

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2017年10月12日>

たわらノーロード 国内債券

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	2015年12月18日から無期限です。	
運用方針	NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	たわらノーロード 国内債券	国内債券パッシブ・ ファンド・マザーファン ド受益証券を主要投 資対象とします。
	国内債券パッシブ・ ファンド・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。
運用方法	マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として国内の公社債に実質的に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざします。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%未満とします。	
分配方針	決算日（原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、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。）等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「たわらノーロード 国内債券」は、2017年10月12日に第2期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

たわらノーロード 国内債券

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
(設定日) 2015年12月18日	円	円	%	ポイント (12月17日)	%	%	%	%	百万円
	10,000	-	-	367.68	-	-	-	-	1
1期(2016年10月12日)	10,411	0	4.1	384.37	4.5	99.5	-	-	1,149
2期(2017年10月12日)	10,253	0	△1.5	379.22	△1.3	99.1	-	-	2,903

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)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。

(注4) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、そ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、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません(以下同じ)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
(期首) 2016年10月12日	円	%	ポイント	%	%	%	%
	10,411	-	384.37	-	99.5	-	-
10月末	10,412	0.0	384.44	0.0	99.5	-	-
11月末	10,344	△0.6	381.97	△0.6	99.4	-	-
12月末	10,285	△1.2	379.82	△1.2	99.5	-	-
2017年1月末	10,227	△1.8	377.74	△1.7	99.5	-	-
2月末	10,257	△1.5	378.90	△1.4	99.2	-	-
3月末	10,242	△1.6	378.49	△1.5	99.6	-	-
4月末	10,292	△1.1	380.33	△1.1	99.6	-	-
5月末	10,270	△1.4	379.55	△1.3	99.4	-	-
6月末	10,239	△1.7	378.57	△1.5	99.6	-	-
7月末	10,239	△1.7	378.55	△1.5	99.5	-	-
8月末	10,293	△1.1	380.58	△1.0	99.3	-	-
9月末	10,254	△1.5	379.27	△1.3	99.6	-	-
(期末) 2017年10月12日	10,253	△1.5	379.22	△1.3	99.1	-	-

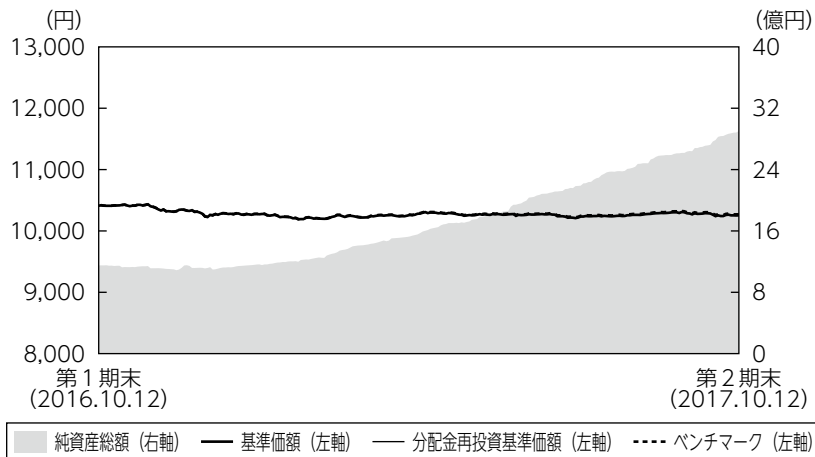
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)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。

■当期の運用経過（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

基準価額等の推移



第2期首：10,411円
第2期末：10,253円
(既払分配金0円)
騰落率：△1.5%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、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さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さま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およびベンチマークは、期首の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

米国のトランプ新大統領による経済・財政政策への期待から、世界的に株価上昇・債券価格下落の流れが強まったことなどを背景に、国内債券市場が下落（利回りは上昇）したことから、基準価額は下落しました。日銀による強力な金融緩和が続いていることや、北朝鮮情勢の緊迫化等を受けてリスク回避の動きが強まり、債券が買われる局面があったことなどはプラス要因となりましたが、通期では基準価額は下落する結果となりました。

投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。2016年11月中旬以降、米国大統領選挙で勝利したトランプ氏による経済・財政政策への期待感から世界的に株高・債券安の展開となったことなどを受けて、日本でも債券市場は下落しました。その後は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続するなか、日銀による国債買い入れ方針や海外の長期金利の動向、北朝鮮情勢等をにらみつつ、国内債券市場は揉み合う展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

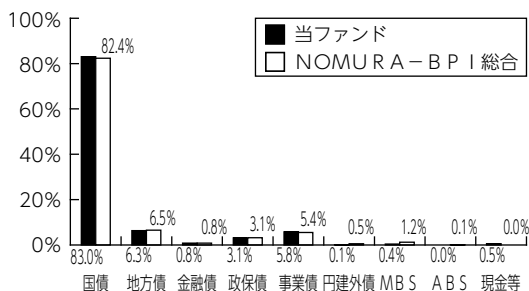
●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

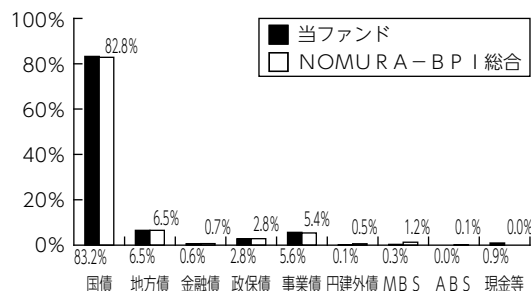
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

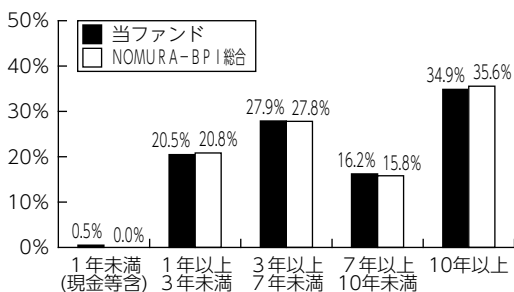


期末

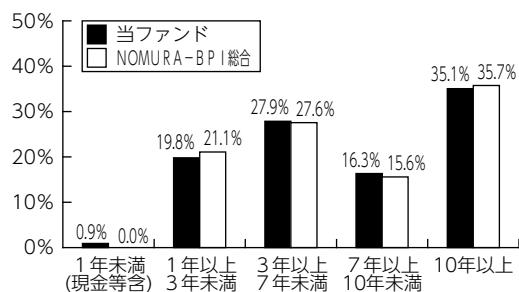


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



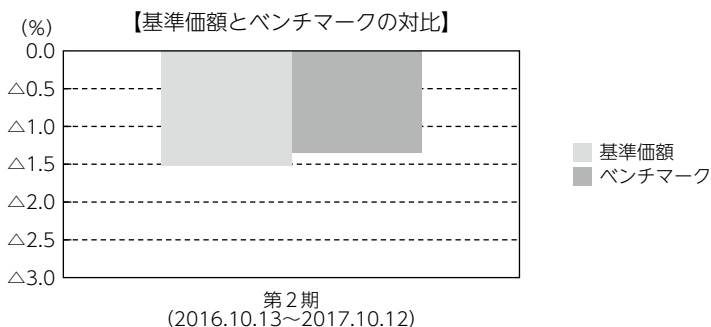
期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%と、信託報酬の影響を除くとベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2016年10月13日 ～2017年10月12日
当期分配金（税引前）	－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	253円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が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、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	(2016年10月13日 ～2017年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	17円	0.162%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,275円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託銀行分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(7)	(0.070)	
(販売会社)	(7)	(0.070)	
(受託銀行)	(2)	(0.022)	
(b) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.002 (0.002)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	17	0.164	

(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) 金額欄は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。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,539,919	1,973,140	159,103	204,910

■利害関係人との取引状況等（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

【たわらノーロード 国内債券における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 81,846	百万円 928	% 1.1	百万円 95,259	百万円 -	% -

平均保有割合 0.5%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
債 券	百万円 -	百万円 303	百万円 311

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ銀行です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 885,657	千□ 2,266,473	千円 2,903,125

■投資信託財産の構成

2017年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,903,125	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,540	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	2,921,665	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,921,665,399円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,540,049
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,903,125,350
(B) 負 債	18,449,661
未 払 解 約 金	16,639,203
未 払 信 託 報 酬	1,786,738
そ の 他 未 払 費 用	23,720
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,903,215,738
元 本	2,831,466,975
次 期 繰 越 損 益 金	71,748,763
(D) 受 益 権 総 口 数	2,831,466,975口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,253円

(注) 期首における元本額は1,104,604,226円、当期中における追加設定元本額は2,620,258,169円、同解約元本額は893,395,420円です。

■損益の状況

当期 自2016年10月13日 至2017年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,945円
受 取 利 息	1,352
支 払 利 息	△7,297
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△8,819,585
売 買 損 益	5,631,547
買 入 損 益	△14,451,132
(C) 信 託 報 酬 等	△2,814,472
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△11,640,002
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△497,893
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	83,886,658
(配 当 等 相 当 額)	(13,519,707)
(売 買 損 益 相 当 額)	(70,366,951)
(G) 合 計(D+E+F)	71,748,763
次 期 繰 越 損 益 金(G)	71,748,763
追 加 信 託 差 損 益 金	83,886,658
(配 当 等 相 当 額)	(14,357,117)
(売 買 損 益 相 当 額)	(69,529,541)
分 配 準 備 積 立 金	18,027,547
繰 越 損 益 金	△30,165,442

(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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	14,891,448円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	53,721,216
(d) 分配準備積立金	3,136,099
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	71,748,763
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	253.40
(g) 分配金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第14期 (決算日 2017年2月14日)

(計算期間 2016年2月16日～2017年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率				
10期 (2013年2月14日)	11,640	2.0	ポイント 344.40	% 2.0	% 99.1	% -	% -	百万円 442,057
11期 (2014年2月14日)	11,945	2.6	353.47	2.6	99.4	-	-	442,682
12期 (2015年2月16日)	12,161	1.8	359.95	1.8	98.5	-	-	422,496
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	373.37	3.7	98.6	-	-	400,593
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	-	-	379,734

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、そ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、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約債 付社債 (転換社債) 比	債券先物率 比
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2016年2月15日	円 12,614	% -	ポイント 373.37	% -	% 98.6	% -	% -
2月 末	12,831	1.7	379.83	1.7	99.2	-	-
3月 末	12,932	2.5	382.91	2.6	99.7	-	-
4月 末	13,046	3.4	386.25	3.5	99.4	-	-
5月 末	13,092	3.8	387.60	3.8	99.4	-	-
6月 末	13,251	5.0	392.36	5.1	99.7	-	-
7月 末	13,139	4.2	389.24	4.3	99.6	-	-
8月 末	13,014	3.2	385.24	3.2	99.5	-	-
9月 末	13,021	3.2	385.50	3.3	99.6	-	-
10月 末	12,987	3.0	384.44	3.0	99.5	-	-
11月 末	12,904	2.3	381.97	2.3	99.4	-	-
12月 末	12,832	1.7	379.82	1.7	99.5	-	-
2017年1月 末	12,762	1.2	377.74	1.2	99.5	-	-
(期末) 2017年2月14日	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	-	-

(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。

■当期の運用経過（2016年2月16日から2017年2月14日まで）

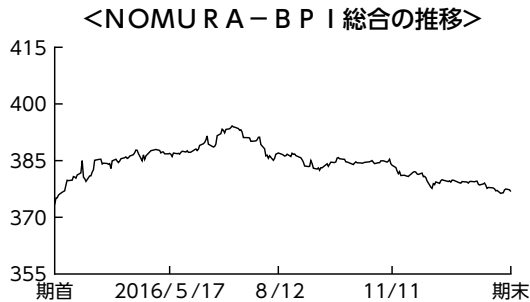


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,730円となり、前期末比で0.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日銀が導入したマイナス金利政策により、投資家がプラスの利回りの債券を求める動きが強まったことや、日銀による巨額の国債購入が債券の需給面の支えとなったことなどを背景に期前半に債券価格が上昇（利回りは低下）したことから、基準価額は上昇しました。2016年7月中旬以降、急速な利回り低下に対する警戒感が強まったことや、世界的に債券が売られる展開となったこと等はマイナス要因となりましたが、通期では基準価額は上昇する結果となりました。



投資環境

当期の国内債券市場では、残存期間の長い債券を中心に上昇（利回りは低下）しました。期初から7月上旬にかけては、日銀が導入したマイナス金利政策の影響等から債券価格は大幅に上昇し、10年国債利回りは一時△0.300%まで低下しました。しかしその後は、日銀がマイナス金利の拡大を見送ったことや、米国大統領選挙で勝利したトランプ氏による経済政策への期待感から、世界的に株高・債券安の展開となったことなどをを受けて国内債券は下落し、通期での上昇幅を縮小させました。

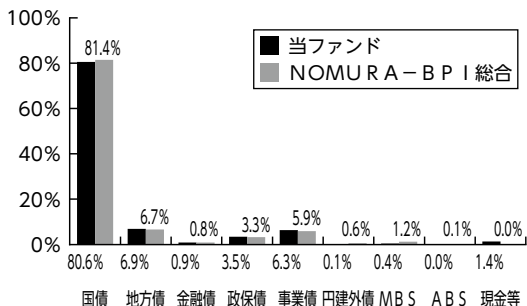
ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

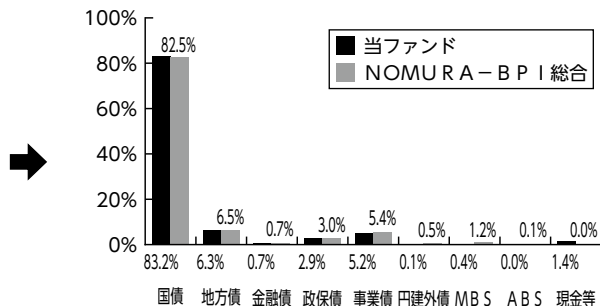
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

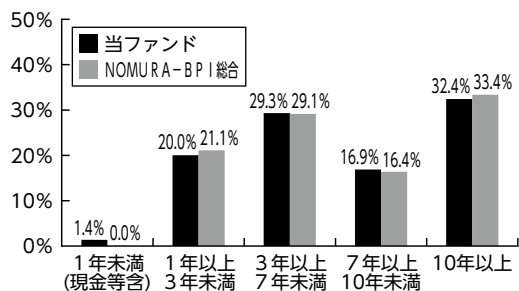


期末

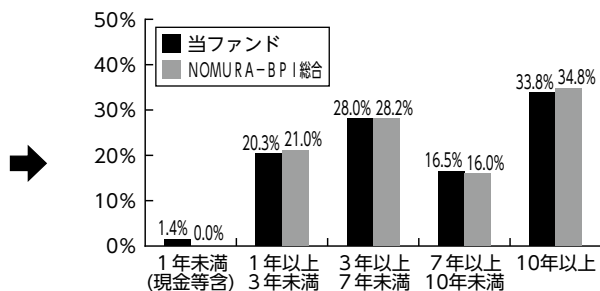


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)
合 計	0	0.000

(注) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(12,980円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2016年2月16日から2017年2月14日まで) 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	90,692,960	98,439,018 (-)
	地 方 債 証 券	722,626	4,357,671 (-)
	特 殊 債 券	402,776	5,448,928 (306,834)
	社 債 券	659,016	4,711,114 (-)

(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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2016年2月16日から2017年2月14日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
債 券	百万円 -	百万円 303	百万円 315

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ銀行です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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
国 債 証 券	千円 288,020,000	千円 315,785,941	% 83.2	% -	% 53.9	% 20.3	% 9.0
地 方 債 証 券	22,844,400	23,898,672	6.3	-	3.8	2.4	0.2
特 殊 債 券	15,009,281	15,635,684	4.1	-	1.9	1.6	0.6
金 融 債 券	2,660,000	2,673,915	0.7	-	-	0.3	0.4
普 通 社 債 券	15,861,000	16,568,620	4.4	-	1.3	2.2	0.9
合 計	344,394,681	374,562,834	98.6	-	60.8	26.7	11.1

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
109回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,000,000	2,008,400	2018/03/20
110回 利付国庫債券(5年)	0.3000	2,000,000	2,012,760	2018/03/20
363回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,004,350	2018/04/15
364回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,500,000	1,506,810	2018/05/15
365回 利付国庫債券(2年)	0.1000	2,500,000	2,511,975	2018/06/15
112回 利付国庫債券(5年)	0.4000	1,500,000	1,513,605	2018/06/20
113回 利付国庫債券(5年)	0.3000	2,000,000	2,015,460	2018/06/20
293回 利付国庫債券(10年)	1.8000	1,200,000	1,233,396	2018/06/20
366回 利付国庫債券(2年)	0.1000	4,000,000	4,020,040	2018/07/15
367回 利付国庫債券(2年)	0.1000	500,000	502,695	2018/08/15
114回 利付国庫債券(5年)	0.3000	3,500,000	3,530,450	2018/09/20
296回 利付国庫債券(10年)	1.5000	2,000,000	2,055,760	2018/09/20
40回 利付国庫債券(20年)	2.3000	720,000	749,102	2018/09/20
369回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,005,830	2018/10/15
370回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,006,220	2018/11/15
371回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,006,420	2018/12/15
116回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,200,000	4,234,524	2018/12/20
297回 利付国庫債券(10年)	1.4000	2,300,000	2,369,299	2018/12/20
117回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,000,000	4,033,960	2019/03/20
299回 利付国庫債券(10年)	1.3000	900,000	928,395	2019/03/20
42回 利付国庫債券(20年)	2.6000	800,000	846,864	2019/03/20
118回 利付国庫債券(5年)	0.2000	3,700,000	3,733,892	2019/06/20
301回 利付国庫債券(10年)	1.5000	2,900,000	3,014,811	2019/06/20

銘 柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
120回 利付国庫債券(5年)	0.2000	1,500,000	1,514,640	2019/09/20
121回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,000,000	2,014,300	2019/09/20
303回 利付国庫債券(10年)	1.4000	1,300,000	1,353,300	2019/09/20
43回 利付国庫債券(20年)	2.9000	860,000	928,722	2019/09/20
122回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,500,000	4,533,390	2019/12/20
305回 利付国庫債券(10年)	1.3000	2,500,000	2,603,800	2019/12/20
123回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,500,000	3,526,565	2020/03/20
306回 利付国庫債券(10年)	1.4000	1,500,000	1,572,120	2020/03/20
45回 利付国庫債券(20年)	2.4000	900,000	970,740	2020/03/20
124回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,500,000	4,535,460	2020/06/20
308回 利付国庫債券(10年)	1.3000	800,000	838,368	2020/06/20
309回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,041,250	2020/06/20
46回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	539,140	2020/06/22
125回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,000,000	3,024,330	2020/09/20
310回 利付国庫債券(10年)	1.0000	2,800,000	2,913,120	2020/09/20
47回 利付国庫債券(20年)	2.2000	950,000	1,029,562	2020/09/21
126回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,500,000	3,529,680	2020/12/20
312回 利付国庫債券(10年)	1.2000	2,200,000	2,311,606	2020/12/20
48回 利付国庫債券(20年)	2.5000	500,000	550,375	2020/12/21
127回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,000,000	3,026,490	2021/03/20
313回 利付国庫債券(10年)	1.3000	3,000,000	3,173,010	2021/03/20
50回 利付国庫債券(20年)	1.9000	780,000	844,108	2021/03/22
128回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,000,000	4,036,600	2021/06/20

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
315回 利付国庫債券(10年)	1.2000	1,500,000	1,584,990	2021/06/20
51回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	654,666	2021/06/21
129回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,500,000	3,532,270	2021/09/20
317回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,054,860	2021/09/20
318回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,000,000	1,050,250	2021/09/20
52回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	605,429	2021/09/21
130回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,500,000	1,514,220	2021/12/20
319回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,500,000	1,586,400	2021/12/20
320回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,500,000	1,579,110	2021/12/20
54回 利付国庫債券(20年)	2.2000	700,000	777,749	2021/12/20
321回 利付国庫債券(10年)	1.0000	2,500,000	2,637,250	2022/03/20
55回 利付国庫債券(20年)	2.0000	810,000	896,111	2022/03/21
324回 利付国庫債券(10年)	0.8000	2,000,000	2,092,680	2022/06/20
57回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,130,000	1,248,977	2022/06/20
325回 利付国庫債券(10年)	0.8000	2,700,000	2,829,465	2022/09/20
58回 利付国庫債券(20年)	1.9000	600,000	665,790	2022/09/20
326回 利付国庫債券(10年)	0.7000	1,700,000	1,774,681	2022/12/20
60回 利付国庫債券(20年)	1.4000	990,000	1,074,407	2022/12/20
328回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,500,000	1,559,055	2023/03/20
61回 利付国庫債券(20年)	1.0000	800,000	851,288	2023/03/20
329回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,200,000	1,264,056	2023/06/20
62回 利付国庫債券(20年)	0.8000	800,000	842,440	2023/06/20
330回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,700,000	1,793,194	2023/09/20
64回 利付国庫債券(20年)	1.9000	600,000	676,032	2023/09/20
332回 利付国庫債券(10年)	0.6000	2,000,000	2,084,940	2023/12/20
65回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,100,000	1,244,254	2023/12/20
333回 利付国庫債券(10年)	0.6000	2,000,000	2,085,040	2024/03/20
67回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,900,000	2,155,854	2024/03/20
334回 利付国庫債券(10年)	0.6000	2,600,000	2,710,500	2024/06/20
70回 利付国庫債券(20年)	2.4000	1,250,000	1,468,025	2024/06/20
335回 利付国庫債券(10年)	0.5000	2,000,000	2,071,200	2024/09/20
72回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,250,000	1,445,987	2024/09/20
336回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,000,000	1,035,950	2024/12/20
337回 利付国庫債券(10年)	0.3000	1,300,000	1,326,416	2024/12/20
73回 利付国庫債券(20年)	2.0000	1,190,000	1,372,308	2024/12/20
338回 利付国庫債券(10年)	0.4000	2,500,000	2,570,475	2025/03/20
75回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,400,000	1,631,826	2025/03/20
339回 利付国庫債券(10年)	0.4000	2,300,000	2,365,872	2025/06/20
78回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,450,000	1,672,778	2025/06/20
340回 利付国庫債券(10年)	0.4000	3,000,000	3,087,180	2025/09/20
81回 利付国庫債券(20年)	2.0000	1,400,000	1,632,148	2025/09/20
341回 利付国庫債券(10年)	0.3000	3,500,000	3,570,700	2025/12/20
83回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,400,000	1,649,718	2025/12/20
342回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,000,000	4,009,000	2026/03/20
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,400,000	1,655,878	2026/03/20

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,000,000	4,007,400	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	1,200,000	1,447,632	2026/06/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,000,000	4,005,680	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,200,000	1,442,148	2026/09/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,000,000	2,001,940	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,300,000	1,554,878	2026/12/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	700,000	833,238	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	800,000	960,264	2027/03/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	1,200,000	1,468,668	2027/06/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,400,000	1,703,660	2027/09/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,400,000	1,693,020	2027/12/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,300,000	1,590,641	2028/03/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	1,400,000	1,749,272	2028/06/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,300,000	1,584,310	2028/09/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,700,000	2,077,213	2028/12/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,600,000	1,922,144	2029/03/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,600,000	1,984,160	2029/06/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	100,000	131,611	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,500,000	1,845,510	2029/09/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,500,000	1,849,845	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	127,252	2030/02/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,800,000	2,246,238	2030/03/20
3回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	252,438	2030/05/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	1,000,000	1,224,330	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,077,993	2030/06/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,700,000	2,060,587	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	269,600	2030/11/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,700,000	2,109,445	2030/12/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	1,800,000	2,260,728	2031/03/20
5回 利付国庫債券(30年)	2.2000	200,000	251,602	2031/05/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	700,000	851,634	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,081,881	2031/06/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,500,000	1,803,195	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	258,082	2031/11/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,800,000	2,139,804	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,083,906	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	800,000	952,040	2032/03/20
7回 利付国庫債券(30年)	2.3000	300,000	383,604	2032/05/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,700,000	2,023,782	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,600,000	1,905,264	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	300,000	362,013	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,100,000	2,501,100	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,100,000	2,469,684	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	400,000	476,464	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,400,000	1,667,624	2033/06/20

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 2回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	300,000	376,131	2033/09/20
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,600,000	1,907,296	2033/09/20
1 3回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	300,000	371,919	2033/12/20
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,700,000	1,998,214	2033/12/20
1 4回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	500,000	652,635	2034/03/20
1 4 8回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,500,000	1,738,875	2034/03/20
1 5回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	264,668	2034/06/20
1 4 9回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,200,000	2,546,962	2034/06/20
1 6回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	400,000	529,784	2034/09/20
1 5 0回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	1,700,000	1,939,547	2034/09/20
1 7回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	261,600	2034/12/20
1 5 1回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	1,800,000	1,990,080	2034/12/20
1 8回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	820,000	1,060,432	2035/03/20
1 5 2回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	1,300,000	1,435,460	2035/03/20
1 9回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	258,522	2035/06/20
1 5 3回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	1,900,000	2,126,765	2035/06/20
2 0回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	300,000	398,334	2035/09/20
1 5 4回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	1,500,000	1,651,905	2035/09/20
2 1回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	500,000	646,620	2035/12/20
1 5 5回 利付国庫債券 (20年)	1.0000	1,600,000	1,702,560	2035/12/20
2 2回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	470,000	625,076	2036/03/20
1 5 6回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,500,000	1,431,450	2036/03/20
2 3回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	600,000	798,930	2036/06/20
1 5 7回 利付国庫債券 (20年)	0.2000	1,500,000	1,373,415	2036/06/20
2 4回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	300,000	399,924	2036/09/20
1 5 8回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,800,000	1,740,960	2036/09/20
2 5回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	400,000	518,724	2036/12/20
1 5 9回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,000,000	983,430	2036/12/20
2 6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	700,000	921,746	2037/03/20
2 7回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	900,000	1,206,756	2037/09/20
2 8回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	800,000	1,076,464	2038/03/20
2 9回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	1,100,000	1,463,099	2038/09/20
3 0回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	1,000,000	1,314,880	2039/03/20
3 1回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,100,000	1,428,823	2039/09/20
3 2回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	1,200,000	1,587,912	2040/03/20
3 3回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,300,000	1,642,186	2040/09/20
3 4回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,200,000	1,572,636	2041/03/20
3 5回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,500,000	1,905,105	2041/09/20
3 6回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,400,000	1,782,676	2042/03/20
3 7回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,400,000	1,755,096	2042/09/20
3 8回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,000,000	1,233,130	2043/03/20
3 9回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	800,000	1,005,664	2043/06/20
4 0回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	700,000	863,905	2043/09/20
4 1回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	800,000	968,720	2043/12/20
4 2回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,000,000	1,211,150	2044/03/20

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 3回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	800,000	969,128	2044/06/20
4 4回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	800,000	969,304	2044/09/20
4 5回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,000,000	1,162,030	2044/12/20
4 6回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,200,000	1,394,244	2045/03/20
4 7回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,000,000	1,187,560	2045/06/20
4 8回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,100,000	1,252,119	2045/09/20
4 9回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,000,000	1,139,270	2045/12/20
5 0回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,200,000	1,183,236	2046/03/20
5 1回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,100,000	941,336	2046/06/20
5 2回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,100,000	997,172	2046/09/20
5 3回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	200,000	186,324	2046/12/20
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	600,000	816,564	2049/03/20
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	700,000	957,642	2050/03/20
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	800,000	1,099,976	2051/03/20
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	800,000	1,057,216	2052/03/20
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	700,000	906,731	2053/03/20
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	800,000	990,352	2054/03/20
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,000,000	1,145,070	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,000,000	819,860	2056/03/20
小計	-	288,020,000	315,785,941	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
6 5 9回 東京都公募公債	1.6200	203,500	207,922	2018/06/20
6 5 回 共同発行市場公募地方債	1.6200	100,000	102,460	2018/08/24
2 0年度 4回 愛知県公募公債	1.6000	100,000	102,568	2018/09/25
3 1 9回 大阪府公募公債	1.6900	200,000	205,752	2018/10/30
6 6 7回 東京都公募公債	1.5700	300,000	309,765	2019/03/20
2 1年度 4回 埼玉県公募公債	1.4600	200,000	207,146	2019/07/29
2 1年度 3回 福岡県公募公債	1.5500	200,000	207,850	2019/08/27
2 1年度 6回 北海道公募公債	1.6000	200,000	208,102	2019/08/28
1 6 6回 神奈川県公募公債	1.3600	300,000	310,716	2019/09/20
2 1年度 6回 千葉県公募公債	1.4100	200,000	207,398	2019/09/25
2 1年度 5回 静岡県公募公債	1.3500	197,000	204,101	2019/10/18
8 0回 共同発行市場公募地方債	1.5400	200,000	208,542	2019/11/25
2 1年度 2回 北九州市公募公債	1.3600	200,000	207,744	2019/12/24
6 8 0回 東京都公募公債	1.3900	200,000	208,558	2020/03/19
3 3 6回 大阪府公募公債	1.4600	200,000	209,048	2020/03/30
2 2年度 1回 広島県公募公債	1.3700	200,000	208,958	2020/05/27
6 8 5回 東京都公募公債	1.1300	500,000	518,810	2020/06/19
2回 川崎市公募公債 15年	1.6300	100,000	105,448	2020/06/22
2 2年度 6回 愛知県公募公債	1.1780	200,000	208,104	2020/07/30
2 2年度 8回 静岡県公募公債	1.0590	200,000	207,434	2020/08/25
6 8 8回 東京都公募公債	0.9400	200,000	206,716	2020/09/18
2 2年度 3回 横浜市公募公債	1.1680	200,000	208,314	2020/09/18
2 2年度 5回 横浜市公募公債	1.2650	200,000	209,584	2020/12/11
3 4 5回 大阪府公募公債	1.2600	300,000	314,343	2020/12/25

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
9 4回 共同発行市場公募地方債	1.2400	500,000	524,110	2021/01/25
2 2年度 1 2回 北海道公募債	1.2900	200,000	210,016	2021/01/28
2 3年度 1回 千葉市公募債	1.3700	200,000	211,282	2021/04/21
2 3年度 2回 埼玉県公募債	1.1900	200,000	209,950	2021/05/25
6 9 7回 東京都公募債	1.1100	500,000	523,755	2021/06/18
9 9回 共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	734,916	2021/06/25
7 0 1回 東京都公募債	0.9900	700,000	731,458	2021/09/17
2 3年度 4回 横浜市公募債	1.0450	450,000	471,568	2021/11/12
2 3年度 9回 静岡県公募債	1.0450	200,000	209,650	2021/11/25
3 5 6回 大阪府公募債	1.0600	200,000	209,808	2021/12/27
1 0 6回 共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	313,695	2022/01/25
2 3年度 2 0回 愛知県公募債	1.0820	500,000	526,335	2022/03/29
1 0 9回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	525,885	2022/04/25
7 0 8回 東京都公募債	0.8900	500,000	522,525	2022/06/20
1 1 1回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	731,199	2022/06/24
3 6 4回 大阪府公募債	0.7900	300,000	311,997	2022/09/27
1 9 4回 神奈川県公募債	0.7910	300,000	312,603	2022/12/20
2 4年度 7回 千葉県公募債	0.7400	300,000	311,721	2022/12/22
1 1 9回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	521,755	2023/02/24
1 2 1回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	515,250	2023/04/25
2 5年度 4回 愛知県公募債	0.8560	300,000	314,562	2023/05/30
7 2 0回 東京都公募債	0.8700	300,000	315,159	2023/06/20
2 5年度 4回 札幌市公募債	0.8000	200,000	209,090	2023/06/20
2 5年度 2回 横浜市公募債	0.8880	400,000	420,480	2023/07/14
3 7 4回 大阪府公募債	0.9380	300,000	316,209	2023/07/28
2 5年度 5回 千葉県公募債	0.8400	200,000	209,730	2023/08/25
1 2 6回 共同発行市場公募地方債	0.8100	793,900	831,189	2023/09/25
1 2 7回 共同発行市場公募地方債	0.6800	500,000	519,280	2023/10/25
1 2 8回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	311,199	2023/11/24
7 2 6回 東京都公募債	0.7300	400,000	417,276	2023/12/20
2 5年度 1 1回 福岡県公募債	0.6940	200,000	208,006	2024/02/26
2 0 8回 神奈川県公募債	0.5510	300,000	308,850	2024/06/20
1回 兵庫県公募債(1 2年)	1.1000	300,000	320,634	2024/06/26
2 6年度 5回 埼玉県公募債	0.6110	400,000	413,588	2024/07/29
1 3 7回 共同発行市場公募地方債	0.5660	500,000	515,275	2024/08/23
4 8 8回 名古屋市公募債 1 0年	0.5980	450,000	464,967	2024/09/20
1 3 9回 共同発行市場公募地方債	0.5440	500,000	514,590	2024/10/25
2 6年度 1 1回 京都府公募債	0.4760	350,000	358,428	2024/12/19
1 4 2回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	506,855	2025/01/24
2 6年度 1 7回 兵庫県公募債	0.4600	200,000	204,434	2025/02/26
5回 東京都公募債 2 0年	2.1100	100,000	115,620	2025/03/19
1 4 4回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	409,592	2025/03/25
1 4 6回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	412,320	2025/05/23
1 4 8回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	515,505	2025/07/25
1回 静岡県公募債 2 0年	2.1800	100,000	116,976	2025/09/19

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
9回 東京都公募債 2 0年	2.4400	200,000	241,538	2026/06/19
1 0回 東京都公募債 2 0年	2.3300	300,000	360,657	2026/09/18
4回 京都市公募債 2 0年	2.5100	100,000	121,801	2026/09/18
小計	-	22,844,400	23,898,672	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
2 1回 政保日本高速道路債券	1.7000	300,000	306,489	2018/05/21
6 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	707,000	724,576	2018/06/29
5回 中日本高速道路債券	1.8600	200,000	205,956	2018/09/20
6 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.5000	162,000	165,970	2018/09/28
6 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.6000	401,000	412,063	2018/10/31
7 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	600,000	615,792	2018/12/25
4 8回 高速道路機構債	1.7100	700,000	725,116	2019/03/20
7 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	700,000	721,896	2019/04/30
8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.5000	651,000	673,420	2019/05/24
8 2回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.5000	100,000	103,587	2019/06/28
3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5000	101,000	104,835	2019/08/16
3 7回 住宅金融支援機構債券	1.4000	300,000	310,941	2019/09/20
8 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	300,000	310,392	2019/09/30
5回 地方公共団体金融機構債券	1.3950	500,000	518,865	2019/10/28
8回 政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	300,000	311,568	2020/01/20
1 0回 政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	500,000	520,210	2020/03/13
1 5回 政保地方公共団体金融機構債券	1.0000	200,000	207,100	2020/08/14
2 0回 政保地方公共団体金融機構債券	1.2000	300,000	314,376	2021/01/20
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	107,875	2021/03/26
2 4回 地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	315,321	2021/05/28
1 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	330,237	2021/08/30
1 4 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	419,492	2021/11/30
3 6回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	314,379	2022/05/20
9 6回 高速道路機構債	0.7960	700,000	728,735	2022/09/20
1 8 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.7340	1,000,000	1,042,490	2022/12/28
4 4回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	419,420	2023/01/20
5 5回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	522,785	2023/03/20
1 8 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	516,130	2023/04/28
1 9 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	527,430	2023/06/30
5 0回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	528,355	2023/07/14
1 9 5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	348,849	2023/07/31
1 1 6回 高速道路機構債	0.7220	100,000	104,008	2023/09/20
6 4回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	310,134	2024/09/13
2 4 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	513,065	2025/03/31
1 3回 貸付債担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	26,095	27,231	2032/05/10
1 4回 貸付債担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	132,875	137,748	2032/05/10
4回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.8200	37,233	38,120	2036/12/10
6回 貸付債担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	55,488	59,119	2037/05/10
8回 貸付債担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	39,092	41,638	2037/05/10
9回 貸付債担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	57,975	61,794	2037/05/10

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)				
	%	千円	千円	
2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	61,869	66,434	2037/11/10
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	21,419	22,916	2041/06/10
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	80,908	86,506	2041/07/10
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	60,624	64,571	2042/02/10
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	108,705	115,218	2042/05/10
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	201,470	215,748	2044/10/10
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	373,528	396,776	2045/05/10
小計	-	15,009,281	15,635,684	-
(金融債券)				
	%	千円	千円	
755号 利付商工債	0.3000	260,000	260,907	2018/04/27
282回 利附信金中金債	0.3000	300,000	301,122	2018/05/25
186号 利付商工債(3年)	0.1600	200,000	200,446	2018/07/27
760号 利附農林債	0.4000	300,000	301,911	2018/09/27
764号 利附農林債	0.3500	500,000	503,380	2019/01/25
293回 利附信金中金債	0.2500	400,000	402,132	2019/04/26
い第769号 利付商工債	0.2500	200,000	201,136	2019/06/27
302回 利附信金中金債	0.2000	300,000	301,635	2020/01/27
い第779号 利付商工債	0.2200	200,000	201,246	2020/04/27
小計	-	2,660,000	2,673,915	-
(普通社債券)				
	%	千円	千円	
52回 東日本旅客鉄道社債	1.6200	300,000	305,622	2018/04/20
90回 三菱地所社債	1.6500	100,000	101,920	2018/04/24
23回 東海旅客鉄道社債	2.1400	100,000	102,522	2018/04/25
542回 東京電力社債	1.6020	500,000	508,310	2018/04/25
281回 北陸電力社債	1.9700	200,000	204,614	2018/04/25
69回 三菱商事社債	1.9900	300,000	307,404	2018/05/22
1回 スタンダード・チャータード円貨社債	0.3130	100,000	99,854	2018/06/05
17回 東京ガス社債	2.6250	100,000	103,485	2018/06/11
3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	1.9400	100,000	102,577	2018/06/20
49回 伊藤忠商事社債	2.2800	100,000	103,006	2018/06/20
15回 NTTドコモ社債	1.9600	200,000	205,234	2018/06/20
476回 中部電力社債	2.1200	100,000	102,825	2018/06/25
37回 三菱化学社債	2.0300	100,000	102,916	2018/08/10
455回 東京電力社債	2.0750	200,000	206,200	2018/10/23
410回 関西電力社債	2.0000	300,000	310,011	2018/11/22
237回 四国電力社債	2.0500	100,000	103,499	2018/11/22
56回 東日本旅客鉄道社債	1.7000	300,000	309,417	2018/12/20
15回 東海旅客鉄道社債	2.1900	200,000	209,104	2019/03/20
492回 関西電力社債	0.6090	200,000	201,980	2019/03/20
493回 関西電力社債	0.5840	200,000	201,972	2019/05/24
7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	2.5000	100,000	105,326	2019/06/03
4回 りそな銀行劣後社債	2.7660	100,000	106,005	2019/06/20
20回 三井住友銀行劣後社債	2.2100	200,000	209,914	2019/07/24
96回 三菱地所社債	1.6200	200,000	207,240	2019/07/29
164回 オリックス社債	1.1460	100,000	102,272	2019/08/07

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)				
	%	千円	千円	
423回 九州電力社債	0.9590	200,000	204,152	2019/09/25
8回 プリヂェストーン社債	0.2490	200,000	200,628	2019/09/26
14回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.1400	200,000	210,162	2019/09/27
41回 住友化学社債	1.6400	100,000	103,986	2019/10/18
7回 キリンホールディングス社債	1.6390	100,000	104,156	2019/11/05
7回 東京三菱銀行劣後社債	2.1100	200,000	210,870	2019/12/20
46回 野村ホールディングス社債	0.3460	200,000	201,126	2019/12/25
5回 東海旅客鉄道社債	2.6000	100,000	107,456	2020/01/28
6回 りそな銀行劣後社債	2.0840	100,000	105,540	2020/03/04
64回 新日本製鐵社債	1.5300	100,000	104,187	2020/03/19
12回 パナソニック社債	0.3870	200,000	201,316	2020/03/19
56回 日産自動車社債	0.5540	100,000	101,202	2020/03/19
38回 三井不動産社債	1.4970	200,000	207,788	2020/03/19
87回 住友不動産社債	0.8770	100,000	101,866	2020/03/19
27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	0.3800	200,000	199,978	2020/05/22
260回 北陸電力社債	2.3300	100,000	107,050	2020/05/25
14回 大和証券グループ本社社債	1.2520	100,000	103,334	2020/05/27
7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	1.5900	200,000	208,888	2020/06/08
9回 日本たばこ産業社債	0.2170	200,000	200,696	2020/07/15
496回 中部電力社債	1.2270	500,000	517,890	2020/07/24
15回 トヨタファイナンス社債	1.8000	200,000	211,390	2020/08/21
15回 東日本旅客鉄道社債	2.6500	300,000	326,934	2020/08/25
22回 中国高速道路債券	1.0360	300,000	310,995	2020/09/18
26回 野村ホールディングス社債	1.5470	100,000	104,910	2020/09/24
22回 三井住友銀行劣後社債	1.4300	200,000	208,634	2020/09/28
12回 住友信託銀行劣後債	1.3730	100,000	104,152	2020/11/11
25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.3100	200,000	208,036	2020/11/12
23回 三井住友銀行劣後社債	1.6100	400,000	420,884	2020/12/17
60回 日本電信電話社債	1.3100	300,000	313,167	2020/12/18
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.5600	200,000	210,350	2021/01/20
337回 東京交通債	2.2300	200,000	217,092	2021/03/19
473回 東北電力社債	0.5970	300,000	304,380	2021/04/23
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	1.6800	100,000	105,889	2021/04/28
32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.6200	300,000	317,481	2021/06/09
320回 北海道電力社債	0.5850	200,000	203,072	2021/12/24
6回 東海旅客鉄道社債	2.3900	100,000	111,205	2022/02/15
19回 東日本旅客鉄道社債	2.3600	100,000	111,116	2022/02/15
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	221,698	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	103,197	2022/04/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	103,633	2022/10/12
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	100,000	105,737	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	107,466	2022/12/20
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	209,438	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	103,820	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	205,950	2023/03/20

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	103,478	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	209,250	2023/06/23
377回 中国電力社債	1.1210	200,000	210,644	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	336,489	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	103,012	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	102,054	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	211,408	2023/11/24
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	313,332	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	200,000	211,172	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	418,144	2024/02/23

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	100,000	102,895	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	113,982	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	113,567	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	205,370	2024/10/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	166,517	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	344,424	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	226,756	2025/06/20
小計	-	15,861,000	16,568,620	-
合計	-	344,394,681	374,562,834	-

■投資信託財産の構成

2017年2月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	374,562,834	98.6
コール・ローン等、その他	5,505,603	1.4
投資信託財産総額	380,068,438	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	380,068,438,135円
コ ー ル ・ ク ー ン 等	3,449,122,477
公 社 債(評価額)	374,562,834,344
未 収 入 金	917,056,000
未 収 利 息	1,122,720,090
前 払 費 用	16,705,224
(B) 負 債	333,489,000
未 払 解 約 金	333,489,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	379,734,949,135
元 本	298,304,698,655
次 期 繰 越 損 益 金	81,430,250,480
(D) 受 益 権 総 口 数	298,304,698,655口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	12,730円

(注1) 期首元本額 317,585,333,198円
 追加設定元本額 65,258,815,743円
 一部解約元本額 84,539,450,286円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM国内債券パッシブ・ファンド	10,968,976,832円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	132,721,011円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	117,044,014円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	42,836,411円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	408,295,789円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	117,006,883円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	26,386,628円
たわらノーロード 国内債券	975,047,129円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円
D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,193,129,859円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	4,910,087,668円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	6,920,280,918円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,711,222,542円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	1,657,494,852円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,744,690,480円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	247,132,545円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	98,517,017円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	2,191,157,643円
マネックス資産設計ファンド エポリユーション	1,831,280円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	354,761,832円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	252,052,071円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	60,583,506円
投資のソムリエ	9,939,034,878円
グループコントロール	2,463,848,090円
投資のソムリエ<DC年金>	298,691,204円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	1,158,285,311円
D I AM DC バランス・F(成長型)	119,641,277円
グループコントロール<DC年金>	909,502円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,058,111円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	19,630,847円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	149,030,005円
ダイナミック・ナビゲーション	460,972円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	526,568,814円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
D I AM高金利通貨ファンド	9,608,918円

D I AMエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I AM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,037,609,957円
D I AMアクティブアロケーション私募ファンド(適)	558,537,681円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	511,856,892円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA	455,213,838円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA	280,476,820円
D I AM国際分散バランスファンド30VA	114,257,412円
D I AM国際分散バランスファンド50VA	322,043,880円
D I AM国内重視バランスファンド30VA	131,854,367円
D I AM国内重視バランスファンド50VA	78,484,954円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,644,584,098円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,169,804,357円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,018,729,559円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,484,376,480円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,274,589,120円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA	741,252,821円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	2,039,338,362円
D I AM アクサ グローバル バランスファンド30VA	4,297,535,212円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	5,595,899,939円
D I AMグローバル私募ファンド(適格機関投資家向け)	258,176,229円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	5,626,711,504円
D I AM世界アセットバランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	6,745,903,203円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	88,476,182,154円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,206,573,892円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,556,835,694円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	28,027,521,910円
D I AMバランス30VA(適格機関投資家限定)	96,567,737円
D I AMバランス50VA(適格機関投資家限定)	1,450,215円
D I AMバランス70VA(適格機関投資家限定)	8,244,501円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	31,365,226,436円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	548,898,159円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	139,363,216円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	645,759,687円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	454,852円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	351,483円
期末元本合計	298,304,698,655円

■損益の状況

当期 自2016年2月16日 至2017年2月14日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		4,045,863,258円
受 取 利 息		4,047,880,870
支 払 利 息		△2,017,612
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		235,617,130
売 買 益		4,294,645,860
売 買 損		△4,059,028,730
(C) そ の 他 費 用		△2,616
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		4,281,477,772
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		83,008,356,165
(F) 解 約 差 損 益 金		△25,390,498,714
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		19,530,915,257
(H) 合 計(D + E + F + G)		81,430,250,480
次 期 繰 越 損 益 金(H)		81,430,250,480

(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) (F)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3) (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。

《お知らせ》

■D I AMアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、ファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

■委託会社の統合により、約款に所要の変更を行いました。

(平成28年10月1日)