

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	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。	
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	株式への実質投資は転換社債を転換したものとおよび新株予約権を行使したものに限りませ 外貨建資産への投資は行いませ ん。
	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および新株予約権を行使したものに限りませ 外貨建資産への投資は行いませ ん。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の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。なお、前期から繰り越された分配準備積立金および収益調整金は、全額分配に使用することがあります。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配にあ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。	

＜委託会社の合併およびファンド名称等の変更に關するお知らせ＞を次頁に記載していますのでご覧ください。

日本債券インデックスe

運用報告書

第3期（決算日 2013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。

本運用報告書に関するお問い合わせ先

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。）

当社ではHPでファンドの情報提供を行っております。

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

目 次

設定以来の運用実績	1
当期中の基準価額と市況の推移	1
当期中の運用経過と今後の運用方針	2
1万口当たりの費用明細	5
売買および取引の状況	5
利害関係人との取引状況等	5
組入資産の明細	5
投資信託財産の構成	6
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	6
約款変更のお知らせ	7
復興特別所得税等に関するお知らせ	7
日本債券マザーファンド	8
第12期決算運用報告書(決算日2013年1月22日)	

【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、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

＜委託会社の合併およびファンド名称等の変更に関するお知らせ＞

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2012年4月1日付で、住信アセットマネジメント株式会社と中央三井アセットマネジメント株式会社が合併したことにより発足致しました。それに伴い、以下の変更を行いました。

なお、合併後も、ファンドの運用方針およびご購入・ご換金のお手続きなどに変更はございません。引き続き変わらぬご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

変更項目	変更前	変更後
委託会社名	中央三井アセットマネジメント株式会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
住所	東京都港区芝三丁目23番1号	東京都港区芝三丁目33番1号
ファンド名	CMAM日本債券インデックス e	日本債券インデックス e
マザーファンド名	中央三井日本債券マザーファンド	日本債券マザーファンド
受託会社名	中央三井アセット信託銀行株式会社	三井住友信託銀行株式会社

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産総額
	円	円	%	円	%					
設定日(2010年4月6日)	10,000	—	—	323.056	—	—	—	—	—	1
第1期(2011年1月24日)	10,119	0	1.2	328.670	1.7	98.5	0.7			170
第2期(2012年1月23日)	10,328	0	2.1	336.892	2.5	97.8	1.0			529
第3期(2013年1月22日)	10,513	0	1.8	344.574	2.3	99.1	0.3			906

(注1) 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2) 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
	円	%	円	%		
(当期首) 2012年1月23日	10,328	—	336.892	—	97.8	1.0
1月末	10,348	0.2	337.614	0.2	97.5	0.6
2月末	10,354	0.3	337.998	0.3	97.6	0.9
3月末	10,356	0.3	338.183	0.4	100.4	0.2
4月末	10,406	0.8	339.940	0.9	98.4	0.6
5月末	10,457	1.2	341.790	1.5	98.5	0.6
6月末	10,452	1.2	341.726	1.4	98.4	0.7
7月末	10,486	1.5	342.988	1.8	98.7	0.7
8月末	10,469	1.4	342.586	1.7	99.0	0.4
9月末	10,492	1.6	343.467	2.0	99.3	0.3
10月末	10,487	1.5	343.384	1.9	99.3	0.3
11月末	10,509	1.8	344.268	2.2	99.0	0.4
12月末	10,474	1.4	343.257	1.9	100.7	0.6
(当期末) 2013年1月22日	10,513	1.8	344.574	2.3	99.1	0.3

(注1) 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。

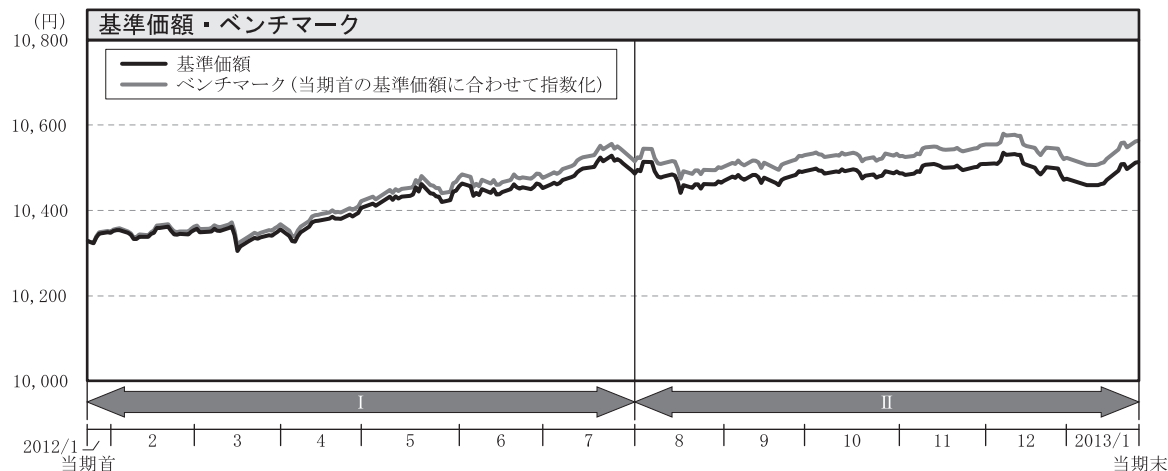
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

※ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組み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。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額および市況の推移ならびに基準価額の変動要因



	I の期間 (当期首～2012年7月)	II の期間 (2012年8月～当期末)
基準価額の動き	上昇	もみ合い
国内債券市場	<p>10年国債利回りは、期初は欧州債務問題への懸念と米国景気の緩やかな回復期待などが交錯して0.9%台後半を中心にもみ合う展開が続きました。3月は日本株高や急速な円安を背景に売り優勢となり、一時1.06%近辺まで上昇(債券価格は下落)しましたが、4月に入るとスペイン国債入札をきっかけとした欧州債務問題の再燃や日銀による追加金融緩和観測の強まりなどから低下(債券価格は上昇)基調に転じました。5月以降も、ギリシャの政局混迷やスペインの財政悪化が懸念される中、世界的にリスク回避姿勢が高まったことから一段と低下圧力がかかり、7月下旬には一時0.72%となりました。</p>	<p>8月は政局が混迷する中、消費増税法案が廃案となるリスクが急浮上したことを受けて10年国債利回りは上昇に転じましたが、その後は国内景気の先行き不透明感の強まりや、10月に日銀が2カ月連続で追加金融緩和を実施したことから低下圧力がかかりました。さらに、衆議院選挙後の金融緩和政策の強化観測が出たことや、米国における「財政の崖」問題に対する懸念の高まりを受けて米国国債利回りが低下した影響から、12月上旬には一時0.685%まで低下しました。12月中旬以降は、衆議院選挙での自民党圧勝を背景として円安や株高が進行したことに加え、景気対策に伴う財政出動によって国債増発懸念が強まったことから、10年国債利回りは上昇に転じましたが、期末にかけては1月の日銀金融政策決定会合において大胆な追加金融緩和策が決定されるとの期待が強まったことや、過度な国債増発懸念が後退したことから金利は急低下し、0.73%で終了しました。</p>

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
10,328円	10,513円	+185円	+1.79%	+2.28%	△0.49%

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。

■運用状況

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】

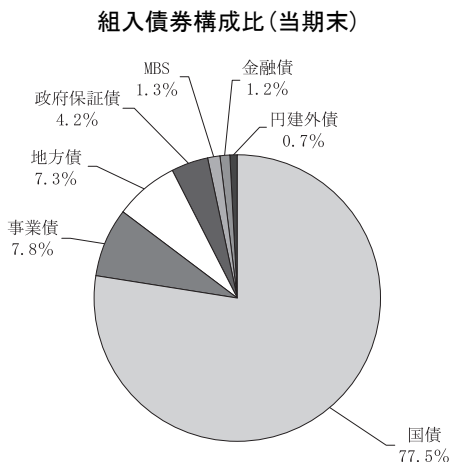
ベンチマークであるNOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(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。



(注) 比率は、マザーファンドの債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

■収益分配

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。

(分配原資の内訳)

(単位：円、1万口当たり・税引前)

項 目	当 期
当期分配金	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	513

(注)金額は円未満切捨てで表記しております。

収益分配金の計算過程につきましては、後記<注記事項>分配金の計算過程をご参照ください。

■今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、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す。

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	41円 (16) (21) (4)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0)
(c) 保 管 費 用 等	1
合 計	42

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料及び保管費用等は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

売買および取引の状況

<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 ェ ン ド	千口 676,094	千円 820,457	千口 376,013	千円 454,718

利害関係人[※]との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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 ェ ン ド	千口 439,469	千口 739,550	千円 906,244

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、285,638,838千口です。

※ 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 906,244	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,571	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	912,815	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 2013年1月22日現在
(A) 資 産	912,815,999円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,571,055
日本債券マザーファンド(評価額)	906,244,932
未 収 利 息	12
(B) 負 債	6,450,145
未 払 解 約 金	4,846,530
未 払 信 託 報 酬	1,582,289
そ の 他 未 払 費 用	21,326
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	906,365,854
元 本	862,105,902
次 期 繰 越 損 益 金	44,259,952
(D) 受 益 権 総 口 数	862,105,902口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	10,513円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2012年1月24日 至 2013年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	3,508円
受 取 利 息	3,508
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,739,394
売 買 益	15,457,434
売 買 損	△5,718,040
(C) 信 託 報 酬 等	△2,710,862
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	7,032,040
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,024,264
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,203,648
(配 当 等 相 当 額)	(10,607,845)
(売 買 損 益 相 当 額)	(25,595,803)
(G) 計 (D+E+F)	44,259,952
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	44,259,952
追 加 信 託 差 損 益 金	36,203,648
(配 当 等 相 当 額)	(11,366,871)
(売 買 損 益 相 当 額)	(24,836,777)
分 配 準 備 積 立 金	8,172,512
繰 越 損 益 金	△116,208

(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せん。

(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512,717,615円、期中追加設定元本額は1,004,398,391円、期中一部解約元本額は655,010,104円です。

※1口当たり純資産額は、1.0513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)	7,080,849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	36,087,440円
(D) 分配準備積立金額	1,091,663円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	44,259,952円
(F) 期末残存口数	862,105,902口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	513.39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

約款変更のお知らせ

当ファンドの委託会社の合併に伴い、委託会社名、当ファンド及び当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、当ファンドの受託会社の合併に伴い、受託会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2012年4月1日)

復興特別所得税等に関するお知らせ

2013年1月1日から2013年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税7%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、10.147%(所得税及び復興特別所得税7.147%、並びに住民税3%(法人受益者は7.147%の源泉徴収が行われます。))の税率が適用されます。

なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

日本債券マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2013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	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。
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

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

本運用報告書に関するお問い合わせ先

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。）

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。

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	円	騰落率			
第8期(2009年1月22日)	11,308	2.1	317,581	2.1	97.0	1.0	228,954
第9期(2010年1月22日)	11,466	1.4	322,522	1.6	98.4	0.8	296,862
第10期(2011年1月24日)	11,681	1.9	328,670	1.9	98.6	0.7	352,025
第11期(2012年1月23日)	11,981	2.6	336,892	2.5	98.3	1.0	359,863
第12期(2013年1月22日)	12,254	2.3	344,574	2.3	99.1	0.3	350,008

(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	円	騰落率		
(当期首) 2012年 1月23日	11,981	—	336,892	—	98.3	1.0
1月末	12,007	0.2	337,614	0.2	98.0	0.6
2月末	12,020	0.3	337,998	0.3	98.1	0.9
3月末	12,026	0.4	338,183	0.4	99.5	0.2
4月末	12,089	0.9	339,940	0.9	98.6	0.6
5月末	12,154	1.4	341,790	1.5	98.2	0.6
6月末	12,152	1.4	341,726	1.4	98.8	0.7
7月末	12,197	1.8	342,988	1.8	98.8	0.7
8月末	12,182	1.7	342,586	1.7	99.0	0.4
9月末	12,213	1.9	343,467	2.0	99.3	0.3
10月末	12,211	1.9	343,384	1.9	99.3	0.3
11月末	12,242	2.2	344,268	2.2	99.0	0.4
12月末	12,205	1.9	343,257	1.9	100.7	0.6
(当期末) 2013年 1月22日	12,254	2.3	344,574	2.3	99.1	0.3

(注1)騰落率は期首比です。

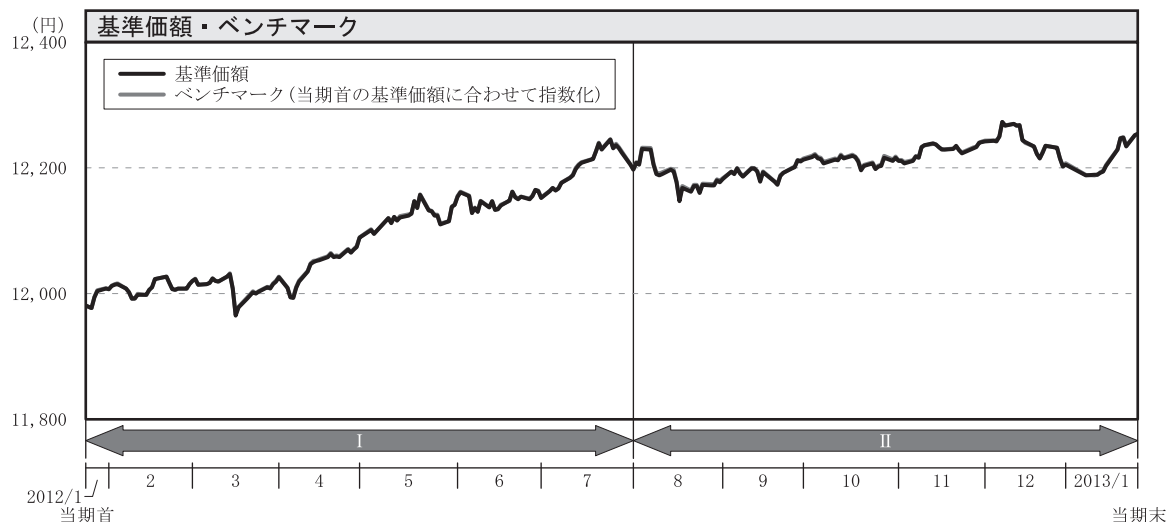
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

※ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組み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。この指数は野村証券株式会社の知的財産であり、野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額および市況の推移ならびに基準価額の変動要因



(注) ベンチマークのグラフ線は、基準価額のグラフ線とほぼ重なっています。

	I の期間 (当期首～2012年7月)	II の期間 (2012年8月～当期末)
基準価額の動き	上昇	もみ合い
国内債券市場	10年国債利回りは、期初は欧州債務問題への懸念と米国景気の緩やかな回復期待などが交錯して0.9%台後半を中心にもみ合う展開が続きました。3月は日本株高や急速な円安を背景に売り優勢となり、一時1.06%近辺まで上昇(債券価格は下落)しましたが、4月に入るとスペイン国債入札をきっかけとした欧州債務問題の再燃や日銀による追加金融緩和観測の強まりなどから低下(債券価格は上昇)基調に転じました。5月以降も、ギリシャの政局混迷やスペインの財政悪化が懸念される中、世界的にリスク回避姿勢が高まったことから一段と低下圧力がかかり、7月下旬には一時0.72%となりました。	8月は政局が混迷する中、消費増税法案が廃案となるリスクが急浮上したことを受けて10年国債利回りは上昇に転じましたが、その後は国内景気の先行き不透明感の強まりや、10月に日銀が2ヵ月連続で追加金融緩和を実施したことから低下圧力がかかりました。さらに、衆議院選挙後の金融緩和政策の強化観測が出たことや、米国における「財政の崖」問題に対する懸念の高まりを受けて米国国債利回りが低下した影響から、12月上旬には一時0.685%まで低下しました。12月中旬以降は、衆議院選挙での自民党圧勝を背景として円安や株高が進行したことに加え、景気対策に伴う財政出動によって国債増発懸念が強まったことから、10年国債利回りは上昇に転じましたが、期末にかけては1月の日銀金融政策決定会合において大胆な追加金融緩和策が決定されるとの期待が強まったことや、過度な国債増発懸念が後退したことから金利は急低下し、0.73%で終了しました。

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
11,981円	12,254円	+273円	+2.28%	+2.28%	0.00%

当ファンドは、期を通じてベンチマークに対して高い運動性を維持しました。

■運用状況

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、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。

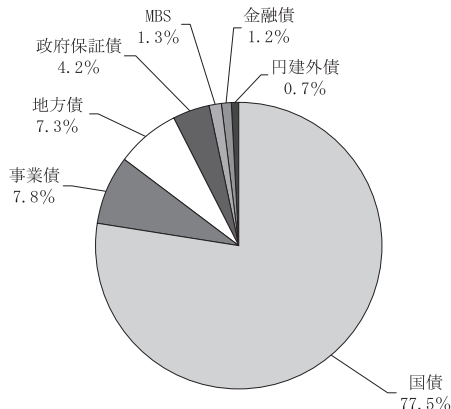
(1) 債券組入比率

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。

組入債券構成比(当期末)



(注) 比率は、債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

■今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、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
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)
合 計	0

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

〈公社債〉

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	97,471,903	100,952,795
	地 方 債 証 券	3,242,692	3,986,813
	特 殊 債 券	5,353,161	9,254,636 (686,262)
	社 債 券	4,489,589	5,818,965

(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) 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。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

〈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 45,125	百万円 47,723	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

主要な売買銘柄

〈公社債〉

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
第325回利付国債(10年)	5,934,054	第309回利付国債(2年)	2,900,081
第106回利付国債(5年)	5,324,959	第317回利付国債(10年)	2,603,801
第105回利付国債(5年)	4,023,931	第104回利付国債(5年)	2,405,816
第103回利付国債(5年)	3,545,693	第307回利付国債(2年)	2,402,528
第313回利付国債(2年)	3,499,580	第289回利付国債(10年)	2,343,418
第321回利付国債(10年)	3,013,798	第303回利付国債(2年)	2,302,277
第140回利付国債(20年)	2,621,090	第71回利付国債(5年)	2,126,208
第104回利付国債(5年)	2,600,606	第288回利付国債(10年)	2,040,126
第320回利付国債(10年)	2,563,355	第76回利付国債(5年)	1,820,736
第324回利付国債(10年)	2,401,456	第305回利付国債(2年)	1,801,899

(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) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

利害関係人※との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※ 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BB格以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国 債 証 券	256,710,000	268,875,464	76.8	—	43.1	22.4	11.3	
地 方 債 証 券	21,317,700 (20,317,700)	22,524,396 (21,463,952)	6.4 (6.1)	— (—)	3.8 (3.6)	2.0 (2.0)	0.6 (0.5)	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	27,463,084 (27,163,084)	29,116,184 (28,790,124)	8.3 (8.2)	— (—)	5.5 (5.5)	2.2 (2.1)	0.6 (0.6)	
金 融 債 券	4,120,000 (4,120,000)	4,164,880 (4,164,880)	1.2 (1.2)	— (—)	0.0 (0.0)	0.8 (0.8)	0.3 (0.3)	
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	21,400,000 (20,600,000)	22,176,202 (21,356,873)	6.3 (6.1)	— (—)	2.1 (2.1)	3.1 (3.0)	1.1 (1.0)	
合 計	331,010,784 (72,200,784)	346,857,127 (75,775,830)	99.1 (21.6)	— (—)	54.7 (11.3)	30.5 (7.9)	13.9 (2.5)	

(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

銘 柄	当 期 末				償還年月日	銘 柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 選 年 月 日			利率	額面金額	評 価 額	債 選 年 月 日	
	%	千円	千円			%	千円	千円			
国債証券											
第313回利付国債(2年)	0.1	2,770,000	2,770,858	2014/2/15	第94回利付国債(5年)	0.6	1,200,000	1,218,432	2015/12/20		
第314回利付国債(2年)	0.1	2,200,000	2,200,748	2014/3/15	第95回利付国債(5年)	0.6	1,900,000	1,931,046	2016/3/20		
第315回利付国債(2年)	0.1	600,000	600,216	2014/4/15	第96回利付国債(5年)	0.5	1,300,000	1,317,147	2016/3/20		
第316回利付国債(2年)	0.1	700,000	700,273	2014/5/15	第97回利付国債(5年)	0.4	1,600,000	1,616,816	2016/6/20		
第317回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,123	2014/6/15	第98回利付国債(5年)	0.3	1,900,000	1,913,528	2016/6/20		
第318回利付国債(2年)	0.1	2,100,000	2,100,924	2014/7/15	第99回利付国債(5年)	0.4	2,090,000	2,113,199	2016/9/20		
第319回利付国債(2年)	0.1	950,000	950,437	2014/8/15	第100回利付国債(5年)	0.3	1,400,000	1,410,444	2016/9/20		
第320回利付国債(2年)	0.1	2,400,000	2,401,176	2014/9/15	第101回利付国債(5年)	0.4	1,600,000	1,618,352	2016/12/20		
第321回利付国債(2年)	0.1	1,150,000	1,150,586	2014/10/15	第102回利付国債(5年)	0.3	1,900,000	1,914,402	2016/12/20		
第322回利付国債(2年)	0.1	1,370,000	1,370,739	2014/11/15	第103回利付国債(5年)	0.3	3,240,000	3,264,753	2017/3/20		
第323回利付国債(2年)	0.1	740,000	740,414	2014/12/15	第104回利付国債(5年)	0.2	200,000	200,702	2017/3/20		
第324回利付国債(2年)	0.1	600,000	600,354	2015/1/15	第105回利付国債(5年)	0.2	4,020,000	4,033,185	2017/6/20		
第81回利付国債(5年)	0.8	1,700,000	1,714,263	2014/3/20	第106回利付国債(5年)	0.2	5,320,000	5,335,960	2017/9/20		
第82回利付国債(5年)	0.9	2,100,000	2,120,034	2014/3/20	第107回利付国債(5年)	0.2	1,500,000	1,504,005	2017/12/20		
第83回利付国債(5年)	0.9	1,200,000	1,213,956	2014/6/20	第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	434,816	2048/3/20		
第84回利付国債(5年)	0.7	1,800,000	1,815,876	2014/6/20	第2回利付国債(40年)	2.2	500,000	516,645	2049/3/20		
第85回利付国債(5年)	0.7	2,100,000	2,121,861	2014/9/20	第3回利付国債(40年)	2.2	600,000	617,028	2050/3/20		
第86回利付国債(5年)	0.6	2,100,000	2,118,396	2014/9/20	第4回利付国債(40年)	2.2	800,000	818,672	2051/3/20		
第87回利付国債(5年)	0.5	3,900,000	3,931,863	2014/12/20	第5回利付国債(40年)	2.0	460,000	443,913	2052/3/20		
第88回利付国債(5年)	0.5	3,640,000	3,673,597	2015/3/20	第258回利付国債(10年)	1.3	480,000	486,787	2014/3/20		
第89回利付国債(5年)	0.4	1,200,000	1,209,492	2015/6/20	第259回利付国債(10年)	1.5	1,180,000	1,199,399	2014/3/20		
第90回利付国債(5年)	0.3	1,300,000	1,307,163	2015/6/20	第260回利付国債(10年)	1.6	860,000	878,438	2014/6/20		
第91回利付国債(5年)	0.4	1,000,000	1,008,740	2015/9/20	第261回利付国債(10年)	1.8	790,000	809,149	2014/6/20		
第92回利付国債(5年)	0.3	2,640,000	2,656,077	2015/9/20	第262回利付国債(10年)	1.9	730,000	748,717	2014/6/20		
第93回利付国債(5年)	0.5	2,100,000	2,126,166	2015/12/20	第263回利付国債(10年)	1.6	750,000	768,960	2014/9/20		

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264回利付国債(10年)	1.5	1,330,000	1,361,427	2014/9/20	第320回利付国債(10年)	1.0	2,440,000	2,521,422	2021/12/20
第265回利付国債(10年)	1.5	730,000	749,848	2014/12/20	第321回利付国債(10年)	1.0	2,600,000	2,680,886	2022/3/20
第266回利付国債(10年)	1.4	560,000	574,162	2014/12/20	第322回利付国債(10年)	0.9	1,100,000	1,124,717	2022/3/20
第267回利付国債(10年)	1.3	410,000	419,585	2014/12/20	第323回利付国債(10年)	0.9	1,700,000	1,734,578	2022/6/20
第268回利付国債(10年)	1.5	1,500,000	1,546,050	2015/3/20	第324回利付国債(10年)	0.8	2,400,000	2,427,576	2022/6/20
第269回利付国債(10年)	1.3	840,000	862,184	2015/3/20	第325回利付国債(10年)	0.8	5,600,000	5,648,048	2022/9/20
第270回利付国債(10年)	1.3	2,100,000	2,161,950	2015/6/20	第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	59,655	2029/9/20
第271回利付国債(10年)	1.2	1,400,000	1,437,940	2015/6/20	第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	113,078	2030/2/20
第272回利付国債(10年)	1.4	1,500,000	1,552,860	2015/9/20	第3回利付国債(30年)	2.3	330,000	367,299	2030/5/20
第273回利付国債(10年)	1.5	1,400,000	1,453,046	2015/9/20	第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	228,207	2030/11/20
第274回利付国債(10年)	1.5	900,000	937,296	2015/12/20	第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	195,993	2031/5/20
第275回利付国債(10年)	1.4	1,200,000	1,246,248	2015/12/20	第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	301,681	2031/11/20
第276回利付国債(10年)	1.6	800,000	835,472	2015/12/20	第7回利付国債(30年)	2.3	390,000	428,703	2032/5/20
第277回利付国債(10年)	1.6	1,300,000	1,362,309	2016/3/20	第8回利付国債(30年)	1.8	270,000	273,191	2032/11/22
第278回利付国債(10年)	1.8	800,000	843,376	2016/3/20	第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	170,071	2032/12/20
第279回利付国債(10年)	2.0	930,000	986,265	2016/3/20	第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	151,505	2033/3/20
第280回利付国債(10年)	1.9	1,500,000	1,592,370	2016/6/20	第11回利付国債(30年)	1.7	210,000	208,107	2033/6/20
第281回利付国債(10年)	2.0	1,000,000	1,064,970	2016/6/20	第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	391,426	2033/9/20
第282回利付国債(10年)	1.7	1,600,000	1,693,824	2016/9/20	第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	363,947	2033/12/20
第283回利付国債(10年)	1.8	1,400,000	1,487,206	2016/9/20	第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	388,416	2034/3/20
第284回利付国債(10年)	1.7	2,950,000	3,133,549	2016/12/20	第15回利付国債(30年)	2.5	640,000	720,908	2034/6/20
第285回利付国債(10年)	1.7	3,400,000	3,623,346	2017/3/20	第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	281,432	2034/9/20
第286回利付国債(10年)	1.8	1,400,000	1,502,998	2017/6/20	第17回利付国債(30年)	2.4	430,000	476,139	2034/12/20
第287回利付国債(10年)	1.9	1,700,000	1,832,515	2017/6/20	第18回利付国債(30年)	-2.3	660,000	718,515	2035/3/20
第288回利付国債(10年)	1.7	1,100,000	1,179,904	2017/9/20	第19回利付国債(30年)	2.3	370,000	402,748	2035/6/20
第289回利付国債(10年)	1.5	2,330,000	2,484,339	2017/12/20	第20回利付国債(30年)	2.5	140,000	157,416	2035/9/20
第290回利付国債(10年)	1.4	900,000	957,492	2018/3/20	第21回利付国債(30年)	2.3	420,000	456,649	2035/12/20
第291回利付国債(10年)	1.3	1,200,000	1,270,524	2018/3/20	第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	449,424	2036/3/20
第292回利付国債(10年)	1.7	1,200,000	1,295,064	2018/3/20	第23回利付国債(30年)	2.5	400,000	449,432	2036/6/20
第293回利付国債(10年)	1.8	1,200,000	1,305,060	2018/6/20	第24回利付国債(30年)	2.5	350,000	393,256	2036/9/20
第294回利付国債(10年)	1.7	900,000	973,971	2018/6/20	第25回利付国債(30年)	2.3	400,000	434,148	2036/12/20
第295回利付国債(10年)	1.5	800,000	857,184	2018/6/20	第26回利付国債(30年)	2.4	700,000	773,297	2037/3/20
第296回利付国債(10年)	1.5	2,400,000	2,575,896	2018/9/20	第27回利付国債(30年)	2.5	900,000	1,011,897	2037/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	1,200,000	1,282,896	2018/12/20	第28回利付国債(30年)	2.5	600,000	675,048	2038/3/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,000,000	1,063,250	2018/12/20	第29回利付国債(30年)	2.4	1,100,000	1,214,763	2038/9/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,100,000	1,170,312	2019/3/20	第30回利付国債(30年)	-2.3	650,000	704,028	2039/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	900,000	968,436	2019/3/20	第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,167,683	2039/9/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,700,000	1,831,019	2019/6/20	第32回利付国債(30年)	2.3	1,100,000	1,189,452	2040/3/20
第302回利付国債(10年)	1.4	1,200,000	1,284,936	2019/6/20	第33回利付国債(30年)	2.0	1,300,000	1,321,164	2040/9/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,200,000	1,285,704	2019/9/20	第34回利付国債(30年)	2.2	1,400,000	1,481,102	2041/3/20
第304回利付国債(10年)	1.3	1,400,000	1,490,370	2019/9/20	第35回利付国債(30年)	-2.0	1,200,000	1,215,492	2041/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,900,000	3,087,775	2019/12/20	第36回利付国債(30年)	2.0	1,500,000	1,515,345	2042/3/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,400,000	1,499,932	2020/3/20	第37回利付国債(30年)	1.9	1,470,000	1,450,728	2042/9/20
第307回利付国債(10年)	1.3	1,300,000	1,383,733	2020/3/20	第24回利付国債(20年)	4.7	160,000	168,516	2014/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	1,300,000	1,383,122	2020/6/20	第25回利付国債(20年)	4.1	80,000	83,706	2014/3/20
第309回利付国債(10年)	1.1	800,000	839,352	2020/6/20	第26回利付国債(20年)	4.5	50,000	53,668	2014/9/22
第310回利付国債(10年)	1.0	1,190,000	1,238,885	2020/9/20	第27回利付国債(20年)	5.0	410,000	443,480	2014/9/22
第311回利付国債(10年)	0.8	1,900,000	1,949,191	2020/9/20	第28回利付国債(20年)	5.0	110,000	121,644	2015/3/20
第312回利付国債(10年)	1.2	3,200,000	3,376,736	2020/12/20	第29回利付国債(20年)	4.2	100,000	110,955	2015/9/21
第313回利付国債(10年)	1.3	1,900,000	2,018,237	2021/3/20	第30回利付国債(20年)	3.7	200,000	219,256	2015/9/21
第314回利付国債(10年)	1.1	1,400,000	1,464,624	2021/3/20	第31回利付国債(20年)	3.5	280,000	310,119	2016/3/21
第315回利付国債(10年)	1.2	1,550,000	1,632,227	2021/6/20	第32回利付国債(20年)	3.7	80,000	89,108	2016/6/21
第316回利付国債(10年)	1.1	1,300,000	1,358,513	2021/6/20	第33回利付国債(20年)	3.8	400,000	488,110	2016/9/20
第317回利付国債(10年)	1.1	1,030,000	1,074,578	2021/9/20	第34回利付国債(20年)	3.5	70,000	79,804	2017/3/20
第318回利付国債(10年)	1.0	2,200,000	2,277,066	2021/9/20	第35回利付国債(20年)	3.3	270,000	305,586	2017/3/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,150,000	1,198,093	2021/12/20	第37回利付国債(20年)	3.1	410,000	466,444	2017/9/20

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3 9 回利付国債 (2 0 年)		2.6	640,000	720,326	2018/3/20	第9 5 回利付国債 (2 0 年)		2.3	500,000	569,640	2027/6/20
第4 0 回利付国債 (2 0 年)		2.3	450,000	503,262	2018/9/20	第9 6 回利付国債 (2 0 年)		2.1	500,000	556,625	2027/6/20
第4 1 回利付国債 (2 0 年)		1.5	620,000	667,144	2019/3/20	第9 7 回利付国債 (2 0 年)		2.2	630,000	708,075	2027/9/20
第4 2 回利付国債 (2 0 年)		2.6	380,000	434,488	2019/3/20	第9 8 回利付国債 (2 0 年)		2.1	600,000	666,468	2027/9/20
第4 3 回利付国債 (2 0 年)		2.9	340,000	397,545	2019/9/20	第9 9 回利付国債 (2 0 年)		2.1	1,100,000	1,219,757	2027/12/20
第4 4 回利付国債 (2 0 年)		2.5	370,000	424,604	2020/3/20	第1 0 0 回利付国債 (2 0 年)		2.2	800,000	896,232	2028/3/20
第4 5 回利付国債 (2 0 年)		2.4	270,000	308,072	2020/3/20	第1 0 1 回利付国債 (2 0 年)		2.4	500,000	573,975	2028/3/20
第4 6 回利付国債 (2 0 年)		2.2	290,000	327,439	2020/6/22	第1 0 2 回利付国債 (2 0 年)		2.4	690,000	790,953	2028/6/20
第4 7 回利付国債 (2 0 年)		2.2	470,000	531,668	2020/9/21	第1 0 3 回利付国債 (2 0 年)		2.3	300,000	339,807	2028/6/20
第4 8 回利付国債 (2 0 年)		2.5	230,000	265,794	2020/12/21	第1 0 4 回利付国債 (2 0 年)		2.1	600,000	662,874	2028/6/20
第4 9 回利付国債 (2 0 年)		2.1	280,000	315,106	2021/3/22	第1 0 5 回利付国債 (2 0 年)		2.1	900,000	991,719	2028/9/20
第5 0 回利付国債 (2 0 年)		1.9	590,000	654,728	2021/3/22	第1 0 6 回利付国債 (2 0 年)		2.2	300,000	334,902	2028/9/20
第5 1 回利付国債 (2 0 年)		2.0	240,000	268,389	2021/6/21	第1 0 7 回利付国債 (2 0 年)		2.1	700,000	769,741	2028/12/20
第5 2 回利付国債 (2 0 年)		2.1	430,000	484,678	2021/9/21	第1 0 8 回利付国債 (2 0 年)		1.9	700,000	749,420	2028/12/20
第5 3 回利付国債 (2 0 年)		2.1	350,000	394,873	2021/12/20	第1 0 9 回利付国債 (2 0 年)		1.9	700,000	747,579	2029/3/20
第5 4 回利付国債 (2 0 年)		2.2	280,000	318,270	2021/12/20	第1 1 0 回利付国債 (2 0 年)		2.1	700,000	768,082	2029/3/20
第5 5 回利付国債 (2 0 年)		2.0	490,000	548,804	2022/3/21	第1 1 1 回利付国債 (2 0 年)		2.2	320,000	354,620	2029/6/20
第5 6 回利付国債 (2 0 年)		2.0	410,000	459,450	2022/6/20	第1 1 2 回利付国債 (2 0 年)		2.1	1,200,000	1,312,044	2029/6/20
第5 7 回利付国債 (2 0 年)		1.9	360,000	400,050	2022/6/20	第1 1 3 回利付国債 (2 0 年)		2.1	1,100,000	1,199,935	2029/9/20
第5 8 回利付国債 (2 0 年)		1.9	250,000	277,757	2022/9/20	第1 1 4 回利付国債 (2 0 年)		2.1	800,000	870,592	2029/12/20
第5 9 回利付国債 (2 0 年)		1.7	440,000	480,748	2022/12/20	第1 1 5 回利付国債 (2 0 年)		2.2	700,000	772,324	2029/12/20
第6 0 回利付国債 (2 0 年)		1.4	570,000	606,388	2022/12/20	第1 1 6 回利付国債 (2 0 年)		2.2	600,000	660,444	2030/3/20
第6 1 回利付国債 (2 0 年)		1.0	390,000	399,383	2023/3/20	第1 1 7 回利付国債 (2 0 年)		2.1	1,200,000	1,302,648	2030/3/20
第6 2 回利付国債 (2 0 年)		0.8	250,000	250,600	2023/6/20	第1 1 8 回利付国債 (2 0 年)		2.0	800,000	854,016	2030/6/20
第6 3 回利付国債 (2 0 年)		1.8	570,000	628,054	2023/6/20	第1 1 9 回利付国債 (2 0 年)		1.8	200,000	207,420	2030/6/20
第6 4 回利付国債 (2 0 年)		1.9	410,000	455,842	2023/9/20	第1 2 0 回利付国債 (2 0 年)		1.6	200,000	201,232	2030/6/20
第6 5 回利付国債 (2 0 年)		1.9	370,000	411,229	2023/12/20	第1 2 1 回利付国債 (2 0 年)		1.9	800,000	838,808	2030/9/20
第6 6 回利付国債 (2 0 年)		1.8	240,000	264,201	2023/12/20	第1 2 2 回利付国債 (2 0 年)		1.8	1,100,000	1,136,542	2030/9/20
第6 7 回利付国債 (2 0 年)		1.9	510,000	566,268	2024/3/20	第1 2 3 回利付国債 (2 0 年)		2.1	850,000	915,518	2030/12/20
第6 8 回利付国債 (2 0 年)		2.2	230,000	262,827	2024/3/20	第1 2 4 回利付国債 (2 0 年)		2.0	600,000	636,942	2030/12/20
第6 9 回利付国債 (2 0 年)		2.1	350,000	396,172	2024/3/20	第1 2 5 回利付国債 (2 0 年)		2.2	300,000	327,159	2031/3/20
第7 0 回利付国債 (2 0 年)		2.4	400,000	465,416	2024/6/20	第1 2 6 回利付国債 (2 0 年)		2.0	800,000	847,392	2031/3/20
第7 1 回利付国債 (2 0 年)		2.2	400,000	456,844	2024/6/20	第1 2 7 回利付国債 (2 0 年)		1.9	500,000	521,830	2031/3/20
第7 2 回利付国債 (2 0 年)		2.1	920,000	1,040,290	2024/9/20	第1 2 8 回利付国債 (2 0 年)		1.9	800,000	832,344	2031/6/20
第7 3 回利付国債 (2 0 年)		2.0	540,000	604,189	2024/12/20	第1 2 9 回利付国債 (2 0 年)		1.8	800,000	819,832	2031/6/20
第7 4 回利付国債 (2 0 年)		2.1	310,000	350,374	2024/12/20	第1 3 0 回利付国債 (2 0 年)		1.8	1,100,000	1,124,332	2031/9/20
第7 5 回利付国債 (2 0 年)		2.1	360,000	406,645	2025/3/20	第1 3 1 回利付国債 (2 0 年)		1.7	500,000	502,845	2031/9/20
第7 6 回利付国債 (2 0 年)		1.9	530,000	586,439	2025/3/20	第1 3 3 回利付国債 (2 0 年)		1.8	1,600,000	1,631,056	2031/12/20
第7 7 回利付国債 (2 0 年)		2.0	410,000	458,392	2025/3/20	第1 3 4 回利付国債 (2 0 年)		1.8	500,000	508,325	2032/3/20
第7 8 回利付国債 (2 0 年)		1.9	200,000	220,958	2025/6/20	第1 3 5 回利付国債 (2 0 年)		1.7	900,000	900,648	2032/3/20
第7 9 回利付国債 (2 0 年)		2.0	300,000	334,950	2025/6/20	第1 3 6 回利付国債 (2 0 年)		1.6	400,000	393,652	2032/3/20
第8 0 回利付国債 (2 0 年)		2.1	250,000	282,055	2025/6/20	第1 3 7 回利付国債 (2 0 年)		1.7	500,000	498,905	2032/6/20
第8 1 回利付国債 (2 0 年)		2.0	720,000	802,677	2025/9/20	第1 3 8 回利付国債 (2 0 年)		1.5	600,000	579,528	2032/6/20
第8 2 回利付国債 (2 0 年)		2.1	510,000	574,627	2025/9/20	第1 3 9 回利付国債 (2 0 年)		1.6	600,000	589,092	2032/6/20
第8 3 回利付国債 (2 0 年)		2.1	530,000	596,287	2025/12/20	第1 4 0 回利付国債 (2 0 年)		1.7	2,010,000	2,002,623	2032/9/20
第8 4 回利付国債 (2 0 年)		2.0	500,000	556,510	2025/12/20	第1 4 1 回利付国債 (2 0 年)		1.7	1,010,000	1,004,020	2032/12/20
第8 5 回利付国債 (2 0 年)		2.1	550,000	617,798	2026/3/20	小 計			256,710,000	268,875,464	
第8 6 回利付国債 (2 0 年)		2.3	270,000	309,892	2026/3/20	地方債証券					
第8 7 回利付国債 (2 0 年)		2.2	500,000	567,425	2026/3/20	第3 回東京都公募債 (2 0 年)		2.26	100,000	114,076	2034/3/19
第8 8 回利付国債 (2 0 年)		2.3	400,000	458,476	2026/6/20	第4 回東京都公募債 (7 年)		0.51	100,000	101,269	2019/3/20
第8 9 回利付国債 (2 0 年)		2.2	800,000	907,024	2026/6/20	第7 回東京都公募債 (3 0 年)		2.51	200,000	218,012	2038/9/17
第9 0 回利付国債 (2 0 年)		2.2	220,000	249,024	2026/9/20	第1 1 回東京都公募債 (2 0 年)		2.22	200,000	224,140	2027/3/19
第9 1 回利付国債 (2 0 年)		2.3	600,000	686,694	2026/9/20	第1 8 回東京都公募債 (2 0 年)		2.22	200,000	220,594	2029/3/19
第9 2 回利付国債 (2 0 年)		2.1	1,750,000	1,955,135	2026/12/20	第2 0 回東京都公募債 (2 0 年)		2.09	100,000	107,797	2029/9/20
第9 3 回利付国債 (2 0 年)		2.0	600,000	661,662	2027/3/20	第2 1 回東京都公募債 (2 0 年)		2.19	100,000	109,017	2029/12/20
第9 4 回利付国債 (2 0 年)		2.1	800,000	891,944	2027/3/20	第6 0 8 回東京都公募債		1.58	100,000	101,691	2014/3/20

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609回東京都公募公債	1.52	200,000	203,244	2014/3/20	平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	100,000	106,432	2019/12/24
第616回東京都公募公債	1.41	100,000	102,454	2014/12/19	平成22年度第4回京都府公募公債	0.49	100,000	101,059	2015/12/21
第617回東京都公募公債	1.4	100,000	102,435	2014/12/19	平成16年度第10回兵庫県公募公債	1.5	100,000	102,478	2014/11/25
第619回東京都公募公債	1.53	100,000	103,044	2015/3/20	平成17年度第3回兵庫県公募公債	1.3	100,000	102,658	2015/5/26
第624回東京都公募公債	1.5	100,000	103,323	2015/6/19	平成18年度第3回兵庫県公募公債	2.0	110,000	116,678	2016/5/25
第628回東京都公募公債	1.59	100,000	104,254	2015/12/18	平成18年度第8回兵庫県公募公債	2.1	100,000	106,854	2016/8/24
第637回東京都公募公債	1.81	180,000	190,980	2016/9/20	平成18年度第10回兵庫県公募公債	2.01	100,000	106,915	2016/11/16
第642回東京都公募公債	1.84	100,000	106,588	2016/12/20	平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	100,000	107,798	2019/4/23
第646回東京都公募公債	1.99	100,000	107,988	2017/6/20	平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	100,000	106,928	2020/1/22
第647回東京都公募公債	1.97	100,000	107,900	2017/6/20	平成17年度第7回静岡県公募公債	1.7	100,000	104,984	2016/3/28
第656回東京都公募公債	1.51	100,000	106,712	2018/3/20	平成19年度第4回静岡県公募公債	1.94	100,000	108,024	2017/8/28
第657回東京都公募公債	1.81	100,000	108,243	2018/3/20	平成19年度第7回静岡県公募公債	1.81	100,000	107,783	2017/11/28
第659回東京都公募公債	1.62	100,000	107,539	2018/6/20	平成21年度第5回静岡県公募公債	1.35	100,000	106,478	2019/10/18
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	106,812	2020/3/19	平成22年度第3回静岡県公募公債	1.379	100,000	106,599	2020/5/25
第682回東京都公募公債	1.32	100,000	106,256	2020/3/19	平成23年度第1回静岡県公募公債	1.385	100,000	106,416	2021/4/21
第686回東京都公募公債	1.08	200,000	208,880	2020/6/19	平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	104,519	2021/6/28
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,260	2020/12/18	平成17年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.4	100,000	102,886	2015/4/27
第696回東京都公募公債	1.19	200,000	209,690	2021/6/18	平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	1.8	129,000	136,928	2016/10/17
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	103,242	2021/9/17	平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	1.71	100,000	108,353	2018/11/28
平成17年度第1回北海道公募公債	1.4	100,000	102,750	2015/4/28	平成20年度第10回愛知県公募公債(10年)	1.48	100,000	107,153	2019/3/27
平成19年度第14回北海道公募公債(10年)	1.68	100,000	107,175	2018/2/28	平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.61	100,000	107,992	2019/4/30
平成20年度第14回北海道公募公債	1.74	100,000	108,331	2019/2/27	平成22年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.417	100,000	106,884	2020/4/30
平成21年度第6回北海道公募公債	1.6	100,000	107,680	2019/8/28	平成22年度第5回愛知県公募公債(10年)	1.258	100,000	105,699	2020/6/30
平成22年度第1回北海道公募公債	1.47	100,000	106,806	2020/4/30	平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	2.087	100,000	106,183	2030/12/13
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	102,862	2020/10/29	平成23年度第4回愛知県公募公債(10年)	1.182	100,000	104,712	2021/6/28
平成23年度第4回北海道公募公債	1.21	100,000	104,436	2021/6/30	平成24年度第2回愛知県公募公債(10年)	0.982	100,000	102,497	2022/4/27
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	100,000	106,107	2031/1/24	平成16年度第1回広島県公募公債	1.3	100,000	102,443	2015/2/25
第126回神奈川県公募公債	1.5	100,000	101,747	2014/4/30	平成20年度第6回広島県公募公債	1.48	100,000	107,114	2019/3/25
第127回神奈川県公募公債	1.8	100,000	102,545	2014/7/30	平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	2.34	100,000	112,221	2028/9/21
第130回神奈川県公募公債	1.4	100,000	102,575	2015/1/28	平成19年度第2回埼玉県公募公債	1.93	100,000	107,740	2017/6/28
第134回神奈川県公募公債	1.4	100,000	103,307	2015/8/26	平成19年度第5回埼玉県公募公債	1.81	100,000	107,787	2017/11/29
第135回神奈川県公募公債	1.6	100,000	104,077	2015/10/28	平成19年度第7回埼玉県公募公債	1.65	100,000	107,317	2018/2/27
第162回神奈川県公募公債	1.62	100,000	108,128	2019/6/20	平成21年度第5回埼玉県公募公債	1.73	100,000	108,464	2018/11/27
第168回神奈川県公募公債	1.36	100,000	106,525	2019/12/20	平成21年度第2回埼玉県公募公債	1.57	100,000	107,803	2019/5/27
第173回神奈川県公募公債	1.3	100,000	105,977	2020/6/19	平成22年度第4回埼玉県公募公債	1.17	100,000	105,002	2020/7/28
第174回神奈川県公募公債	1.17	100,000	105,046	2020/6/19	平成22年度第9回埼玉県公募公債	0.99	100,000	102,720	2022/1/27
第175回神奈川県公募公債	1.09	100,000	104,474	2020/6/19	平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	100,000	110,970	2037/9/18
第190回神奈川県公募公債	0.88	100,000	101,455	2022/6/20	平成20年度第5回福岡県公募公債	1.67	100,000	108,075	2018/10/30
第50回大阪府公募公債(5年)	0.92	100,000	101,082	2014/6/27	平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	200,000	208,410	2038/9/17
第267回大阪府公募公債(10年)	1.6	100,000	102,050	2014/6/27	平成21年度第5回福岡県公募公債	1.37	100,000	106,600	2019/10/28
第275回大阪府公募公債(10年)	1.3	100,000	102,379	2015/2/25	平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	1.765	100,000	107,326	2026/1/26
第285回大阪府公募公債(10年)	1.5	100,000	103,868	2015/12/25	第8回千葉県公募公債(20年)	2.18	100,000	108,347	2030/4/19
第286回大阪府公募公債(10年)	1.5	100,000	103,979	2016/1/29	平成18年度第6回千葉県公募公債	1.7	175,000	185,556	2016/12/22
第293回大阪府公募公債(10年)	2.1	100,000	106,848	2016/8/30	平成18年度第7回千葉県公募公債	1.8	100,000	106,664	2017/2/24
第298回大阪府公募公債(10年)	1.9	100,000	106,760	2017/1/30	平成21年度第3回千葉県公募公債	1.64	100,000	108,271	2019/6/25
第305回大阪府公募公債(10年)	1.93	100,000	107,767	2017/8/30	平成22年度第4回千葉県公募公債	1.17	100,000	105,033	2020/7/24
第309回大阪府公募公債(10年)	1.65	100,000	106,867	2017/12/27	平成22年度第9回千葉県公募公債	1.22	100,000	105,206	2020/12/25
第324回大阪府公募公債(10年)	1.64	100,000	107,836	2019/3/29	平成17年度第1回新潟県公募公債	1.3	100,000	102,933	2015/7/29
第331回大阪府公募公債(10年)	1.41	100,000	106,515	2019/10/29	平成20年度第2回新潟県公募公債	1.52	100,000	107,305	2019/2/27
第335回大阪府公募公債(10年)	1.47	100,000	106,903	2020/1/28	平成18年度第1回岐阜県公募公債	1.8	100,000	106,169	2016/10/31
第335回大阪府公募公債(10年)	1.48	100,000	106,974	2020/2/25	第15回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	102,100	2014/6/25
第339回大阪府公募公債(10年)	1.37	100,000	106,120	2020/6/29	第16回共同発行市場公募地方債	1.8	127,000	130,202	2014/7/25
第356回大阪府公募公債(10年)	1.06	130,000	133,764	2021/12/27	第17回共同発行市場公募地方債	1.8	100,000	102,663	2014/8/25
平成17年度第3回京都府公募公債	1.5	100,000	104,008	2015/12/22	第18回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	102,463	2014/9/25
平成20年度第6回京都府公募公債	1.48	100,000	107,179	2019/3/25	第19回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	102,580	2014/10/24
平成21年度第4回京都府公募公債	0.59	100,000	100,888	2014/12/22	第20回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	102,525	2014/11/25

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2 2回共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	102,547	2015/1/23	平成2 1年度第5回京都市公募公債	1.45	100,000	106,988	2020/2/25
第2 3回共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	102,464	2015/2/25	平成2 2年度第3回京都市公募公債	0.38	100,000	100,628	2015/9/29
第2 4回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	102,987	2015/3/25	第5回横浜市公募公債(2 0年)	2.17	100,000	112,608	2025/6/20
第2 6回共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	102,751	2015/5/25	平成1 7年度第3回横浜市公募公債	1.6	100,000	103,932	2015/9/22
第2 7回共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	102,850	2015/6/25	平成2 0年度第1回横浜市公募公債	1.86	100,000	108,707	2018/5/25
第3 5回共同発行市場公募地方債	1.6	160,000	167,270	2016/2/25	平成2 0年度第6回横浜市公募公債	1.51	100,000	107,303	2019/2/15
第3 8回共同発行市場公募地方債	2.0	100,000	106,195	2016/5/25	平成2 1年度第6回横浜市公募公債	1.36	100,000	106,525	2019/12/20
第4 8回共同発行市場公募地方債	1.7	100,000	106,374	2017/3/24	平成2 2年度第1回横浜市公募公債	1.36	100,000	106,464	2020/5/25
第5 3回共同発行市場公募地方債	1.8	200,000	214,746	2017/8/25	平成2 2年度第3回横浜市公募公債	1.168	100,000	104,924	2020/9/18
第5 4回共同発行市場公募地方債	1.7	100,000	107,044	2017/9/25	平成2 2年度第4回横浜市公募公債	0.947	100,000	103,225	2020/10/28
第5 6回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	107,334	2017/11/24	平成2 3年度第1回横浜市公募公債	1.189	100,000	104,799	2021/5/24
第5 7回共同発行市場公募地方債	1.65	100,000	107,120	2017/12/25	平成2 3年度第4回横浜市公募公債	1.045	100,000	103,290	2021/11/12
第6 3回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	108,922	2018/6/25	平成1 8年度第4回札幌市公募公債	1.8	100,000	106,025	2016/9/20
第6 5回共同発行市場公募地方債	1.62	100,000	107,665	2018/8/24	平成2 3年度第4回札幌市公募公債(1 0年)	1.02	100,000	103,360	2021/6/18
第6 7回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	107,092	2018/10/25	第7 9回川崎市公募公債	1.86	100,000	107,738	2017/9/20
第7 2回共同発行市場公募地方債	1.46	100,000	107,058	2019/3/25	平成1 9年度第3回福岡市公募公債	1.87	100,000	107,862	2017/10/24
第7 4回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	107,793	2019/5/24	平成1 9年度第5回福岡市公募公債	1.49	100,000	106,528	2018/3/28
第7 5回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	108,271	2019/6/25	平成2 0年度第5回福岡市公募公債	1.57	100,000	107,394	2018/10/24
第7 6回共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	106,779	2019/7/25	平成1 7年度第1回広島市公募公債	1.5	100,000	103,948	2015/12/22
第7 7回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	215,388	2019/8/23	平成2 3年度第2回岡山県公募公債(1 0年)	1.01	100,000	102,719	2022/3/30
第7 8回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	106,715	2019/9/25	小計		21,317,700	22,524,396	
第7 9回共同発行市場公募地方債	1.34	100,000	106,395	2019/10/25	特殊債券(除く金融債)				
第8 0回共同発行市場公募地方債	1.54	100,000	107,734	2019/11/25	第3 2 8回政府保証道路債	1.5	100,000	101,880	2014/5/28
第8 2回共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	106,916	2020/1/24	第3 2 9回政府保証道路債	1.6	150,000	153,195	2014/6/27
第8 3回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	107,067	2020/2/25	第3 3 0回政府保証道路債	1.8	100,000	102,563	2014/7/29
第8 4回共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	106,614	2020/3/25	第3 3 3回政府保証道路債	1.6	100,000	102,632	2014/10/28
第8 5回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	107,031	2020/4/24	第3 3 4回政府保証道路債	1.5	100,000	102,574	2014/11/28
第8 7回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,918	2020/6/25	第3 3 5回政府保証道路債	1.4	100,000	102,492	2014/12/24
第8 8回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	105,033	2020/7/24	第3 3 6回政府保証道路債	1.4	131,000	134,426	2015/1/28
第9 3回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,434	2020/12/25	第3 4 3回政府保証道路債	1.3	100,000	102,916	2015/6/30
第9 4回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,332	2021/1/25	第3 4 6回政府保証道路債	1.4	115,000	118,864	2015/8/26
第9 5回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,615	2021/2/25	第1 9 7回政府保証首都高速道路債	1.5	100,000	103,013	2015/3/23
第9 6回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,661	2021/3/25	第1 4 4回政府保証阪神高速道路債	1.5	100,000	102,990	2015/3/17
第9 7回共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	106,381	2021/4/23	第1 4 8回政府保証阪神高速道路債	1.3	100,000	103,188	2015/9/30
第9 8回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	104,729	2021/5/25	第3 回政府保証東日本高速道路債	2.0	100,000	106,693	2016/8/25
第9 9回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	104,611	2021/6/25	第8 回政府保証東日本高速道路債	2.0	100,000	106,643	2016/8/12
第1 0 0回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	104,890	2021/7/23	第1 0回政府保証中日本高速道路債	1.8	172,000	182,887	2016/11/18
第1 0 1回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,506	2021/8/25	第2 0回政府保証中日本高速道路債	1.4	100,000	106,191	2018/3/16
第1 0 2回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	103,289	2021/9/24	第3 回政府保証西日本高速道路債	1.8	100,000	106,375	2016/11/28
第1 0 3回共同発行市場公募地方債	1.0	220,000	226,472	2021/10/25	第2 0回政府保証西日本高速道路債	1.4	100,000	106,859	2019/7/29
第1 0 5回共同発行市場公募地方債	1.07	100,000	103,454	2021/12/24	第2 回政府保証公営企業債券(1 5年)	2.1	100,000	112,291	2021/4/16
第1 1 0回共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	304,863	2022/5/25	第2 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	200,000	215,662	2018/11/16
平成1 8年度第1回静岡市公募公債	1.91	100,000	106,694	2016/11/28	第3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	107,553	2019/8/16
平成1 6年度第5回大阪市公募公債	1.6	100,000	102,550	2014/10/28	第4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	100,000	106,143	2019/1/22
平成1 7年度第1回大阪市公募公債	1.3	100,000	102,745	2015/6/23	第5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,596	2019/10/18
平成1 8年度第3回大阪市公募公債	2.1	200,000	213,406	2016/7/27	第6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	106,925	2019/11/18
平成2 1年度第7回大阪市公募公債	1.47	100,000	106,973	2020/1/27	第8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	106,234	2020/1/20
第1 回名古屋市公募公債(2 0年)	1.99	100,000	111,159	2023/12/20	第1 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	106,214	2020/3/13
第1 2 回ひ号名古屋市公募公債	1.4	100,000	101,491	2014/3/24	第1 1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	106,921	2020/4/17
第1 2 回し号名古屋市公募公債	1.5	100,000	102,980	2015/3/23	第1 3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	106,152	2020/6/12
第1 2 回せ号名古屋市公募公債	1.4	100,000	103,422	2015/9/28	第1 4回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	104,666	2020/7/17
第1 2 回す号名古屋市公募公債	1.7	100,000	104,933	2016/3/16	第2 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,178	2021/1/20
第4 5 5 8回名古屋市公募公債(1 0年)	1.9	186,700	197,879	2016/6/20	第2 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	104,160	2021/7/16
第4 6 4 4回名古屋市公募公債(1 0年)	1.61	100,000	107,649	2018/9/20	第2 7回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	103,297	2021/8/13
第2 回京都市公募公債(2 0年)	2.12	100,000	111,643	2025/9/19	第8 3 8 8回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	101,748	2014/4/25
平成1 9年度第2 回京都市公募公債	1.74	100,000	107,463	2017/12/27	第8 3 9 9回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	101,866	2014/5/26

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841回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	102,545	2014/7/25	第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	107,152	2018/9/28
第843回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	102,345	2014/9/29	第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	200,000	215,546	2018/10/31
第847回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,612	2015/1/27	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	107,844	2018/11/28
第848回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	102,504	2015/2/24	第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,179	2019/2/27
第850回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,911	2015/4/21	第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,201	2019/3/19
第851回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	102,787	2015/5/25	第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	213,666	2019/4/30
第852回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	102,901	2015/6/29	第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	107,480	2019/5/31
第855回政府保証公営企業債券	1.3	100,000	103,163	2015/9/18	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	107,187	2019/7/31
第857回政府保証公営企業債券	1.6	100,000	104,257	2015/11/27	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,279	2019/9/30
第859回政府保証公営企業債券	1.5	100,000	104,182	2016/1/25	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	216,888	2019/9/28
第860回政府保証公営企業債券	1.6	100,000	104,584	2016/2/19	第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	105,589	2019/10/31
第862回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	105,457	2016/4/20	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	106,919	2019/11/29
第864回政府保証公営企業債券	1.9	100,000	106,052	2016/6/22	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	105,571	2019/12/27
第871回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	106,637	2017/1/25	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,224	2020/1/31
第877回政府保証公営企業債券	1.9	200,000	215,546	2017/7/18	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	219,134	2030/1/31
第879回政府保証公営企業債券	1.7	200,000	214,188	2017/9/19	第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	106,910	2020/2/28
第884回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	106,296	2018/4/17	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,228	2020/3/19
第885回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	107,965	2018/5/22	第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	106,877	2020/4/30
第886回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	108,584	2018/6/19	第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	200,000	212,320	2020/5/29
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	1.0	100,000	102,153	2015/6/16	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	104,425	2040/5/31
第4回政府保証日本政策金融公庫債券	0.8	100,000	101,826	2015/9/11	第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,153	2020/6/30
第184回政府保証中小企業債券	1.4	100,000	102,482	2014/12/24	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	106,023	2030/6/28
第187回政府保証中小企業債券	1.5	100,000	104,012	2015/12/15	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	270,000	277,951	2020/11/30
第191回政府保証中小企業債券	1.7	200,000	214,154	2017/9/15	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	102,059	2040/11/30
第15回政府保証国民生活債券	1.5	100,000	102,994	2015/3/18	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	105,889	2021/4/30
第19回政府保証国民生活債券	1.7	125,000	132,601	2016/12/19	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	104,136	2021/7/30
第20回政府保証国民生活債券	1.4	100,000	102,129	2014/9/18	第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	103,117	2021/10/29
第8回政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	100,000	102,697	2014/8/27	第150回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.3	100,000	100,569	2015/11/30
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	210,000	234,282	2021/12/22	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	300,000	306,183	2022/2/28
第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	200,000	213,494	2017/2/28	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	102,588	2022/4/28
第21回政府保証日本政策投資銀行債券	1.6	100,000	107,116	2018/1/19	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	101,899	2022/5/31
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	104,065	2015/12/25	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	101,150	2022/7/29
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	157,000	166,529	2016/6/22					
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	101,000	107,648	2016/7/28					
第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	106,404	2016/11/30					
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	125,000	133,302	2017/1/31					
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	106,575	2017/4/25					
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	106,684	2017/5/26					
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	215,908	2017/8/31					
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	113,020	2027/10/29					
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	200,000	214,732	2017/11/30					
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	106,598	2018/1/31					
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	106,241	2018/3/23					
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	106,306	2018/4/20					
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	200,000	215,994	2018/5/30					
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	108,160	2018/7/31					

銘柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,921	2021/3/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	217,000	220,830	2022/6/17
第2回政府保証本州四国連絡橋債券	1.4	100,000	103,365	2015/8/31
第17回政府保証預金保険機構債券	0.3	100,000	100,270	2014/6/13
第16回日本政策投資銀行債券	1.52	100,000	102,188	2014/9/19
第19回日本政策投資銀行債券	1.4	100,000	102,599	2015/3/20
第24回日本政策投資銀行債券	1.65	100,000	103,842	2015/9/18
第29回日本政策投資銀行債券	1.86	100,000	106,356	2016/12/20
第41回日本政策投資銀行債券	1.73	100,000	106,817	2017/9/20
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	108,230	2045/9/20
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.64	100,000	104,157	2015/12/18
第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.65	100,000	104,186	2015/12/18
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	150,000	171,300	2026/3/19
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	111,241	2027/4/20
第21回道路債券	2.75	100,000	111,364	2033/6/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	201,440	2047/9/20
第27回道路債券	2.42	100,000	114,599	2024/3/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	111,625	2027/10/20
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	106,250	2017/12/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.61	100,000	106,759	2018/3/20
第33回道路債券	2.91	100,000	113,293	2034/6/20
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.65	100,000	106,962	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	112,148	2028/6/20
第38回道路債券	2.26	100,000	112,804	2024/9/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	100,000	111,247	2028/9/20
第41回道路債券	1.52	100,000	102,835	2015/3/20
第42回道路債券	2.22	100,000	112,252	2025/3/21
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.62	100,000	107,383	2018/12/20
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	107,824	2019/3/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	108,064	2019/3/20
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	110,938	2029/5/18
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	106,119	2019/9/20
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.43	100,000	106,424	2019/12/20
第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.35	100,000	105,840	2020/3/19
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	104,947	2020/6/19
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.14	100,000	103,739	2021/6/18
第1回地方公営企業等金融機構債券	1.77	100,000	108,321	2018/9/25
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	110,616	2029/4/27
第4回地方公営企業等金融機構債券	1.593	100,000	107,681	2019/5/28
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.12	100,000	107,361	2029/12/28
第5回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	112,107	2023/9/20
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.22	200,000	217,460	2030/1/28
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	108,212	2030/4/26
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	114,258	2024/9/24
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	111,677	2025/3/24
第12回公営企業債券	1.53	200,000	204,564	2014/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券	1.38	100,000	106,273	2020/5/28
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	105,749	2030/12/27
第13回公営企業債券	1.56	100,000	103,024	2015/3/24
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	111,864	2025/9/24
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	312,792	2031/6/27
第17回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	228,572	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	101,546	2013/9/26
第19回公営企業債券	2.02	200,000	211,686	2016/3/24
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	111,470	2028/4/25
第5回首都高速道路株式会社債	0.67	100,000	100,825	2014/12/19

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回阪神高速道路債券	1.48	100,000	102,727	2015/3/20
第7回株式会社日本政策金融公庫社債	0.618	100,000	100,803	2014/12/19
第15回国際協力銀行債券	1.74	100,000	102,176	2014/6/20
第16回国際協力銀行債券	2.07	100,000	110,728	2019/9/20
第19回国際協力銀行債券	1.67	100,000	108,161	2020/3/19
第21回国際協力銀行債券	1.58	100,000	103,657	2015/9/18
第25回国際協力銀行債券	2.04	100,000	105,776	2016/3/18
第16回都市再生債券	1.76	100,000	106,758	2017/9/20
第34回都市再生債券	1.39	100,000	105,910	2019/9/20
第43回都市再生債券	1.29	100,000	104,934	2020/9/18
第49回都市再生債券	1.46	100,000	106,066	2021/2/26
第323回東京交通債券	3.9	100,000	111,693	2016/3/29
第324回東京交通債券	3.4	100,000	112,699	2017/2/7
第344回東京交通債券	1.67	100,000	107,557	2023/2/17
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	30,405	31,726	2036/5/10
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	263,800	281,245	2047/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	74,496	79,346	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	38,562	41,415	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	1.8	100,000	106,428	2017/3/17
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	93,510	98,917	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	32,414	34,147	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	33,663	36,210	2037/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	113,859	2027/6/18
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	23,123	24,182	2037/8/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	136,572	146,872	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	35,312	37,816	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	109,858	116,259	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	35,145	37,680	2037/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	54,200	56,061	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	36,072	38,602	2037/5/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	30,875	31,183	2038/6/10
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	1.66	100,000	106,734	2017/12/20
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	34,436	35,946	2038/9/10
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.15	57,846	61,675	2040/11/10
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	1.86	100,000	108,057	2018/3/20
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	182,901	192,867	2032/11/10
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	1.69	100,000	107,591	2018/9/5
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	37,669	39,679	2039/5/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	61,194	64,132	2032/11/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	78,754	83,807	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	1.92	200,000	217,848	2018/9/20
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	2.36	100,000	114,751	2028/9/20
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.4	67,198	72,400	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	42,052	43,980	2039/12/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	65,821	70,710	2044/6/10
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	1.67	100,000	107,704	2018/12/20
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	131,500	140,231	2044/7/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	46,721	48,971	2040/3/10
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	149,610	157,065	2040/4/10
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	1.64	100,000	107,611	2019/3/20
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	111,173	2024/6/20
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	52,730	55,013	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	165,933	173,003	2040/7/10
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	56,636	59,450	2040/9/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	78,810	82,880	2045/3/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	82,994	87,343	2045/4/10

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	53,037	55,821	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	84,208	88,319	2045/5/10	
第3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	53,272	56,065	2040/12/10	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	157,155	165,031	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	174,532	179,551	2045/8/10	
第4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	107,066	112,896	2041/3/10	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	54,144	57,595	2041/4/10	
第4 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	106,892	2019/12/20	
第4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	51,285	55,282	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	90,150	92,172	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	90,501	93,658	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	108,960	2030/2/10	
第4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	90,857	95,253	2046/2/10	
第4 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	48,435	51,761	2041/10/10	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	92,427	96,580	2046/7/10	
第5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	92,874	96,363	2046/7/10	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	153,045	163,689	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	93,327	96,701	2046/8/10	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	52,377	55,661	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	94,538	96,698	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	94,844	96,889	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	95,505	97,181	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	95,865	97,800	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	99,828	98,676	2047/12/10	
第6 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	1.478	100,000	106,474	2021/4/19	
第1 1 回農林漁業金融公庫債券	1.78	100,000	106,389	2017/3/17	
第5 回中日本高速道路株式会社社債	1.86	100,000	108,170	2018/9/20	
第6 回中日本高速道路株式会社社債	1.73	100,000	107,615	2018/12/20	
第1 4 回中日本高速道路株式会社社債	0.623	100,000	100,779	2015/3/20	
第3 6 回韓国産業銀行円貨債券 (期限前償還請求権条項付)	1.91	100,000	103,680	2016/10/21	
小計		27,463,084	29,116,184		
金融債券					
い第7 0 5 号商工債	1.4	100,000	101,354	2014/2/27	
い第7 0 7 号商工債	1.35	200,000	202,980	2014/4/25	
い第7 1 0 号商工債	0.95	200,000	202,370	2014/7/25	
い第7 1 3 号商工債	0.8	100,000	101,123	2014/10/27	
い第7 1 4 号商工債	0.9	100,000	101,343	2014/11/27	
い第7 1 5 号商工債	0.7	100,000	101,007	2014/12/26	
い第7 1 6 号商工債	0.7	100,000	101,064	2015/1/27	
い第7 1 7 号商工債	0.7	100,000	101,109	2015/2/27	
い第7 2 6 号商工債	0.45	100,000	100,807	2015/11/27	
い第7 3 3 号商工債	0.55	100,000	101,261	2016/6/27	
い第7 4 0 号商工債	0.45	100,000	100,995	2017/1/27	
い第7 4 1 号商工債	0.45	200,000	202,032	2017/2/27	
い第7 0 8 号農林債	1.15	100,000	101,278	2014/5/27	
い第7 1 7 号農林債	0.75	100,000	101,150	2015/2/27	
い第7 1 8 号農林債	0.7	100,000	101,084	2015/3/27	
い第7 2 0 号農林債	0.65	100,000	101,050	2015/5/27	
い第7 2 1 号農林債	0.6	100,000	100,966	2015/6/27	
い第7 2 4 号農林債	0.5	100,000	100,784	2015/9/25	
い第7 2 5 号農林債	0.4	100,000	100,535	2015/10/27	
い第7 2 8 号農林債	0.55	100,000	101,047	2016/1/27	
い第7 2 9 号農林債	0.75	100,000	101,691	2016/2/26	
い第7 3 0 号農林債	0.7	100,000	101,557	2016/3/25	
い第7 3 2 号農林債	0.6	200,000	202,588	2016/5/27	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
い第7 3 6 号農林債	0.5	100,000	101,021	2016/9/27	
い第7 4 5 号農林債	0.35	120,000	120,526	2017/6/27	
第2 3 4 回信金中金債(5年)	1.15	100,000	101,319	2014/5/27	
第2 3 7 回信金中金債(5年)	1.0	100,000	101,327	2014/8/27	
第2 3 8 回信金中金債(5年)	0.85	100,000	101,136	2014/9/26	
第2 4 3 回信金中金債(5年)	0.7	100,000	101,109	2015/2/27	
第2 4 6 回信金中金債(5年)	0.65	100,000	101,121	2015/5/27	
第2 4 8 回信金中金債(5年)	0.55	100,000	100,937	2015/7/27	
第2 5 1 回信金中金債(5年)	0.35	100,000	100,480	2015/10/27	
第2 5 9 回信金中金債(5年)	0.55	100,000	101,244	2016/6/27	
第2 6 5 回信金中金債(5年)	0.5	100,000	101,169	2016/12/27	
第2 6 6 回信金中金債(5年)	0.45	100,000	100,975	2017/1/27	
第2 6 7 回信金中金債(5年)	0.45	100,000	100,995	2017/2/27	
第2 7 8 回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,346	2018/1/26	
小計		4,120,000	4,164,880		
普通社債券(含む投資法人債券)					
第4 5 7 回東京電力株式会社社債	2.05	100,000	92,860	2018/11/16	
第5 1 1 回東京電力株式会社社債	1.615	100,000	98,610	2014/5/28	
第5 1 3 回東京電力株式会社社債	1.85	100,000	98,786	2014/7/28	
第5 1 4 回東京電力株式会社社債	1.565	100,000	98,101	2014/10/29	
第5 1 5 回東京電力株式会社社債	1.435	100,000	97,351	2015/2/10	
第5 1 6 回東京電力株式会社社債	1.42	100,000	97,056	2015/4/27	
第5 1 8 回東京電力株式会社社債	1.36	100,000	96,534	2015/8/12	
第5 1 9 回東京電力株式会社社債	1.59	100,000	96,135	2015/12/28	
第5 2 1 回東京電力株式会社社債	1.47	100,000	96,694	2016/6/27	
第5 2 2 回東京電力株式会社社債	2.06	100,000	96,499	2016/8/31	
第5 3 9 回東京電力株式会社社債	1.591	100,000	91,673	2018/3/28	
第5 4 2 回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	91,577	2018/4/25	
第5 4 4 回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	93,120	2018/6/25	
第4 0 5 回中部電力株式会社社債	4.15	100,000	108,214	2015/4/24	
第4 0 6 回中部電力株式会社社債	3.75	200,000	215,658	2015/6/25	
第4 2 6 回中部電力株式会社社債	2.75	100,000	111,754	2019/1/25	
第4 6 6 回中部電力株式会社社債	1.61	100,000	101,926	2014/9/25	
第4 7 8 回中部電力株式会社社債	1.89	100,000	104,837	2016/9/23	
第4 8 0 回中部電力株式会社社債	1.79	100,000	104,821	2017/1/25	
第4 8 4 回中部電力株式会社社債	1.41	100,000	101,594	2014/9/25	
第4 4 8 回関西電力株式会社社債	2.16	100,000	102,762	2018/6/20	
第4 6 3 回関西電力株式会社社債	1.64	100,000	100,121	2018/4/25	
第3 0 6 回中国電力株式会社社債	3.6	100,000	111,408	2016/10/25	
第3 1 1 回中国電力株式会社社債	2.9	100,000	110,507	2017/10/25	
第3 5 4 回中国電力株式会社社債	1.905	100,000	106,418	2018/5/25	
第2 8 3 回北陸電力株式会社社債	2.11	100,000	105,671	2016/8/25	
第2 8 8 回北陸電力株式会社社債	1.89	100,000	105,940	2017/10/25	
第3 8 3 回東北電力株式会社社債	2.9	100,000	108,128	2017/12/25	
第4 1 4 回東北電力株式会社社債	0.85	100,000	100,178	2015/4/24	
第4 1 6 回東北電力株式会社社債	0.83	100,000	97,942	2018/6/25	
第4 2 0 回東北電力株式会社社債	1.36	100,000	100,776	2014/2/25	
第4 3 5 回東北電力株式会社社債	1.88	100,000	103,429	2016/10/25	
第2 5 3 回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	96,807	2023/6/23	
第3 7 1 回九州電力株式会社社債	1.43	100,000	98,128	2022/12/22	
第3 8 4 回九州電力株式会社社債	1.47	100,000	102,445	2017/6/23	
第3 8 7 回九州電力株式会社社債	1.69	100,000	102,877	2016/3/25	
第3 9 1 回九州電力株式会社社債	1.82	100,000	103,780	2017/1/25	
第4 0 5 回九州電力株式会社社債	1.792	100,000	103,793	2018/11/22	
第2 5 7 回北海道電力株式会社社債	3.85	100,000	110,410	2016/4/25	
第2 8 4 回北海道電力株式会社社債	1.48	100,000	102,765	2016/2/25	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第285回北海道電力株式会社社債	1.69	100,000	103,618	2016/6/24	
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.325	100,000	100,014	2017/12/20	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	106,883	2018/3/19	
第8回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.505	100,000	100,876	2016/9/26	
第5回日本たばこ産業株式会社社債	1.128	100,000	101,232	2014/4/6	
第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.852	100,000	102,254	2017/6/20	
第29回王子製紙株式会社無担保社債	0.386	100,000	99,947	2017/7/26	
第43回住友化学株式会社無担保社債	1.58	100,000	103,868	2020/4/23	
第37回三菱化学株式会社無担保社債	2.03	100,000	108,519	2018/8/10	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	1.106	100,000	103,562	2018/3/8	
第7回ユーザイ株式会社無担保社債	1.83	100,000	103,728	2015/6/5	
第2回第一三共株式会社無担保社債	1.776	100,000	108,313	2019/6/24	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,085	2017/12/4	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	2.27	100,000	106,211	2016/6/8	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	101,433	2021/3/19	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.77	100,000	101,774	2018/8/31	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.66	100,000	103,787	2015/9/18	
第42回三菱電機株式会社無担保社債	1.168	100,000	101,327	2014/6/17	
第1回日本電産株式会社無担保社債	0.386	100,000	100,199	2017/9/20	
第17回ソニー株式会社無担保社債	1.57	100,000	100,701	2015/6/19	
第25回ソニー株式会社無担保社債	1.298	100,000	100,665	2014/6/20	
第26回ソニー株式会社無担保社債	2.068	100,000	99,288	2019/6/20	
第3回松下電工株式会社無担保社債	1.66	100,000	100,897	2015/6/19	
第22回三菱重工株式会社無担保社債	2.03	100,000	107,790	2017/9/12	
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	106,142	2019/12/9	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	1.17	100,000	103,040	2017/4/28	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	1.073	100,000	101,268	2014/6/20	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	1.772	100,000	108,571	2019/6/20	
第5回アイン精工株式会社無担保社債	1.35	100,000	102,294	2015/2/27	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.135	100,000	103,237	2020/7/29	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.221	100,000	103,437	2021/9/14	
第92回丸紅株式会社無担保社債	0.756	100,000	100,730	2019/7/19	
第58回三井物産株式会社無担保社債	1.94	100,000	106,419	2016/12/20	
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	107,366	2022/3/16	
第46回三菱商事株式会社無担保社債	1.23	100,000	102,000	2015/1/30	
第53回三菱商事株式会社無担保社債	0.91	100,000	101,536	2015/5/8	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	1.9	100,000	108,219	2018/7/25	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	1.231	100,000	104,296	2020/7/29	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	104,490	2021/5/24	
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	106,396	2026/10/30	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	1.235	300,000	304,062	2014/6/3	
第17回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.96	100,000	101,084	2014/7/25	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.83	100,000	101,023	2014/10/16	
第19回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.71	200,000	201,878	2015/1/27	
第20回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.71	200,000	202,090	2015/4/20	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.43	100,000	100,503	2015/10/20	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.755	100,000	101,640	2016/4/20	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.31	100,000	103,481	2020/11/12	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.56	100,000	105,275	2021/1/20	
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	105,609	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	104,428	2022/1/26	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.22	200,000	225,814	2022/10/27	
第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.06	200,000	212,110	2016/4/13	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.87	100,000	107,000	2017/4/20	
第106回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.905	300,000	303,303	2014/7/17	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.575	100,000	107,492	2019/7/17	
第109回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.775	100,000	101,061	2014/10/16	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	100,000	104,355	2020/9/28	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.61	200,000	211,226	2020/12/17	
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	200,000	210,776	2021/6/1	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.91	100,000	101,086	2014/7/18	
第48回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.77	100,000	101,031	2014/10/20	
第50回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.5	100,000	100,789	2015/7/17	
第51回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.35	100,000	100,449	2015/10/20	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.56	200,000	202,262	2016/1/20	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.04	100,000	108,032	2020/8/7	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.99	100,000	106,023	2017/4/27	
第37回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.76	100,000	100,965	2014/12/19	
第14回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.688	100,000	100,808	2015/9/18	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.747	100,000	101,143	2016/3/18	
第21回株式会社ソダファイナンス無担保社債	0.35	200,000	200,268	2017/12/20	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	2.07	100,000	106,168	2016/6/20	
第25回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	1.62	100,000	101,626	2014/3/20	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.57	100,000	100,793	2016/12/20	
第2回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.57	100,000	100,810	2017/6/20	
第138回オリエックス株式会社無担保社債	1.69	100,000	104,668	2017/8/25	
第163回オリエックス株式会社無担保社債	0.746	100,000	100,455	2017/8/7	
第12回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.634	100,000	100,902	2016/1/21	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.487	100,000	100,486	2017/5/29	
第2回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.937	100,000	100,646	2015/6/24	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.808	100,000	103,073	2020/6/24	
第2回大和証券キャピタル・マーケット株式会社無担保社債	0.94	100,000	99,743	2015/7/21	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.67	100,000	100,954	2016/1/27	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	1.061	100,000	102,996	2020/6/19	
第48回三菱地所株式会社無担保社債	2.5	100,000	113,682	2020/5/15	
第70回三菱地所株式会社無担保社債	1.675	100,000	101,693	2014/3/20	
第78回三菱地所株式会社無担保社債	1.88	100,000	106,315	2016/12/20	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	1.79	100,000	106,263	2017/3/27	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	111,898	2027/9/17	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.03	100,000	102,830	2020/9/18	
第75回東京急行鉄道路株式会社無担保社債	0.982	100,000	101,144	2022/6/7	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	3.3	200,000	227,778	2017/8/25	
第13回東日本旅客鉄道株式会社社債	2.6	100,000	114,624	2020/2/25	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	2.65	100,000	115,422	2020/8/25	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	110,939	2022/9/20	
第33回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.87	100,000	102,359	2014/6/20	
第37回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.49	100,000	102,460	2014/12/19	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.86	100,000	109,590	2020/12/18	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.86	100,000	107,440	2017/9/20	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.62	100,000	106,948	2018/4/20	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.874	100,000	100,654	2022/7/22	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	2.41	100,000	112,083	2018/12/25	

銘 柄	当 期 末			償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第1回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	112,656	2024/3/20
第5回東海旅客鉄道株式会社普通社債	2.6	100,000	114,547	2020/1/28
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.42	100,000	105,389	2017/9/20
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.77	200,000	214,002	2017/9/20
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.0	100,000	106,075	2016/6/20
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	107,762	2030/4/23
第3回東京地下鉄株式会社社債	1.9	100,000	106,138	2016/9/20
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	111,295	2027/12/20
第27回日本郵船株式会社無担保社債	2.05	100,000	105,241	2017/6/20
第12回三井倉庫株式会社無担保社債	0.67	100,000	101,068	2018/6/7
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	1.238	100,000	104,374	2020/9/10
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.61	100,000	102,337	2014/9/19
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.58	100,000	103,657	2015/9/18
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	2.06	200,000	212,556	2016/6/20
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.77	100,000	106,348	2017/3/17
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.54	100,000	106,204	2017/12/20
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.69	100,000	108,092	2019/6/20
第18回KDD I株式会社無担保社債	1.573	100,000	106,682	2019/12/20
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	1.96	100,000	108,799	2018/6/20
第9回沖繩電力株式会社社債	0.88	100,000	102,528	2018/3/20
第16回電源開発株式会社無担保社債	1.99	100,000	104,766	2016/6/20
第17回電源開発株式会社無担保社債	2.07	100,000	105,034	2016/6/20
第19回電源開発株式会社無担保社債	1.94	100,000	105,627	2017/6/20
第21回電源開発株式会社無担保社債	1.69	100,000	104,739	2017/9/20
第29回電源開発株式会社無担保社債	1.405	100,000	103,327	2019/11/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	102,953	2020/5/20
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.658	100,000	103,432	2015/5/29
第7回大阪瓦斯株式会社無担保社債	3.4	100,000	113,025	2017/3/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	113,113	2018/1/30
第25回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.21	100,000	102,288	2015/4/24
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	1.6	100,000	106,600	2018/3/20
第24回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.66	100,000	101,078	2015/6/19
第1回フランス電力円貨社債	1.63	100,000	100,518	2014/10/9
第1回ジーディーエフ・スズパ円貨社債	1.17	100,000	100,094	2014/12/15
第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券	1.23	100,000	101,704	2014/10/27

銘 柄	当 期 末			償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	1.77	200,000	203,240	2014/6/2
第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	1.84	100,000	103,482	2015/11/20
第17回シティグループ・インク円貨社債	2.04	100,000	102,923	2020/9/16
第22回シティグループ・インク円貨社債	2.13	100,000	102,257	2014/6/20
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	1.79	100,000	102,187	2014/12/3
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	1.16	100,000	101,764	2015/7/29
第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	1.03	100,000	101,958	2016/7/8
第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	1.3	200,000	206,174	2017/1/20
第2回ウエストバック・バンキング・コーポ・円貨社債	1.7	100,000	101,505	2014/2/3
第5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	1.23	200,000	203,088	2015/1/27
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	1.07	100,000	101,601	2015/9/3
第9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	1.2	100,000	102,843	2017/3/9
第1回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	1.65	100,000	101,482	2014/2/10
第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	1.22	100,000	101,553	2015/2/10
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	0.98	100,000	101,571	2016/1/21
第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	1.49	100,000	101,909	2014/8/6
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	0.94	100,000	101,719	2015/7/28
第1回エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー円貨社債	1.49	100,000	101,893	2014/9/29
小 計		21,400,000	22,176,202	
合 計		331,010,784	346,857,127	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
国内 10年国債標準物	1,011	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 346,857,127	98.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,539,324	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	351,396,451	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 2013年1月22日現在
(A) 資 産	351,501,435,800円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,412,366,484
公 社 債(評価額)	346,857,127,773
未 収 入 金	1,039,472,295
未 収 利 息	1,028,424,763
前 払 費 用	59,830,485
差 入 委 託 証 拠 金	104,214,000
(B) 負 債	1,492,575,489
未 払 金	1,131,786,000
未 払 解 約 金	255,805,489
差入委託証拠金代用有価証券	104,984,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	350,008,860,311
元 本	285,638,838,059
次 期 繰 越 損 益 金	64,370,022,252
(D) 受 益 権 総 口 数	285,638,838,059口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	12,254円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2012年1月24日 至 2013年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	4,724,634,806円
受 取 利 息	4,724,634,806
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,247,921,420
売 買 益	4,188,260,063
売 買 損	△940,338,643
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	53,473,395
取 引 益	84,816,335
取 引 損	△31,342,940
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	8,026,029,621
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	59,509,768,711
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,775,666,467
(G) 解 約 差 損 益 金	△16,941,442,547
(H) 計 (D+E+F+G)	64,370,022,252
次 期 繰 越 損 益 金(H)	64,370,022,252

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

〈注記事項〉

※当マザーファンドの期首元本額は300,354,009,418円、期中追加設定元本額は65,061,600,716円、期中一部解約元本額は79,776,772,075円です。

※1口当たり純資産額は、1.2254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 105,523,000円(決算日現在の代用有価証券の時価額)

※当マザー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。

バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	50,356,698,429円	VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,244,885,978円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	33,992,486,400円	インデックスコレクション (バランス株式30)	1,183,479,587円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	30,137,016,453円	DCバランスファンド30	1,033,791,079円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	29,029,569,418円	DCバランスファンド50	1,027,870,105円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	24,475,815,712円	VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	966,574,925円
DC日本債券インデックスファンドL	23,535,838,805円	インデックスコレクション (バランス株式50)	891,646,649円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	10,960,869,336円	日本債券インデックスe	739,550,296円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	10,124,902,380円	VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	632,029,254円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	7,186,540,328円	バランスVA20L (適格機関投資家専用)	622,950,629円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	7,125,487,202円	インデックスコレクション (バランス株式70)	343,960,691円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	6,639,305,890円	日本債券・株式バランスファンド (資産配分調整型)	327,126,995円
日本債券インデックスファンド	6,380,757,220円	国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	300,827,434円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	5,314,841,606円	日本債券インデックスファンド (SMA専用)	263,069,343円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	4,868,912,929円	DCバランスファンド70	256,050,498円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	4,385,825,449円	バランスVA75 (適格機関投資家専用)	216,653,642円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	3,913,761,641円	ベスタ・世界6資産ファンド (毎月決算型)	148,352,661円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	3,507,849,415円	国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	141,718,764円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	2,532,729,575円	新生・4分散ファンド	129,741,663円
インデックスコレクション (国内債券)	2,155,840,594円	4資産インデックスバランスオープン (成長型)	114,532,312円
DC日本債券インデックスファンド	2,119,154,168円	ベスタ・世界6資産ファンド (1年決算型)	94,536,808円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	1,744,923,474円	4資産インデックスバランスオープン (分配型)	30,151,025円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	1,589,456,592円	世界バランスVA20 (適格機関投資家専用)	22,274,644円
VAバランス株式40 (適格機関投資家専用)	1,549,557,134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)	13,370,780円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	1,265,552,147円		

約款変更のお知らせ

当ファンドの委託会社の合併に伴い、委託会社名及び当ファンドの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、当ファンドの受託会社の合併に伴い、受託会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、投資助言会社の合併に伴い、投資助言会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2012年4月1日)