 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	27,978	29,080	2037/11/10
第2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	14,271	14,958	2037/11/10
第3 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	35,505	36,253	2036/5/10
第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	12,324	12,588	2036/11/10
第5 回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	300,000	300,180	2033/7/10

銘 柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
第6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	12,809	13,250	2037/5/10
第8 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	117,428	2027/6/18
第7 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	51,204	52,946	2037/5/10
第8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	13,452	13,963	2037/5/10
第8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	30,346	31,648	2042/12/10
第9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	13,412	13,942	2037/5/10
第1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	20,046	20,086	2038/2/10
第1 0 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.95	13,839	14,390	2037/5/10
第1 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	11,000	11,083	2038/6/10
第1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	10,766	10,869	2038/9/10
第1 2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.15	17,008	18,060	2040/11/10
第1 7 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	48,186	49,230	2032/11/10
第1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	10,619	10,732	2039/5/10
第1 8 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	16,136	16,470	2032/11/10
第1 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.15	100,000	107,852	2023/9/20
第2 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	24,232	24,893	2039/7/10
第2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	121,312	2028/9/20
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	21,128	22,718	2044/5/10
第2 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	12,484	12,757	2039/12/10
第2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,793	25,762	2044/6/10
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	43,368	46,418	2044/7/10
第2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	13,978	14,485	2040/3/10
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	39,462	40,670	2040/4/10
第3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	13,463	13,846	2040/6/10
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	44,010	45,475	2040/7/10
第3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	16,116	16,813	2040/9/10
第3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	31,113	33,384	2045/3/10
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	30,859	32,894	2045/4/10
第3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	13,695	14,189	2040/11/10
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	30,588	32,461	2045/5/10
第3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	14,461	15,012	2040/12/10
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	41,451	42,994	2041/2/10
第3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	66,904	70,453	2045/8/10
第4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	31,482	33,041	2041/3/10
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	15,106	15,846	2041/4/10
第4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,640	14,303	2041/5/10
第4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	41,637	43,962	2045/11/10
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	40,250	42,757	2045/12/10
第4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	121,058	2030/2/18
第4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	118,458	126,643	2046/1/10
第4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	133,488	142,232	2046/2/10
第4 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	13,780	14,376	2041/10/10
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	30,923	32,844	2046/6/10
第5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	31,510	33,381	2046/7/10
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	40,596	42,354	2042/2/10
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	34,098	36,135	2046/8/10
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	14,209	14,860	2042/4/10
第5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	38,246	40,617	2046/10/10
第5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	40,558	42,913	2046/11/10
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	44,837	47,420	2046/12/10
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	42,725	45,218	2047/2/10
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	49,872	52,085	2047/12/10
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	50,632	53,379	2048/2/10
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	44,405	46,621	2048/3/10
第7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	43,007	44,793	2048/4/10
第7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	44,410	46,293	2048/5/10

銘柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	50,155	52,911	2048/6/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	118,678	2031/10/17
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.53	100,000	109,598	2026/9/18
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,999	2031/11/18
第9回一般担保住宅金融支援機構債券	1.595	100,000	110,478	2026/12/18
第9回一般担保住宅金融支援機構債券	1.06	100,000	102,005	2021/12/20
第10回一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	109,602	2027/3/19
第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	76,472	79,313	2051/1/10
第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	167,254	168,540	2051/6/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	85,348	85,133	2051/8/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	86,249	87,017	2051/10/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	86,456	87,041	2051/11/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	86,604	87,573	2051/12/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	86,999	88,372	2052/1/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	87,654	88,909	2052/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	87,799	89,117	2052/3/10
第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	89,005	90,149	2052/6/10
第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	91,045	92,203	2052/11/10
第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	91,540	92,506	2052/12/10
第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	91,224	92,317	2053/1/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,255	94,353	2053/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	94,350	95,235	2053/8/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	94,804	96,040	2053/9/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,854	97,241	2053/12/10
第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	95,866	96,678	2054/1/10
第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	97,228	97,658	2054/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,952	98,213	2054/6/10
第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	98,352	97,837	2054/7/10
第15回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	299,577	298,980	2054/12/10
第15回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	300,000	301,131	2055/1/10
第15回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	100,000	100,070	2055/2/10
第57回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,995	2021/11/19
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	200,184	2030/1/31
第45回中日本高速道路株式会社債	0.904	100,000	102,377	2022/9/20
第18回西日本高速道路株式会社債	0.893	200,000	205,604	2023/3/20
第29回西日本高速道路株式会社債	0.31	100,000	101,294	2026/2/12
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	100,602	2026/10/19
第34回西日本高速道路株式会社債	0.335	100,000	101,613	2027/2/16
小 計		22,027,570	23,672,581	
金融債券				
い第835号商工債	0.05	200,000	200,000	2024/12/27
第322回信中金債(5年)	0.03	100,000	100,032	2021/9/27
第322回信中金債(5年)	0.06	200,000	200,186	2022/2/25
第328回信中金債(5年)	0.06	100,000	100,096	2022/3/25
第331回信中金債(5年)	0.08	100,000	100,157	2022/6/27
第339回信中金債(5年)	0.11	100,000	100,305	2023/2/27
第342回信中金債(5年)	0.11	100,000	100,333	2023/5/26
第218号商工債(3年)	0.12	400,000	400,492	2021/3/26
第221号商工債(3年)	0.11	200,000	200,270	2021/6/25
第231号商工債(3年)	0.08	100,000	100,134	2022/4/27
第236号商工債(3年)	0.02	100,000	99,999	2022/9/27
小 計		1,700,000	1,702,004	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第500回中部電力株式会社債	0.875	100,000	103,122	2024/5/24
第518回中部電力株式会社債	0.19	100,000	100,244	2023/1/25
第535回中部電力株式会社債	0.26	200,000	199,536	2029/11/22

銘柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
第495回関西電力株式会社債	0.746	100,000	101,065	2021/9/17
第505回関西電力株式会社債	0.24	100,000	100,249	2023/8/25
第509回関西電力株式会社債	0.47	100,000	100,427	2027/5/25
第510回関西電力株式会社債	0.49	100,000	100,568	2027/7/23
第377回中国電力株式会社債	0.121	100,000	103,577	2023/8/25
第393回中国電力株式会社債	0.26	100,000	100,067	2026/11/25
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	105,121	2026/6/25
第321回北陸電力株式会社債	0.365	100,000	100,603	2027/4/23
第479回東北電力株式会社債	0.372	100,000	100,577	2022/4/25
第253回四国電力株式会社債	1.0	100,000	102,924	2023/6/23
第371回九州電力株式会社債	1.43	100,000	103,744	2022/12/22
第426回九州電力株式会社債	1.064	200,000	207,300	2024/2/23
第431回九州電力株式会社債	0.811	100,000	102,878	2024/12/25
第436回九州電力株式会社債	0.39	100,000	100,550	2022/1/25
第468回九州電力株式会社債	0.435	100,000	100,624	2028/8/25
第482回九州電力株式会社債	0.17	100,000	99,841	2024/8/23
第320回北海道電力株式会社債	0.585	100,000	100,871	2021/12/24
第32回北海道電力株式会社債	1.337	100,000	108,788	2030/3/25
第357回北海道電力株式会社債	0.475	100,000	100,493	2029/5/25
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	100,000	102,779	2023/5/9
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,673	2027/11/30
第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,507	2026/7/16
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	100,000	100,194	2024/2/23
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,319	2025/8/29
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,881	2027/2/26
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,955	2023/8/30
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.671	100,000	101,723	2023/3/20
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	100,000	100,907	2027/7/16
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	100,000	99,724	2024/9/6
第2回レンゴー株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,858	2026/12/8
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,348	2024/7/24
第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	100,000	100,517	2026/6/9
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	100,000	99,991	2024/5/31
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,377	2026/3/6
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	98,861	2029/7/31
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,976	2022/3/3
第1回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,019	2022/8/3
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	100,570	2029/4/19
第9回住友理工株式会社無担保社債	0.455	100,000	101,028	2027/9/21
第14回旭硝子株式会社無担保社債	1.005	100,000	102,995	2023/6/2
第11回日本電気硝子株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,889	2026/5/29
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	101,360	2021/3/19
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.804	100,000	102,427	2024/3/13
第31回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.25	100,000	99,753	2026/9/18
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.09	100,000	99,954	2022/3/9
第2回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.821	100,000	101,913	2022/9/20
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	100,000	102,703	2023/12/13
第8回日本産電株式会社無担保社債	0.1	100,000	99,723	2024/7/19
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	100,000	100,958	2022/3/18
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,387	2021/9/17
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,500	2023/9/20
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,884	2021/9/17

銘柄	当 期 利率	期 末 額面金額	末 評 価 額	末 償還年月日
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	0.34	100,000	100,341	2027/6/7
第32回三菱重工工業株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,903	2021/8/31
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,221	2022/8/4
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	100,082	2023/9/25
第2回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.221	100,000	101,820	2021/9/14
第1回ユニバーファミリーマートホールディングス無担保社債	0.14	100,000	100,007	2022/2/22
第6回9回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	119,243	2031/7/22
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	103,394	2022/3/16
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特約)	0.61	100,000	99,897	2029/12/12
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	2.2	100,000	112,399	2026/10/30
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	102,084	2021/6/9
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.52	100,000	102,736	2022/1/26
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.22	100,000	105,940	2022/10/27
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	101,919	2024/9/12
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	100,000	103,367	2022/3/15
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.6	100,000	102,029	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	111,895	2026/6/1
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	100,000	99,912	2026/12/11
第1回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,931	2021/12/20
第41回株式会社日産フィナンシャルサービシズ無担保社債	0.03	100,000	99,602	2021/9/17
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.05	100,000	99,851	2022/6/20
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,761	2026/6/19
第25回リコーリース株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,987	2022/2/23
第72回アコム株式会社無担保社債	0.37	200,000	200,510	2021/6/3
第73回アコム株式会社無担保社債	0.369	100,000	100,288	2022/2/28
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.888	100,000	102,868	2024/3/19
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	104,579	2026/9/18
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,020	2023/11/27
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.12	100,000	100,011	2021/6/9
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,028	2022/1/26
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,760	2026/7/10
第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	118,546	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	116,184	2027/9/17
第104回三菱地所株式会社無担保社債	1.095	100,000	101,909	2021/12/22
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	99,112	2039/8/5
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,876	2024/4/26
第13回日本ビルファンド投資法人無担保社債	1.168	100,000	102,881	2023/6/26
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	102,083	2022/6/7
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	99,859	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	99,689	2049/12/3
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	105,164	2022/9/20
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	100,000	114,845	2027/4/16
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.249	100,000	119,874	2030/3/22
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.874	100,000	101,990	2022/7/22
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.302	100,000	117,368	2058/1/25
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.246	100,000	115,564	2058/9/27

銘柄	当 期 利率	期 末 額面金額	末 評 価 額	末 償還年月日
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	108,688	2024/3/20
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	109,179	2056/12/13
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.033	100,000	111,097	2047/11/29
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	2.212	100,000	119,631	2030/4/23
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	1.917	100,000	131,235	2044/10/28
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	116,341	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	119,788	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	116,679	2032/5/25
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	114,334	2058/5/24
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	200,000	206,170	2031/3/4
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	100,000	102,528	2023/10/25
第4回株式会社日立物流無担保社債	0.33	100,000	100,342	2026/9/28
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	200,000	201,518	2028/11/22
第31回電源開発株式会社無担保社債	2.004	100,000	109,627	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	103,209	2023/12/20
第56回電源開発株式会社無担保社債	0.54	100,000	100,541	2033/5/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,901	2058/7/20
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.984	100,000	131,974	2043/12/17
第5回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,988	2021/12/15
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,920	2022/7/21
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	100,881	2028/6/6
第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.16	100,000	99,864	2021/10/14
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.384	100,000	100,223	2024/10/11
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.64	200,000	201,120	2022/1/27
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.214	200,000	199,536	2022/6/30
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	100,000	100,465	2023/7/12
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,035	2024/1/26
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,723	2023/1/25
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	200,000	199,888	2021/7/9
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	199,972	2022/6/9
第1回HSBC・ホールディングス・ビエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,303	2021/9/24
第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	0.568	100,000	100,018	2023/1/11
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	200,000	200,080	2023/7/6
小 計		14,700,000	15,161,949	
合 計		335,662,800	364,959,292	

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 364,959,292	99.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,266,841	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	366,226,133	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年1月22日現在
(A) 資 産	366,326,180,792円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	475,818,478
公 社 債(評価額)	364,959,292,607
未 収 入 金	101,260,000
未 収 利 息	616,453,637
前 払 費 用	73,309,070
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B) 負 債	572,031,513
未 払 金	300,000,000
未 払 解 約 金	171,984,252
未 払 利 息	261
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	365,754,149,279
元 本	263,895,892,325
次 期 繰 越 損 益 金	101,858,256,954
(D) 受 益 権 総 口 数	263,895,892,325口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,860円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年1月23日 至 2020年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	2,662,464,166円
受 取 利 息	2,663,415,160
支 払 利 息	△950,994
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	883,723,281
売 買 益	2,901,645,502
売 買 損	△2,017,922,221
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,520,928
取 引 益	10,406,508
取 引 損	△8,885,580
(D) そ の 他 費 用	△12,622
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	3,547,695,753
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	81,642,953,691
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,349,314,239
(H) 解 約 差 損 益 金	△6,681,706,729
(I) 計 (E+F+G+H)	101,858,256,954
次 期 繰 越 損 益 金(I)	101,858,256,954

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は220,780,734,427円、期中追加設定元本額は60,119,431,753円、期中一部解約元本額は17,004,273,855円です。

※担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 101,394,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

インデックスコレクション (バランス株式30)	47,170,841,744円
私募日本債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	46,700,839,919円
DC日本債券インデックスファンドL	38,992,645,702円
インデックスコレクション (国内債券)	36,176,813,748円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	28,863,381,125円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	12,412,206,940円
DCバランスファンド30	8,565,237,424円
DCバランスファンド50	5,730,911,927円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	4,073,831,597円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	3,843,840,527円
インデックスコレクション (バランス株式50)	3,726,510,145円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	3,242,634,970円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	3,239,306,017円
日本債券パッシブファンド私募A (適格機関投資家専用)	2,752,312,497円
DC日本債券インデックスファンド	2,750,268,537円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	1,722,017,397円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	1,591,840,145円
DCバランスファンド70	1,435,835,449円
日本債券インデックスe	1,393,015,066円
インデックスコレクション (バランス株式70)	1,342,537,787円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	1,290,343,840円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	1,114,281,070円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	957,830,936円
日本債券インデックスファンド	930,722,152円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	674,359,160円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	517,689,790円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	449,754,441円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	415,159,398円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	394,614,000円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	293,049,745円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	259,444,427円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	226,575,927円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	184,278,815円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	170,493,171円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	138,132,268円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	101,930,474円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	43,860,326円
私募日本債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	6,543,722円

お知らせ

該当事項はありません。